

南方中国中小盘股票指数证券投资基金 (LOF) 基金合同

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

目录

1.	前 言.....	2
2.	释 义.....	3
3.	基金的基本情况.....	8
4.	基金份额的发售.....	9
5.	基金备案.....	11
6.	基金份额的上市交易.....	12
7.	基金份额的申购、赎回与转换.....	14
8.	基金的转托管、非交易过户、冻结与质押.....	21
9.	基金合同当事人及其权利义务.....	22
10.	基金份额持有人大会.....	28
11.	基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	34
12.	基金托管.....	36
13.	基金的销售.....	37
14.	基金份额的注册登记.....	38
15.	基金的投资.....	39
16.	基金的财产.....	46
17.	基金资产估值.....	47
18.	基金费用与税收.....	52
19.	基金收益与分配.....	55
20.	基金的会计与审计.....	57
21.	基金的信息披露.....	58
22.	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	62
23.	违约责任.....	65
24.	争议的处理.....	66
25.	基金合同的效力.....	67
26.	业务规则.....	68
27.	其他事项.....	69
28.	基金合同内容摘要.....	70
29.	基金管理人和基金托管人签章.....	88

南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）基金合同正文

1. 前言

为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范基金运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作管理办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露管理办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售管理办法》）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）及相关法律法规，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，订立《南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”或“基金合同”）。

本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本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，如与本基金合同冲突，以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自本基金合同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本基金基金份额起，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人应按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规的规定享有权利、承担义务。

南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由基金管理人按照《基金法》、本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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者投资于本基金，必须自担风险。

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，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证投资于本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

现行法律法规变更引起本基金合同事项变更，或者本基金合同相关事项变更对基金份额持有人权利或权益无不良影响，经基金管理人和托管人协商一致，并经监管机关核准或备案，依法进行公告，可以不召开基金份额持有人大会即对本合同进行修改。

2. 释 义

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：

基金或本基金：	南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）；
基金合同或本基金合同：	指《南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期更新；
基金份额发售公告：	指《南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》；
托管协议：	指《南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充；
上市交易公告书：	指《南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）基金份额上市交易公告书》
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
国家外汇局：	指国家外汇管理局或其授权的代表机构；
境内：	指中华人民共和国(仅为基金合同目的而不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
《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的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《运作管理办法》：	指《证券投资基金运作管理办法》；
《销售管理办法》：	指《证券投资基金销售管理办法》；
《信息披露管理办法》：	指《证券投资基金信息披露管理办法》；
《试行办法》：	指《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》；
《通知》：	指《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》；
元：	指人民币元；

基金合同当事人：指受本基金合同约定，根据本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；

基金管理人：指南方基金管理有限公司；

基金托管人：指中国农业银行股份有限公司；

境外资产托管人：指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，受基金托管人委托为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构；

境外投资顾问：指符合法律法规规定的条件，根据基金管理人与其签订的合同，为本基金境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务的境外金融机构。基金管理人有权根据基金运作情况选择、聘请、更换或撤销境外投资顾问；

注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、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；

注册登记机构：指办理本基金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；

投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和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；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人；

机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者；

基金份额持有人大会：指按照本基金合同规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；

基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；

基金合同生效日：指基金募集期届满，基金募集的基金份额总额和募集金额超过核准的最低募集份额总额及最低募集金额，并且基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定，基金管理人

- 依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
- 存续期：指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 基金合同终止日：指本基金合同规定的合同终止事由出现后，按照本基金合同规定的程序终止本基金合同的日期；
- 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 开放日：指销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日（即深圳和上海证券交易所及本基金投资的主要市场同时交易的交易日）；
- 认购：指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人申请卖出本基金基金份额的行为；
- 转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为该基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；
- 系统内转托管：指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；
- 跨系统转登记：指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间进行转登记的行为；
- 会员单位：指深圳证券交易所的会员单位；
- 场内：指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回以及上市交易的场所；
- 场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所；
- 上市交易：指基金合同生效后投资者通过会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为；
- 注册登记系统：指中国证券登记结算有限公司开放式基金登记结算系统；
- 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限公司深圳分公司证券登记结算系统；
- 基金账户：指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基

	金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的注册登记系统；
证券账户：	指注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额的变动及结余情况的账户；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
公司行为信息：	指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动，及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息，包括但不限于权益派发、配股、提前赎回等信息；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站及其它媒体；
T 日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
基金收益：	即基金利润，指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指基金资产净值除以基金份额余额所得的基金份额的价值；
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；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，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、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

3. 基金的基本情况

- (一) 基金名称：南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）
- (二) 基金的类别：股票型证券投资基金
- (三) 基金的运作方式：上市契约型开放式
- (四) 上市交易所：深圳证券交易所
- (五) 标的指数：本基金的标的指数为 MSCI China Free SMID Index（MSCI 中国外资自由投资中小盘股票指数，简称中国中小盘指数）。
- (六) 基金投资目标：本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。
- (七) 基金份额初始面值和认购费用：基金份额初始面值是人民币 1.00 元；本基金认购费率不高于认购金额（含认购费）的 5%，实际执行费率在招募说明书中载明。
- (八) 基金最低募集份额总额：本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。
- (九) 基金存续期限：不定期

4. 基金份额的发售

（一）募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在招募说明书、基金份额发售公告中确定并披露。

（二）发售方式

本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。场外将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点发售，场内将通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位发售，具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

基金销售机构对认购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认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者人自行承担。

（三）发售对象

本基金的发售对象为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、机构投资者和合格境外机构投资者和和中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

