(上接D11版)

(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。

如果开会条件达不到上述的条件，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），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

7、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、代表基金份额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出临时提案，临时提案应当在大会召开日至少35日前提交召集人，并由召集人公告。

3)对于基金管理人、基金托管人或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：

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

b、程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)代表基金份额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，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，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员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。

8、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三分之二以上（含三分之二）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%以上通过。

(3)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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。

(4)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。

9、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，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三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

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；如果出席大会的基金份额持有人或其代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，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；重新清点后，大会持有人应当当场公布重新清点结果。

(2)通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：

由大会召集人指定的两名计票员在监督人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

10、生效与公告

(1)基金份额持有人大会按照《基金法》等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)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。

(3)基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后2日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

(4)如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面的联系

鉴于本基金是目标ETF的联接基金，本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系。

本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标ETF的份额持有人大会并参与表决。计算参会份额和计票时，本基金参会份额数和票数按权益登记日本基金所持有的目标ETF份额占联接基金总份额的比例折算，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF份额持有人大会。

12、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。

(三)基金收益分配原则、执行方式

1、基金收益的构成

本合同项下基金收益指基金利润，即基金利息收入、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。

2、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资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、收益分配原则

(1)每一基金份额享有同等分配权；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；

(3)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

(4)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；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、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。

5、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6、基金收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

(四)与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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)因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

(4)基金合同生效以后的信息披露费用；

(5)基金份额持有人大会费用；

(6)基金合同生效以后的会计师费和律师费；

(7)基金资产的资金汇划费用及开户费用；

(8)按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

由于本基金管理人和托管人同时为华泰柏瑞上证中小盘ETF的管理人与托管人，为避免重复收费，本基金管理人、托管人对本基金财产投资于华泰柏瑞上证中小盘ETF部分不收取管理费、托管费。本基金制定了以下的收费标准。

(1)基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按调整后的前一日基金资产净值的0.50%年费率计提，管理费的计算方法如下：

H=E×0.50%÷当年天数

H为每日应计提的管理费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值=前一日基金资产净值－本基金持有的华泰柏瑞上证中小盘ETF前一日公允价值，金额为负时以零计。

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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的基金托管费

在通常情况下，本基金的托管费按调整后的前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值=前一日基金资产净值－本基金持有的华泰柏瑞上证中小盘ETF前一日公允价值，金额为负时以零计。

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，基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3)本条第1款"基金费用的种类"第(3)至第(8)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，从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

5、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

(五)基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

2、投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括华泰柏瑞上证中小盘ETF、上证中小盘指数成份股及备选成份股、非成份股、债券、新股（一级市场初次发行和增发）、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

正常情况下，本基金资产中投资于华泰柏瑞上证中小盘ETF的比例不低于基金资产净值的90%；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%；股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

3、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)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)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；

5)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；

6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7)依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(2)基金投资组合比例限制

1)基金资产中投资于华泰柏瑞上证中小盘ETF的比例不低于基金资产净值的90%；

2)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

3)在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、目标ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标ETF总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

4)法律法规和基金合同规定的其他限制。

本基金是华泰柏瑞上证中小盘ETF的联接基金，与华泰柏瑞上证中小盘ETF一样，可不受《运作办法》第三十一条的下列限制：①一只基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；②同一基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%。

(3)若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(4)基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

(六)基金资产净值的计算方法和公告方式

1、估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

2、估值日

本基金合同生效后，每个工作日对基金财产进行估值。

3、估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

4、估值方法

(1)股票估值方法

1)上市流通股票的估值

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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2)未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

3)有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(2)固定收益证券的估值办法

1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

3)未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

4)在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

6)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(3)权证估值：

1)配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

2)认沽认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4)本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

(5)本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

(6)目标ETF按估值日该基金份额净值估值；若估值日非证券交易所的工作日，以该基金最近工作日的基金份额净值估值。

(7)其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

(8)在任何情况下，基金管理人采用上述1－7项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可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的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(9)国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

5、估值程序

基金日常估值由基金管理人同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。

6、暂停估值的情形

(1)基金投资所涉及的证券交易所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)中国证监会认定的其他情形。

7、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到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。

8、估值错误的处理

(1)当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

(2)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财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

(3)前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

9、特殊情形的处理

(1)基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第8项条款进行估值时，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，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，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

10、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次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。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。

(七)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、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)基金份额持有人大会决定终止；

(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、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

(4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

2、基金财产的清算

(1)基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组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)基金合同终止情形发生后，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清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

7)将清算报告报中国证监会备案并公告；

8)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)基金剩余财产的分配

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)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于由基金交纳、中登公司收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在中登公司对其进行调整交收日才能收回。

(6)基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

(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

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间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解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

