信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书

基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金的募集申请经中国证监会 2010 年 12 月 21 日证监许可 2010［1877］号文核准。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。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。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的指数投资风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、以及份额配对转换及基金份额折算等业务办理过程中的特定风险等。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

第一部分　绪言

本招募说明书依据《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的规定，以及《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依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，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分　释义

本招募说明书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：指信诚中证 500 指数分级证券投资基金

2.基金管理人：指信诚基金管理有限公司

3.基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4.基金合同或本基金合同：指《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《信诚中证 500 指数分级证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6.招募说明书：指《信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7.基金份额发售公告：指《信诚中证 500 指数分级证券投资基金份额发售公告》

8.上市交易公告书：指《信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额上市交易公告书》

9.法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、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

10.《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11.《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12.《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13.《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14.中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15.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

16.中证 500 指数：指由上海和深圳证券市场中选取 500 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，以综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布

17.基金份额分级：指本基金的基金份额包括信诚中证 500 指数证券投资基金之基础份额、信诚中证 500 指数证券投资基金之 A 份额与信诚中证 500 指数证券投资基金之 B 份额。其中，信诚中证 500 指数证券投资基金之 A 份额与信诚中证 500 指数证券投资基金之 B 份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变

18.信诚中证 500 份额：指信诚中证 500 指数证券投资基金之基础份额

19.信诚中证 500 A 份额：指本基金份额按《基金合同》约定规则所分离的稳健收益类基金份额

20.信诚中证 500 B 份额：指本基金份额按《基金合同》约定规则所分离的积极收益类基金份额

21.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

22.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，以及中国证监会批准的其他可投资于证券投资基金的自然人

23.机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

24.合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于中国证券市场并取得国家外汇管理局外汇额度批准的中国境外的机构投资者

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

26.基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

27.基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

28.销售机构：指直销机构和代销机构

29.直销机构：指信诚基金管理有限公司

30.代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

31.基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

32.场外：指以交易所开放式基金交易系统以外的方式、通过销售机构办理基金销售业务的场所

33.场内：指以交易所开放式基金交易系统的方式、通过销售机构办理基金销售业务的场所

34.注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

35.注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为信诚基金管理有限公司或接受信诚基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

36.注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统

37.证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

38.基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

39.基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

40.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或证券投资基金账户

41.基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

42.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，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

43.基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

44.存续期：指基金合同生效后合法存续的期限。本基金的存续期间为不定期

45.日/天：指公历日

46.月：指公历月

47.工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

48.T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

49.T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

50.开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

51.交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

52.发售：指在基金募集期内，销售机构向投资人销售信诚中证 500 份额的行为

53.认购：指在基金募集期内，投资人通过场外或场内申请购买信诚中证 500 份额的行为

54.申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定通过场外或场内申请购买信诚中证 500 份额的行为

55.赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求通过场外或场内将信诚中证 500 份额兑换为现金的行为

56.份额配对转换：指根据基金合同的约定，本基金的信诚中证 500 份额与信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并两个方面

57.分拆：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每十份信诚中证 500 份额的场内份额申请转换成四份信诚中证 500 A 份额与六份信诚中证 500 B 份额的行为

58.合并：指根据基金合同的约定，基金份额持有人将其持有的每四份信诚中证 500 A 份额与六份信诚中证 500 B 份额进行配对申请转换成十份信诚中证 500 份额的场内份额的行为

59.会员单位：指具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位

60.上市交易：指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额的行为

61.转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作。转托管包括系统内转托管和跨系统转登记

62.系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为

63.跨系统转登记：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

64.基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

65.定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

66.巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

67.元：指人民币元

68.基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额

69.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

70.基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

71.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

72.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

73.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

74.不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况

第三部分　基金管理人

一、基金管理人概况

基金管理人：信诚基金管理有限公司

住所：　上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

办公地址：　上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

法定代表人：张翔燕

成立日期：　2005 年 9 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字［2005］142 号

注册资本：　2 亿元人民币

电话：　（021）6864 9788

联系人：　隋晓炜

股权结构：

股 东	出资额（万元人民币）	出资比例（%）
中信信托有限责任公司	9800	49
英国保诚集团股份有限公司	9800	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合 计	20000	100