（四）认购原则

- 1、场外认购采用“金额认购，份额确认”的方式；场内认购采用“份额认购，份额确认”的方式；
- 2、投资者认购基金份额时，须按销售机构规定的方式全额交付认购款项；
- 3、募集期内，投资者可多次认购基金份额，已被受理的认购申请不得撤销；
- 4、认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。

（五）认购费用以及基金认购份额的计算

投资者场外认购本基金时可以选择支付前端认购费用或后端认购费用；投资者场内认购时只能选择支付前端认购费用。本基金认购费率不高于认购金额（含认购费）的 5%，实际执行费率在招募说明书中载明。本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、客户服务等募集期间发生的各项费用。

基金认购份额具体的计算方法、规则在招募说明书中列示。认购份额、余额的处理方式详见招募说明书。

（六）认购数额限制

投资者认购本基金的单笔最低认购金额详见招募说明书、基金份额发售公告或其他公

告。

(七) 募集期间认购资金利息的处理方式

投资者有效认购款项在募集期间产生的利息归投资者所有，具体份额以注册登记机构的记录为准。

(八) 基金募集规模

本基金可根据中国证监会、国家外汇管理局核准的境外证券投资额度，对基金发售规模进行限制。具体规模限制可在招募说明书、基金份额发售公告等公告中规定。

基金合同生效后，基金的资产规模不受上述限制，但基金管理人有权根据基金的外汇额度等控制基金申购规模并暂停基金的申购。

(九) 募集期间的资金与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集期结束前，任何人不得动用。

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。

5. 基金备案

（一）基金备案的条件

自本基金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 亿元人民币，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人可以依据相关法律法规和招募说明书的规定决定停止基金发售并向中国证监会申请办理基金备案手续。

（二）基金的备案

基金募集期结束，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集结束之日起 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。

（三）基金合同的生效

自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕且基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

（四）基金合同不能生效时的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案条件的，基金合同不能生效。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、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。

（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本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 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现上述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

6. 基金份额的上市交易

（一）基金上市

1、上市交易的地点

深圳证券交易所。

2、上市交易的时间

本基金合同生效后三个月内基金管理人申请本基金在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登上市交易公告书。

3、基金上市条件

基金合同生效后具备下列条件，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）《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》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书。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书。

（二）基金份额的上市交易

本基金基金份额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》等有关规定。

（三）暂停上市交易

基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本章第（一）款规定的上市条件；
- 2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

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家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，并在至少一家指定媒体发布基金恢复上市公告。

（四）终止上市交易

基金份额上市交易后，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，并报中国证监会备案：

- 1、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。

基金管理人应当在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起 2 个工作日内发布基金终止上市公告。

（五）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，并在本基金更新的招募说明书中列示。

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

7. 基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购与赎回的场所

本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外代销机构的代销网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位，具体销售网点和会员单位的名单将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。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的其他方式办理基金的申购与赎回。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。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金申购和赎回的开放日为深圳和上海证券交易所及本基金投资的主要市场同时交易的交易日。本基金投资的主要市场详见《招募说明书》。投资者应当在开放日的开放时间（开放时间详见《招募说明书》的规定）办理申购和赎回申请。基金管理人可与销售机构约定，在开放日的其他时间或非开放日受理或者拒绝投资者的申购、赎回申请，届时以基金管理人或者销售机构的公告为准。如果本基金接受投资者在非开放时间或非开放日提出的申购、赎回申请的，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。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，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并公告。

2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与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、“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；

3、场外赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在场外销售机构赎回基金份额时，按照基金份额持有人场外认购、申购确认的先后次序进行顺序赎回；亦即对该基金份额持有人在该场外销售机构托管的基金份额进行处理时，认购、申购确认日期在前的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

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；

5、投资者通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的深圳开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的证券账户（人民币普通股票账户或证券投资基金账户）；

6、本基金的申购、赎回等业务，按照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行；

7、本基金申购、赎回的币种为人民币，基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回，并对业绩基准、信息披露等相关约定进行相应调整并公告；

8、基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质权益的情况下调整上述原则，但应依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2、申购与赎回申请的确认

投资者T日提交的申购、赎回申请，正常情况下，注册登记机构在T+2日内对该交易申请的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者应在T+3日后（包括该日）及时向销售网点或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对投资者申购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申请。申购申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。因申请不符合基金管理人、销售机构、注册登记机构的规定而不予确认而造成的损失，由投资者自行承担。投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整并公告。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若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，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请确认后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项。基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+10 日内将赎回款项划往基金份额持有人账户；如基金投资所处的主要市场或外汇市场正常或非正常停市时，赎

回款项支付的时间将相应调整；如遇不可抗力，基金管理人适当延迟通过注册登记机构及其相关基金销售机构将赎回款项划往基金份额持有人账户的时间。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同、招募说明书的有关规定处理。

4、基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质权益的情况下调整上述程序，但应依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

（五）申购与赎回的数额限制

1、基金管理人可以规定投资者首次申购最低金额和追加申购的最低金额，具体规定详见招募说明书等相关公告。

2、基金管理人可以规定基金份额持有人每次申请赎回的最低份额，具体规定详见招募说明书等相关公告。

3、基金管理人可以规定基金份额持有人每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定详见招募说明书等相关公告。