(九)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

二十 基金托管协议的内容摘要

A、托管协议当事人

1、基金管理人（或简称"管理人"）

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层（200135）

法定代表人：齐亮

成立时间：2004年11月18日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

2、基金托管人（或简称"托管人"）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

B、基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

(一)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2、对基金投融资比例进行监督；

3、对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

7、对法律法规规定及《基金合同》约定的基金投资的其他方面进行监督。

(二)基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

(三)基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(四)基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照相关规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照相关规定及时向中国证监会报告。

(五)基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(六)基金管理人对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

C、基金财产的保管

(一)基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人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。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(二)基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

(三)基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

(四)基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

(五)基金证券账户和资金账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

(六)债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

(七)基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

(八)与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少15年。

D、基金资产净值计算与复核

(一)基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。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，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，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、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，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、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，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。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

(二)基金会计核算

1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后45日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于会计年度半年终了后60日内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后90日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，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。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应3个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后10个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后15个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

E、基金份额持有人名册的登记与保管

(一)基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；

2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；

3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；

4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

(二)基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

(三)基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

F、适用法律和争议解决方式

(一)本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二)基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三)除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

G、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

(一)托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

(二)托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

1、《基金合同》终止；

2、本基金更换基金托管人；

3、本基金更换基金管理人；

4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

(三)基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

二十一 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金持有人的需要和市场的变化，有权增加或修改这些服务项目：

(一)资料寄送

每次交易结束后，投资者可在T+2个工作日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单，或在T+1个工作日后通过电话、网上服务手段查询交易确认情况。基金管理人不向投资者寄送交易确认单。

在从销售机构获取准确的邮政地址和邮政编码的前提下，基金管理人将负责寄送以下资料：

1、基金账户确认书

在开户确认后为投资人寄送基金账户确认书。在基金募集期间开户的，于基金合同生效后的15个工作日内，以书面形式寄送；存续期内，每个月结束后的15个工作日内，以书面形式寄送。

2、基金交易对账单

基金交易对账单包括季度对账单与年度对账单：

季度对账单在每季度结束后的15个工作日内向当季有交易的基金持有人以书面或电子文件形式寄送，若投资者在季度期内无交易发生，客户服务部不邮寄该季度的对账单；

年度对账单在每年度结束后的15个工作日内对所有基金持有人以书面或电子文件形式寄送。

3、其他相关的信息资料

指随基金交易对账单不定期寄送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、基金经理报告、客户服务问答等。

(二)红利再投资

本基金默认的分红方式为现金分红，当收益分配时，基金持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，注册登记机构将其所获红利按分红实施日的基金份额净值自动转为基金单位。红利再投资免收申购费用。

(三)定期定额投资

本基金可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金单位。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施情况和业务规则详情请见本公司发布的相关公告。

(四)资讯服务

在从销售机构获取准确的基金持有人账户信息（邮政地址、邮政编码、手机、EMAIL等）的前提下，基金管理人将提供以下服务：

1、手机短信服务

基金管理人可为投资者的提供个性化的手机短信息服务，如基金公告信息、基金分红、基金净值或公司各种活动提示等信息。

2、电子邮件服务

投资人在申请开立本公司基金账户时如预留电子邮件地址，可自动获得电子邮件公共信息服务，内容包括基金资讯信息、基金分红提示信息、定期基金报告和临时公告及各种基金理财刊物等。未预留相关资料的投资人可致电电话呼叫中心人工坐席或上网修改自己的相关资料获得此项服务。

(五)服务方式

1、电话呼叫中心

电话呼叫中心自动语音系统提供每周7天、每天24小时的自动语音查询服务，客户可通过电话收听最新公告信息、基金份额净值，并可自助查询基金账户余额信息等。同时，电话呼叫中心提供工作日9:00-17:30的人工服务。

电话呼叫中心电话：400-888-0001（免长途费），或021-38784638，按"0"可转人工坐席

传真：021-50103016

2、网上客户服务

网上客户服务为投资人提供查询服务、资讯服务以及与基金管理人一对一的相互交流平台。登录网站后，投资人可以通过输入账号及密码查询个人账户资料，包括基金持有情况、基金交易明细、基金分红实施情况等；并享受基金管理人提供的各种理财资讯服务；投资人还可以查询热点问题及其解答，并一对一的向基金管理人提交投诉和建议。

公司网址：www.huatai-pb.com

(六)客户投诉处理

投资人可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

二十二 其他应披露事项

暂无。

二十三 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十四 备查文件

(一)中国证监会核准华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

(二)《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

(三)《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

(四)法律意见书；

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照；

(六)基金托管人业务资格批件、营业执照；

(七)中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一〇年十二月十七日