二、主要人员情况

1.董事会成员

张翔燕女士，董事长，硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理，中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理，中信证券股份有限公司副总经济师，中信控股有限责任公司风险管理部总经理。现任中信控股有限责任公司副总裁。

马春光先生，董事，研究生。历任中信公司业务部会计、中信兴业信托投资公司财务经理、总会计师等职。2002 年 10 月起担任中信信托有限责任公司副总经理。

陈一松先生，董事，金融学硕士。历任中信实业银行资金部科长、中信证券股份有限公司总裁办主任、长城科技股份有限公司董事会秘书、中国建设银行股份有限公司行长秘书兼行长办公室副主任。现任中信信托有限责任公司副总经理。

Graham David Mason 先生，董事，南非籍，保险精算专业学士。历任南非公募基金投资分析师、南非 Norwich 公司基金经理、英国保诚集团（南非）执行总裁。现任英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务执行总裁。

柯世峰先生，董事，MBA。历任怡富证券投资顾问有限公司副总经理、友邦证券投资信托股份有限公司副总经理、ING 彰银安泰证券投资信托股份有限公司总经理、ING 安泰证券投资顾问有限公司董事长、AIG 环球退休服务友邦证券投资信托股份有限公司台湾区主管总经理。现任英国保诚证券投资信托股份有限公司（台湾）总经理。

何德旭先生，独立董事，经济学博士。历任中国社会科学院财贸所副所长、研究员。现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所副所长、金融研究中心副主任。

夏执东先生，独立董事，经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华中兴会计师事务所首席合伙人。现任北京京都天华会计师事务所有限责任公司副董事长。

2.监事

李莹女士，监事会主席，金融学硕士。历任中国建设银行沧浪办事处信贷科长、中国建设银行苏州分行中间业务部总经理助理、北京证券投行华东部一级项目经理、中新苏州工业园区创业投资有限公司投资银行部总经理、苏州工业园区银杏投资管理有限公司副总经理。现任苏州创业投资集团有限公司财务总监。

解晓然女士，监事，双学位，历任上海市共青团闸北区委员会宣传部副部长、天治基金管理有限公司监察稽核部总监助理。现任信诚基金管理有限公司监察稽核总监。

詹朋先生，职工监事，经济学学士。历任上海证券有限责任公司计划财务部主管、万家基金管理有限公司基金会计。现任信诚基金管理有限公司运营总监。

3.经营管理层人员情况

王俊锋先生，总经理、首席执行官，工商管理硕士。历任国泰基金管理有限公司市场部副总监、华宝兴业基金管理有限公司市场总监、瑞银环球资产管理（香港）有限公司北京代表处首席代表、瑞银证券有限责任公司资产管理部总监。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

隋晓炜先生，副总经理，经济学硕士，注册会计师。历任中信证券股份有限公司高级经理、中信控股有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司市场总监。现任信诚基金管理公司副总经理。

黄小坚先生，副总经理、首席投资官、股票投资总监，经济学硕士。历任申银万国证券公司研究所行业分析师，银华基金管理有限公司行业研究员、投资管理部组合经理、基金经理，华宝兴业基金管理有限公司基金经理。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席投资官、股票投资总监、信诚优胜精选股票型证券投资基金基金经理。

4.督察长

唐世春先生，督察长，法学硕士，历任北京天平律师事务所律师、国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书。现任信诚基金管理有限公司督察长。

5.基金经理

吴雅楠先生，统计物理学博士，CFA，历任加拿大 Greydanus，Boeckh & Associates 公司交易员/编程员、加拿大道明资产管理公司（TD Asset Management）副总裁/高级投资经理。现任信诚基金管理有限公司投资管理部数量分析总监。

6.投资决策委员会成员

黄小坚先生，副总经理/首席投资官/股票投资总监；
王旭巍先生，固定收益总监；
陈培峰女士，交易总监；
胡喆女士，　研究总监；
张锋先生，　股票投资副总监；
刘浩先生，　股票投资副总监。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

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.办理基金备案手续；

3.对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4.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；

5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6.编制季度、半年度和年度基金报告；

7.计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9.召集基金份额持有人大会；

10.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；

11.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；

12.有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

1.基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2. 基金管理人不从事下列行为：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