4、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限，具体规定详见招募说明书等相关公告。

5、基金管理人可事先设定基金规模，当本基金规模超过事先设定的规模时，基金管理人有权暂停申购，具体规定详见招募说明书等相关公告。

6、基金管理人在不损害基金份额持有人实质权益的情况下可以根据市场情况对以上限制进行调整，应依照《信息披露办法》的有关规定最迟于调整前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

（六）申购和赎回的费用及其用途

1、申购费用

本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、客户服务等各项费用。

本基金申购费率最高不超过 5%，具体收费方式详见招募说明书等相关公告。

2、赎回费用

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金赎回费率最高不超过赎回总金额的 5%。赎回费在扣除手续费后，余额不低于赎回费总额 25% 的部分，应当归入基金财产。具体费率详见招募说明书等相关公告。

3、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率等。费率如发生变更，基金管理人应最迟于实施前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式等进

行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（七）申购份额、赎回金额的计算方式

1、本基金申购份额的计算：

投资者场外申购时本基金可以选择支付前端申购费用或后端申购费用；投资者场内申购本基金时只能选择支付前端申购费用。基金申购份额、余额的具体计算方法及其处理方式在《招募说明书》中列示。

2、本基金赎回金额的计算：

本基金采用“份额赎回”方式，赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。如果基金投资者在申购时选择支付后端申购费用，则赎回时还须支付相应的申购费用。基金赎回金额的具体计算方法及其处理方式在《招募说明书》中列示。

3、基金份额净值的计算：

基金份额净值应当在估值日后2个工作日内披露。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。

4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，具体计算方法及其处理方式在《招募说明书》中列示。

5、赎回金额的处理方式：

赎回金额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（八）申购与赎回的注册登记

1、投资者 T 日场外申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日内为投资者增加权益并办理注册登记手续，自 T+3 日起的赎回开放日内有权赎回该部分基金份额。

2、投资者场外 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日内为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并应依照《信息披露办法》于实施前2日在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回（赎回申请总数与基金转换申请转出份额总数之和扣除申购申请总数及基金转换申请转入份额总数的余额）申请超过上一开放日基金总份额的 10%时，为

巨额赎回。

2、巨额赎回的场外处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定对场外赎回申请接受全额赎回或部分延期赎回。

(1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请予以延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；当日赎回申请中未被受理部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销外，自动延迟至下一开放日办理。依照上述规定转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将按下一个开放日赎回申请总量确定赎回份额及以下一个开放日的基金份额净值为准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

开放式基金发生巨额赎回并延期办理的，基金管理人应当在 3 个工作日内通过邮寄、传真、或者招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

本基金连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延期期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

3、巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回业务的场内处理，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

(1) 因不可抗力或其他不可控制因素，导致基金无法正常运作；

(2) 本基金投资所处的主要市场或外汇市场正常或非正常停市，可能影响本基金投资，或导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；

(4) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、深圳证券交易所或注册登记机构因技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、登记结算系统或基金会计系统无法正常运行；

- (5) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (6) 基金资产规模达到基金管理人规定的上限（基金管理人可根据中国证监会、国家外汇管理局的核准的境外投资额度及市场情况进行调整）；
- (7) 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的利益的情形；
- (8) 因基金收益分配或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；
- (9) 个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害；
- (10) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时应及时公告、通知。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告、通知。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- (1) 因不可抗力或其他不可控制因素，导致基金无法支付赎回款项；
- (2) 本基金投资所处的主要市场或外汇市场正常或非正常停市，可能影响本基金投资，或导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- (4) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构、深圳证券交易所或注册登记机构因技术保障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、登记结算系统或基金会计系统无法正常运行；
- (5) 基金发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- (6) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时而基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项的，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赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回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，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并应在指定媒体上公告。投资者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及时公告。

3、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资者的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(十一) 重新开放申购或赎回的公告

基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

(十二) 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，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。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。

8. 基金的转托管、非交易过户、冻结与质押

（一）基金份额的登记

1、基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购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算系统基金份额持有人证券账户下。

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，也可以通过具有代销资格的会员单位申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的基金份额可以申请场外赎回。

（二）系统内转托管

1、系统内转托管是指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。

2、本基金系统内转托管按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。处于募集期内的基金份额不能办理系统内转托管。

（三）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指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。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。处于募集期内的基金份额和场外采用后端收费模式认购/申购的基金份额不能办理跨系统转登记。

（四）注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻、质押等业务，并收取一定的手续费用。

9. 基金合同当事人及其权利义务

（一）基金管理人

1、基金管理人基本情况

名称：南方基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

成立时间：1998 年 3 月 6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基字[1998]4 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.5 亿元

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运作基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费（或称基金管理人的管理费、管理费），收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- （5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- （6）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同的规定，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- （7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构，并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- （8）自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，获得有关费用，办理基金注册登记业务，并按照基金合同的规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查；
- （9）在基金合同约定的范围内，增加或减少交易模式；

- (10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- (11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- (12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- (13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- (14) 以基金管理人的名义，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；
- (15) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (16) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- (18) 选择、聘请、更换或撤销境外投资顾问；
- (19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；
- (20) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 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；
- (3) 办理基金备案手续；
- (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基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 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；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；
- (12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

- (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以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 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；
- (17) 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；
- (18) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (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) 如委托境外投资顾问，境外投资顾问应符合法律法规规定的有关条件，在挑选、委托境外投资顾问过程中，基金管理人应承担受信责任，履行尽职调查义务；
- (21) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当采取适当措施监督第三方处理有关基金事务的行为进行监督；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
- (22) 基金进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；
- (23) 确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具，严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法规有关投资范围和比例限制的规定；
- (24) 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；
- (25) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；
- (26) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(二) 基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码：100031

法定代表人：项俊波

成立时间：2009 年 1 月 15 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

组织形式：股份有限公司

注册资金：2700 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 选择、更换或撤销境外资产托管人；
- (3) 依照基金合同的约定获得基金托管费（或称基金托管人的托管费、托管费）以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (4) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如基金托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定，不予执行并向中国证监会报告；
- (5) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (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) 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和独立；
- (6) 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；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人、境外投资顾问的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 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以保密，不得向他人泄露；
- (10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (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) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关法律法规的规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照规定监督基金管理人的投资运作，保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、国家外汇局报告；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其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) 当基金托管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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金托管人首先承担了责任的情况下，基金托管人有权向第三方追偿；
- (21) 安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人和在经基金管理人授权的市场通知境外投资顾问，确保基金及时收取所有应得收入；
- (22) 依据法律法规的有关规定，在每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和国家外汇局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；
- (23) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
- (24) 保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；
- (25) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构和国家外汇局规定的其他职责。

(三) 基金份额持有人

1、基金投资者购买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。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 遵守法律法规及基金合同；

(2) 遵守基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构关于基金业务的相关规则及规定；

(3) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

(7) 执行基金份额持有人大会的决议；

(8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

10. 基金份额持有人大会

（一）召开原则

基金份额持有人大会由基金份额持有人，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的表决权。

持有人大会决议须经基金份额持有人大会审议通过。基金份额持有人大会通过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。

（二）召开事由

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、更换基金托管人、基金管理人；
- 4、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；
- 5、本基金与其他基金的合并；
- 6、变更基金类别；
- 7、变更基金投资目标、范围或策略；
- 8、变更基金份额持有人大会程序；
- 9、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 10、单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%）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）书面要求召开基金份额持有人大会；
- 11、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）以下情况无须召开基金份额持有人大会

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2、法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- 4、经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- 5、基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 6、在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；
- 7、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 8、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；
- 9、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

10、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式

1、基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

3、代表基金份额 10%以上（含 10%）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（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定媒体上公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、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；
- 6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、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、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容；

7、召集人认为需要通知的其他事项。

如召集人为基金管理人，则应另行书面通知基金托管人；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人；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。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会和法律法规和监管机关允许的其他方式。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

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：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

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，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人按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；

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代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4、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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

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

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的

事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交须由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

① 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。

② 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，须征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 代表基金份额 10% 以上（含 10%）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，或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，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报中国证监会核准或备案；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

(八) 表决

1、基金份额持有人所持每份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) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

(2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过。除上列第（1）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。

- 3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
- 4、采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。
- 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。

（九）计票

1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人在出席会议的基金份额持有人中指定）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中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果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者基金份额持有人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。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举 3 名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监票员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

（十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。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、关于基金合同变更、更换基金管理人、基金托管人等项目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。

3、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、基金托管人均有法律约束力。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的决定。

4、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或备案后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

11. 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

(一) 基金管理人和基金托管人的更换条件

1、有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

- (1) 基金管理人被依法取消基金管理资格；
- (2) 基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规规定的其他情形。

2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

- (1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规规定的其他情形。

(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会须在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或由代表 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金管理人职责终止的，基金份额持有人大会应当在 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，该决议须经基金份额持有人大会 2/3 以上表决权通过方为有效。

(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(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，新任基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人或者临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

(5) 审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(6) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的字样。

2、基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会须在 6 个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由代表 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金托管人职责终止的，基金份额持有人大会应当在 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，该决议须经基金份额持有人大会 2/3 以上表决权通过方为有效。

(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在至少一种指定媒体上予以公告。

(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，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(5) 审计并公告：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，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

3、基金管理人和基金托管人的更换程序

(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份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

(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应当依照有关规定予以公告并报中国证监会备案。

12. 基金托管

本基金财产由基金托管人依法持有并保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）托管协议》，以明确基金管理人与基金托管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。

对本基金的境外财产，基金托管人可授权境外资产托管人代为履行其承担的职责，并对境外资产托管人处理有关本基金事务的行为承担相应责任。境外资产托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任。

13. 基金的销售

（一）本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理本基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资和客户服务等业务。

（二）本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构以及符合条件的深圳证券交易所会员单位办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回等业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。

基金管理人及代销机构等相关机构，应友好协商、积极配合，支持和鼓励基金销售模式的不断改进和交易手段等不断完善。

14. 基金份额的注册登记

(一) 本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括但不限于投资者基金账户管理、基金份额注册登记、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。

(二) 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

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。

基金管理人、基金托管人、代销机构和其他相关服务机构，应与注册登记机构一道，友好协商、互相配合，采取必要的措施，保证注册登记业务的顺利进行及其合理改进，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

(三) 注册登记机构享有如下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 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，对注册登记业务的办理时间进行调整；
- 4、法律法规规定的其他权利。

(四) 注册登记机构承担如下义务：

- 1、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；
- 2、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 4、接受基金管理人的监督（基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的）；
- 5、保管基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 6、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，但按照法律法规的规定进行披露的情形除外；
- 7、按本基金合同及招募说明书、有关公告的规定，为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 8、法律法规规定的其他职责。

15. 基金的投资

（一）投资目标

本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。

（二）投资理念

本基金通过被动式指数化投资以实现香港中小盘股票指数的有效跟踪，为投资者提供一个分享香港中小盘股票长期增长的投资工具。

（三）投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、新股（一级市场首次发行或增发），其中标的指数成份股及备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的85%，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%。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证、ETF基金、权证、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