（3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人内部控制制度

1.内部控制的总体目标和原则

公司内部控制制度，是指公司为了保障业务正常运作、实现既定的经营目标、防范经营风险而设立的各种内控机制和一系列内部运作程序、措施和方法等文本制度的总称。内部控制的总体目标是：建立一个决策科学、营运高效、稳健发展的机制，使公司的决策和运营尽可能免受各种不确定因素或风险的影响。内部控制遵循以下原则：

全面性原则：内部控制渗透到公司的决策、执行和监督层次，贯穿了各业务流程的所有环节，覆盖了公司所有的部门、岗位和各级人员。

有效性原则：各项内部控制制度必须符合国家和主管机关所制定的法律法规和规章，不得与之相抵触；具有高度的权威性，是所有员工严格遵守的行动指南。

相互制约原则：在公司的各个部门之间、各业务环节及重要岗位体现相互监督、相互制约，做到公司决策、执行、监督体系的分离以及公司各职能部门中关键部门、岗位的设置分离（如交易执行部门和基金清算部门的分离、直接操作人员和控制人员的分离等），形成权责分明、相互牵制的局面，并通过切实可行的相互制衡措施来降低各种内控风险的发生。

及时性原则：内部控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化而不断修正，并随国家法律、法规、政策等外部环境因素的改变及时进行相应的修改和完善；

成本效益原则：公司将充分发挥各机构、各部门及广大员工的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

防火墙原则：公司基金投资、基金交易、投资研究、市场开发、绩效评估等相关部门，应当在空间和制度上适当分离，以达到防范风险的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的审批程序和监管措施。

2.风险防范体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构，并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系：

（1）一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风控与审计委员会，对公司经营管理与基金运作的合规性进行全面和重点的分析检查，发现其中存在的和可能出现的风险，并提出改进方案。

公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和董事会的授权进行工作。

（2）二级风险防范

二级风险防范是指在公司风险管理委员会、投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。

总经理下设风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的研究、分析、评估，制定相应的风险管理制度并监督制度的执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。

投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。

监察稽核部在总经理的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。

（3）三级风险防范

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

3.基金管理人关于风险管理和内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于风险管理和内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

第四部分　基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

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：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
法定代表人：郭树清
成立时间：2004 年 09 月 17 日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］12 号
联系人：尹　东
联系电话：（010）6759 5003

（下转 D10 版）

信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

【重要提示】

1. 信诚中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会 2010 年 12 月 21 日证监许可［2010］1877 号文核准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会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。

2.本基金类别为股票型，运作方式为契约型开放式。

3.本基金的管理人为信诚基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”），注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4.本基金的基金份额包括“信诚中证 500 份额”、“信诚中证 500 A 份额”与“信诚中证 500 B 份额”。其中，信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

5.本基金《基金合同》生效后，符合上市交易条件的，信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额将申请在深圳证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

6.本基金自 2011 年 1 月 6 日起至 2011 年 1 月 28 日发售，其中，场外通过基金管理人的直销中心和代销机构（详见本公告的附件）公开发售；场内通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位公开发售。基金管理人可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限并及时公告，但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

7.本基金募集对象为个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者。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，以及中国证监会批准的其他可投资于证券投资基金的自然人；机构投资者指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；合格境外机构投资者指符合相关法律法规规定可以投资于中国证券市场并取得国家外汇管理局外汇额度批准的中国境外的机构投资者。

8.投资人可通过场外认购和场内认购两种方式进行认购。本基金将通过基金管理人直销中心和各代销机构办理基金销售业务的营业场所办理或按基金管理人直销中心、代销机构提供的其他方式办理本基金场外认购业务。办理本基金场内认购的销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深交所网站查询。

各销售机构认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各销售机构的具体规定。

9.本基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

若投资人欲通过场外认购本基金，需开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。若已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户的，则不需要再次办理开户手续。认购期内本公司直销中心、本公司网上交易系统和代销机构的代销网点同时为投资人办理场外认购的开户和认购手续。

若投资人欲通过场内认购本基金，需持有深圳证券账户。其中，深圳证券账户是指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户（以下简称“深圳 A 股账户”）或证券投资基金账户。认购期内具有基金代销资格的深交所会员单位可同时为投资人办理场内认购的开户和认购手续。