（四）投资策略

本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%。

1、股票投资组合的构建

本基金将根据标的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。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

2、股票投资组合的调整

1) 定期调整

本基金将依照标的指数的定期调整规则，对股票组合进行相应的调整。

2) 不定期调整

A、当成份股发生并购、股份回购、增发、送配、拆股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

B、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；

C、若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

构造替代性组合的方法如下：

A、按照与被替代股票所属行业及基本面相似的原则，选取替代股票备选库。本基金投资采用与标的指数相同或类似的行业分类标准；

B、采用备选库中各股票过去较长一段时间的历史数据，分析其与被替代股票的相关性；

C、选取备选库中与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以模拟组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中各股票的权重。

我们认为，据此得到的优化组合能较好的代表被替代股票的收益率波动情况。为了实现更好的跟踪标的指数的目的，基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本，以及税务及其他监管限制，决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体公告，并阐明变更复制方法的原因。

3、债券和货币市场工具的配置策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

4、金融衍生产品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、期权、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。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。

（五）投资决策依据和流程

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

基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制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；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。基金管理人有权根据基金运作情况选择、更换或撤销境外投资顾问，为本基金境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务。

3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合维护等流程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：金融工程小组依托基金管理人整体研究平台，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、股指期货跟踪有效性等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

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

(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以复制标的指数成份股的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，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：金融工程小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此调整投资组合。

(6) 组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，紧密跟踪标的指数。

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体制和程序做出调整，并在更新的《招募说明书》中列示。

(六) 标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为 MSCI China Free SMID Index (MSCI 中国自由投资中小盘股票指数，简称中国中小盘指数)。中国中小盘指数的详情见招募说明书。

本基金业绩比较基准：人民币计价的中国中小盘指数净收益率（税后）。

如果中国中小盘指数被停止编制及发布，或中国中小盘指数编制者或所有者停止对本基金的指数使用授权，或中国中小盘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中国中小盘指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有其他代表性更强、更合适作为投资的指数作为本基金的标的指数，或有更能代表本基金风险收益特征的业绩比较基准，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更换本基金的标的指数和/或业绩比较基准。基金管理人将依据市场代表性、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和/或业绩比较基准。本基金由于上述原因变更标的指数和/或业绩比较基准，基金管理人应履行适当程序，报中国证监会核准或备案后予以公告。

（七）风险收益特征

本基金主要投资标的指数成份股，具有与标的指数和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。由于中小盘股票的特点，一般情况下投资中小盘股票面临的波动要高于投资大盘股票。

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）购买不动产；
- （2）购买房地产抵押按揭；
- （3）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （4）购买实物商品；
- （5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%；
- （6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （7）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （8）从事证券承销业务；
- （9）向基金管理人、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债券；
- （10）向他人贷款或提供担保；
- （11）从事承担无限责任的投资；
- （12）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；
- （13）直接投资与实物商品相关的衍生品；
- （14）中国证监会禁止的其他行为。

除非法律法规和监管部门禁止，本基金可以投资境外托管人发行的金融产品。

如法律法规或监管部门取消上述限制，在可适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

2、基金投资组合比例限制

(1) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

(2) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

(3) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

(4) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

(5) 本基金管理人所管理的全部基金持有任何一只境外基金，不超过该境外基金总份额的 20%。

(6) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

(7) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

(8) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

(9) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。

一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

A、 现金；

B、 存款证明；

C、商业票据；

D、政府债券；

E、中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(10) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(11) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(12) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

如果法律法规或监管机构变更或取消上述限制，本基金将相应变更或取消上述规定，不需经基金份额持有人大会审议。

3、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。若本基金投资超过基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施进行调整以符合基金合同规定的投资比例要求，法律法规另有规定的依其规定执行。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个工作日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人

同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从 30 个工作日延长到 3 个月。

法律法规另有规定的除外。

（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

- 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；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、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；
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（十）基金的融资政策

本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定进行融资。

（十一）基金的融券政策

本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定进行融券。

（十二）未来条件许可情况下的基金模式转换

若将来条件许可，基金管理人将根据情况决定是否将其转型为交易型开放式指数基金（ETF）联接基金。

若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人与基金托管人协商一致后，根据届时有效的法律法规的规定，在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改《基金合同》，但应在实施前报中国证监会核准或备案并提前公告。

16. 基金的财产

（一）基金资产总值

本基金基金资产总值指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金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

本基金根据相关法律法规、规范性文件在境内开立人民币和外币资金账户，在境外投资市场根据适用的法律法规、监管要求、行业惯例及托管业务需要以本基金名义或托管人名义开立外币资金账户及证券账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人和境外资产托管人、境外投资顾问、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、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，归基金财产。

3、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范围。

4、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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、基金管理人和基金托管人可将其义务委托第三方，并对第三方处理有关本基金事务的行为承担责任。

17. 基金资产估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

（二）估值日

本基金的估值日为本基金的开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日。

（三）估值对象

基金依法所持有的金融资产和金融负债。

（四）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。

1) 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在证券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。

2) 首次发行的股票，按成本价估值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、固定收益证券估值方法

（1）债券按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。如果不存在交易所交易价格，则根据行业通用权威报价系统的报价进行估值。

（2）未上市债券按其成本价估值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)–(2)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人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。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、衍生品估值方法

(1) 上市流通衍生品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) 未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

4、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

5、基金估值方法

(1) 上市流通的基金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) 其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通或流通受限或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，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。

7、在两个或者两个以上的交易场所交易的同一证券，一般采用该证券主要交易市场的收盘价或报价；根据不同交易市场的发行量之比确定该证券的主要交易市场。个别市场有特殊交易结算规则的，根据该市场规则处理。

8、汇率

人民币对主要外汇的汇率应当以估值日中国人民银行或其认可机构公布的人民币汇率中间价为准。涉及其他货币对人民币的汇率，采用美元作为中间货币进行换算。

9、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

10、为股票、固定收益证券、外汇等基金资产估值需要，经过基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可以利用及依据基金管理人届时确定的一种或多种来源的数据信息。

11、在任何情况下，基金管理人如采用本款第1—10项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本款第1—10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；

12、法律法规或监管部门有最新规定的，按其规定进行估值。

(五) 估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元人民币，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每估值日的下一个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

2、基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，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。

3、在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任，同时，须按照有关规定在基金定期报告中披露。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资的主要证券交易所或市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因自然灾害等不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，延迟估值有利于基金份额持有利益的保护；

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无法评估基金资产的；

5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（七）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 4 位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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。当基金估值出现影响基金份额净值的错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；其中基金份额净值计算差错小于基金份额净值 0.5% 时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值 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。

如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代理销售机构或投资者自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

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无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成投资者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。

3、差错处理原则

因基金估值错误给投资者造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规及托管协议的规定予以承担。基金合同的当事人应按照以下约定的原则处理基金估值差错。

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成的损失由差错责任方承担；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，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方根据各自的差错程度分别各自承担相应的赔偿责任。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。

(2) 差错的责任方仅对可能导致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。

(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，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。

(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。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因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，如果因基金托管人原因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。除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。

(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、托管协议或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现差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损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
- (5) 当基金估值出现影响基金份额净值的错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(九) 特殊情形的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按本条第(四)款估值方法规定的第 11 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及有关登记结算机构、数据服务机构发送的数据错误，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可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

18. 基金费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 4、基金上市费及年费；
- 5、基金的指数使用费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金银行汇划费用；
- 9、基金的证券交易费用、所投资基金的交易费用和管理费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；
- 10、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 11、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税；
- 12、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- 13、更换基金管理人，更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移新托管人所引起的费用，但因基金管理人或基金托管人自身原因导致被更换的情形除外；
- 14、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律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

本基金的管理费自基金合同生效日（含基金合同生效日）按基金资产净值的 1%年费率计提，即本基金的年管理费率为 1%。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

本基金的管理费每日计提，逐日累计。对于已确认的管理费，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支付给基金管理人。

本基金的管理费的具体使用由基金管理人支配；如果委托境外投资顾问，基金的管理费可以部分作为境外投资顾问的费用，具体支付由基金管理人与境外投资顾问在有关协议中进

行约定。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费自基金合同生效日（含基金合同生效日）按基金资产净值的 0.3% 年费率计提，即本基金的年托管费率为 0.3%。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 为前一日的基金资产净值

本基金的托管费每日计提，逐日累计。对于已确认的托管费，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支取。

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外资产托管人，其中可以部分作境外资产托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外资产托管人在有关协议中进行约定。

3、本条第（一）款第 3 至第 14 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，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。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支，其他具体不得列入基金费用的项目依据相关法律法规执行。

（五）基金管理费、基金托管费等基金费用的调整

基金管理人和基金托管人等可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率、基金托管费率等相关费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非获得监管机构的豁免、基金合同或相关法律法规另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率，无须召开基金份额持有人大会。

若将来法律法规或监管机构许可本基金或本类型的基金采取持续性销售服务费模式，则本基金可以依法引入持续性销售服务费收费模式；若引入该类收费模式没有增加现有基金份额持有人的费用负担，则无须召开基金份额持有人大会，法律法规或监管机构另有规定的除外。

基金管理人依照《信息披露办法》在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告，并报中国证监会备案。

（六）税收

基金和基金合同各方当事人根据国家法律法规和有关境外投资市场的规定，履行纳税义务。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予

意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

除因基金管理人和基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

19. 基金收益与分配

（一）基金收益的构成

本基金合同项下基金收益是指基金利润。基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金合同生效当年不满3个月，可不进行收益分配；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多不超过12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；

5、基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体公告。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、

分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

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。

（六）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。红利再投资的计算方法，依照注册登记机构相关业务规则执行。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构可以自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

20. 基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、按国家有关的会计核算制度执行，并在法律法规允许的范围内参考国际会计准则。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人，基金管理人也可以委托具有从事证券相关业务资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务。
- 6、基金管理人和基金托管人应各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规的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。
- 8、基金管理人依据法律法规规定在会计年度结束后 60 个工作日内向证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

（二）基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人及境外资产托管人相独立的、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等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 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；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，应通报基金托管人并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 日内公告。

21. 基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《试行办法》、《运作管理办法》、《信息披露管理办法》及其实施准则、本基金合同及其他有关规定办理。

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，并保证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。

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：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 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；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金可以人民币、美元等主要外汇币种计算并披露净值及相关信息。涉及币种之间转换的，应当披露汇率数据来源，并保持一致性。如果出现改变，应当予以披露并说明改变的理由。人民币对主要外汇的即期汇率应当以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币即期汇率中间价为准。

本基金除特别说明外，货币单位为人民币元。

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当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。

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当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。

（四）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

（五）上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将上市交易公告书登载在至少一家指定媒体和基金管理人网站上。

（六）基金资产净值、基金份额净值公告

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基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的 2 个工作日内，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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个工作日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述工作日的 2 个工作日内，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中国证监会指定媒体上。

（七）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应在基金合同、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复制前述信息资料。

（八）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

1、基金年度报告：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报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：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、基金季度报告：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。

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。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和书面报告两种方式。

（九）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 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、境外资产托管人，选择、更换或撤销境外投资顾问；
- 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、对基金投资可能产生重大影响的境外投资顾问主要负责人员发生变更；
- 12、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 13、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 14、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；
- 15、重大关联交易事项；
- 16、基金收益分配事项；
- 17、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 18、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 19、基金改聘会计师事务所；
- 20、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 21、基金更换基金注册登记机构；
- 22、基金开始办理申购、赎回；
- 23、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 24、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 25、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 26、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

(十) 基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应履行相关信息披露义务。

(十一) 公开澄清

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。

(十二) 中国证监会规定的其他信息

(十三) 本基金在条件成熟的情况下，为方便投资者交易本基金，可增加信息披露的范围。

(十四) 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

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，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

22. 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、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）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；

- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）本基金与其他基金的合并；
- （6）变更基金类别；
- （7）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （8）变更基金份额持有人大会程序；
- （9）基金合同等约定的其他事项。

2、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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改，报中国证监会备案后公告。上述情形包括但不限于：

- （1）调低基金管理费率、基金托管费率；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- （4）经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- （5）基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- （6）在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；
- （7）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （8）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；
- （9）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （10）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金合同经基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- 4、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- 5、法律法规规定或中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

- 1、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。
- 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

3、清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对基金财产清算报告进行外部审计；
- （7）聘请律师事务所对基金财产清算报告出具法律意见书；
- （8）将基金清算结果报告中国证监会；
- （9）公布基金清算公告；
- （10）对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

5、基金财产的分配

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）、（2）、（3）小项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由清算组公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

23. 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》、《试行办法》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等。

4.在基金运作过程中,基金管理人及基金托管人按照《基金法》和《试行办法》的规定以及本基金合同的约定履行了相关职责,但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(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。

(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。

(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者损失,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。

24. 争议的处理

(一) 本基金合同受中国法律管辖。

(二) 本基金合同的当事人之间对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

(三) 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。

25. 基金合同的效力

（一）本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件。基金合同在基金募集结束，报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

（二）本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（三）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。

（四）本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。

（五）基金合同可印制成册，供投资者查阅；投资者也可复印本基金合同等法律文件，但若有歧义，则应以本基金合同等法律文件的正本为准。

26. 业务规则

基金份额持有人应遵守基金管理人或注册登记机构等相关机构制定的相关业务规则及其更新的各项业务规则。

在法律法规规定的范围内，基金管理人或注册登记机构等相关机构可以根据实际情况制订、解释与修改相关业务规则，必要时须报监管机关备案。

27. 其他事项

（一）在基金存续期间，基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也可能会相应地做出调整，但不得影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

（二）本基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方通过监管机构规定的程序依据有关法律法规和规定协商处理。

28. 基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一) 基金份额持有人的权利与义务

1、基金投资者购买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。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

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

3、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守法律法规及基金合同；
- (2) 遵守基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构关于基金业务的相关规则及规定；
- (3) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (4) 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；
- (5) 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；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (7) 执行基金份额持有人大会的决议；

(8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

1、基金管理人基本情况

名称：南方基金管理有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层

法定代表人：吴万善

成立时间：1998 年 3 月 6 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基字[1998]4 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.5 亿元

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运作基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费（或称基金管理人的管理费、管理费），收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同的规定，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构，并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- (8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记机构，获得有关费用，办理基金注册登记业务，并按照基金合同的规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查；
- (9) 在基金合同约定的范围内，增加或减少交易模式；
- (10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

- (11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；
- (12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- (13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- (14) 以基金管理人的名义，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；
- (15) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- (16) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- (18) 选择、聘请、更换或撤销境外投资顾问；
- (19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；
- (20) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 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；
- (3) 办理基金备案手续；
- (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基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；
- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 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；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；
- (12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (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以保密，不得向他人泄露；

(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16) 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；

(17) 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；

(18) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(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) 如委托境外投资顾问，境外投资顾问应符合法律法规规定的有关条件，在挑选、委托境外投资顾问过程中，基金管理人应承担受信责任，履行尽职调查义务；

(21) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当采取适当措施监督第三方处理有关基金事务的行为进行监督；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(22) 基金进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

(23) 确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具，严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法规有关投资范围和比例限制的规定；

(24) 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；

(25) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(26) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码：100031

法定代表人：项俊波

成立时间：2009 年 1 月 15 日

组织形式：股份有限公司

注册资金：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

2、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 选择、更换或撤销境外资产托管人；
- (3) 依照基金合同的约定获得基金托管费（或称基金托管人的托管费、托管费）以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- (4) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如基金托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定，不予执行并向中国证监会报告；
- (5) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (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) 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和独立；
- (6) 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；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人、境外投资顾问的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 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以保密，不得向他人泄露；
- (10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (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) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 依据基金管理人的指令或有关法律法规的规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 按照规定监督基金管理人的投资运作，保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、国家外汇局报告；

(18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其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) 当基金托管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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金托管人首先承担了责任的情况下，基金托管人有权向第三方追偿；

(21) 安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人和在经基金管理人授权的市场通知境外投资顾问，确保基金及时收取所有应得收入；

(22) 依据法律法规的有关规定，在每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和国家外汇局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

(23) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

(24) 保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(25) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构和国家外汇局规定的其他职责。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 召开原则

基金份额持有人大会由基金份额持有人，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的表决权。

持有人大会决议须经基金份额持有人大会审议通过。基金份额持有人大会通过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。

(二) 召开事由

1、终止基金合同；

2、转换基金运作方式；

3、更换基金托管人、基金管理人；

4、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；

- 5、本基金与其他基金的合并；
- 6、变更基金类别；
- 7、变更基金投资目标、范围或策略；
- 8、变更基金份额持有人大会程序；
- 9、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 10、单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%）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）书面要求召开基金份额持有人大会；
- 11、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）以下情况无须召开基金份额持有人大会

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2、法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- 4、经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- 5、基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 6、在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；
- 7、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 8、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；
- 9、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 10、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式

1、基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

3、代表基金份额 10%以上（含 10%）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（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

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。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定媒体上公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、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；
- 6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、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、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容；
- 7、召集人认为需要通知的其他事项。

如召集人为基金管理人，则应另行书面通知基金托管人；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人；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。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会和法律法规和监管机关允许的其他方式。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

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：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

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，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2、召集人按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；
- 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代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4、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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

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

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交须由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

① 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。

② 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，须征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）代表基金份额 10%以上（含 10%）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，或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，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报中国证监会核准或备案；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

(八) 表决

1、基金份额持有人所持每份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) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

(2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过。除上列第（1）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。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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。

(九) 计票

1、现场开会

(1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人在出席会议的基金份额持有人中指定）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中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

结果。

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果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者基金份额持有人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。

(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下,如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的,则参加会议的基金份额持有人有权推举 3 名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式可采取如下方式:

由大会召集人授权的两名监票员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的,不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人,由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

(十) 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项,召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。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、关于基金合同变更、更换基金管理人、基金托管人等项目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。

3、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、基金托管人均有法律约束力。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的决定。

4、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或备案后 2 日内,由基金份额持有人大会召集人在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权;

2、基金合同生效当年不满 3 个月,可不进行收益分配;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即:基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值,基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日;

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多不超过 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；

5、基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体公告。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

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。

（四）基金收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。红利再投资的计算方法，依照注册登记机构相关业务规则执行。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构可以自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

四、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金的管理费

本基金的管理费自基金合同生效日（含基金合同生效日）按基金资产净值的 1% 年费率

计提，即本基金的年管理费率为 1%。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

本基金的管理费每日计提，逐日累计。对于已确认的管理费，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支付给基金管理人。

本基金的管理费的具体使用由基金管理人支配；如果委托境外投资顾问，基金的管理费可以部分作为境外投资顾问的费用，具体支付由基金管理人与境外投资顾问在有关协议中进行约定。

（二）基金的托管费

本基金的托管费自基金合同生效日（含基金合同生效日）按基金资产净值的 0.3% 年费率计提，即本基金的年托管费率为 0.3%。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 为前一日的基金资产净值

本基金的托管费每日计提，逐日累计。对于已确认的托管费，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支取。

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外资产托管人，其中可以部分作境外资产托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外资产托管人在有关协议中进行约定。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金采用被动式指数化投资，以实现对标的指数的有效跟踪。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、新股（一级市场首次发行或增发），其中标的指数成份股及备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%，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%。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证、ETF 基金、权证、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可

以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

（三）投资限制

（1）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

（2）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

（3）本基金持有非流动性资产市值不得超出基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

（4）本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

（5）本基金管理人所管理的全部基金持有任何一只境外基金，不超过该境外基金总份额的 20%。

（6）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

（7）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

（8）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

（9）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

A、 现金；

B、存款证明；

C、商业票据；

D、政府债券；

E、中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(10) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(11) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(12) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

如果法律法规或监管机构变更或取消上述限制，本基金将相应变更或取消上述规定，不需经基金份额持有人大会审议。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《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，基金管理人应当每个估值日后 2 个工作日内通过

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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后1个工作日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的2个工作日内，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媒体。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）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；

- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）本基金与其他基金的合并；
- （6）变更基金类别；
- （7）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （8）变更基金份额持有人大会程序；
- （9）基金合同等约定的其他事项。

2、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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改，报中国证监会备案后公告。上述情形包括但不限于：

- （1）调低基金管理费率、基金托管费率；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- （4）经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- （5）基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- （6）在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；
- （7）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （8）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；

- (9) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (10) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(二) 《基金合同》的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金合同经基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- 4、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- 5、法律法规规定或中国证监会规定的其他情况。

(三) 基金财产的清算

- 1、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。
- 2、基金财产清算组

(1) 自基金合同终止事由发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

3、清算程序

- (1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对基金财产清算报告进行外部审计；
- (7) 聘请律师事务所对基金财产清算报告出具法律意见书；
- (8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金清算公告；
- (10) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

5、基金财产的分配

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）、（2）、（3）小项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由清算组公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

（一）本基金合同受中国法律管辖。

（二）本基金合同的当事人之间对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

（三）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。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本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。

基金合同可印制成册，供投资者查阅；投资者也可复印本基金合同等法律文件，但若有歧义，则应以本基金合同等法律文件的正本为准。

29. 基金管理人和基金托管人签章

（本页无正文，为南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）基金合同盖章页）

基金管理人：南方基金管理有限公司（法人盖章）

法定代表人或授权代表（签字）：

基金托管人：中国农业银行股份有限公司（法人盖章）

法定代表人或授权代表（签字）：

签订地：北京

签订日： 年 月 日