10.除法律法规另有规定外，一个投资者只能开设和使用一个基金账户；不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

11.投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

12.本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。

13.在募集期内，通过代销网点场外认购本基金份额，单笔最低金额为 1,000 元人民币（含认购费）。通过直销中心首次认购的最低金额为 50 万元人民币（含认购费），追加认购最低金额为 1,000 元人民币。通过本公司网上交易平台办理本基金认购业务的不受直销中心最低认购金额的限制，最低认购金额为单笔 1,000 元。

通过具有基金代销资格的深交所会员单位场内认购基金，单笔最低认购份额为 1,000 份，超过 1,000 份的须为 1,000 份的整数倍，且每笔认购最大不超过 99,999,000 份基金份额。

本基金募集期间对单个基金份额持有人不设置最高累计认购金额限制。投资人在募集期内可多次认购基金份额，但认购申请一经销售机构受理，则不可以撤销。

14.为进一步方便投资人通过网上交易方式投资本公司旗下开放式基金，本公司与中国建设银行股份有限公司（以下简称为“中国建设银行”）、中国农业银行股份有限公司（以下简称为“农业银行”）和招商银行股份有限公司（以下简称为“招商银行”）合作，面向中国建设银行龙卡持卡人、农业银行金穗卡（借记卡、准贷记卡）持卡人和招商银行一卡通持卡人推出基金网上交易业务。持有以上银行卡的投资人，通过登录本公司网站，按照网上交易栏目的相关提示即可办理开放式基金的开户、交易及查询等业务。

15.销售网点（指代销网点和/或直销中心和/或本公司网上交易平台）对申请的受理并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实接受了认购申请，申请的成功确认应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资人可以在基金合同生效后到原认购网点查询认购成交确认情况。

13.本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在 2010 年 12 月 31 日《证券时报》、2011 年 1 月 4 日《中国证券报》和 2011 年 1 月 6 日《上海证券报》上的《信诚中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

14.各代销机构的代销网点、业务办理日期和具体时间等事项以各代销机构在其各销售城市当地的公告为准。

15.在募集期间，除本公告所列的代销机构外，如本基金增加其他代销机构的，本公司将及时公告。

16.投资人如有任何问题，可拨打本公司的客户服务电话 400-666-0066 或 021-51085168 咨询购买事宜。

17.基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

18.本发售公告中未明确指明仅适用于“场外认购”或“场内认购”的相关内容，对于“场外认购”、“场内认购”均适用。

19.基金管理人提示投资人充分了解基金投资的风险和收益特征，根据自身的风险承受能力，审慎选择适合自己的基金产品。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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，信诚中证 500 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；信诚中证 500 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。投资于本基金面临的主要风险有市场风险、投资风险、管理风险、流动性风险、本基金的特有风险、上市交易风险、技术风险及其他风险等。本基金以 1.00 元初始面值发售，但在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

具体而言，本基金的特有风险包括：

（1）指数投资的特有风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，标的指数为中证 500 指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险：

1）系统性风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，基金资产主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股，因此中证 500 指数的市场表现将影响到基金业绩的表现，当中证 500 指数出现收益变动、波动提高时，本基金的收益可能会受到影响。

2）指数复制风险

本基金采用分层抽样的方式来复制中证 500 指数，能否有效地复制指数并将跟踪误差控制在可接受范围内，对本基金的收益将产生影响。当复制方法由于市场条件受到限制或者替代股的选择存在错误时，本基金的收益可能会受到影响。

3）标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的回报率可能存在偏离。

4）标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

（2）分级结构运作的特有风险

本基金为分级基金，信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的运作有别于普通的开放式基金和封闭式基金，投资于本基金还将面临以下基金运作特有的风险：

1）上市交易的风险

本基金在基金合同生效后，信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

2）杠杆机制风险

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，信诚中证 500 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；信诚中证 500 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

由于信诚中证 500 B 份额内含杠杆机制的设计，信诚中证 500 B 份额的净值变动幅度将大于信诚中证 500 份额和信诚中证 500 A 份额的净值变动幅度，即信诚中证 500 B 份额的净值波动性将高于其他两类基金份额。

3）折/溢价交易风险

信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额上市交易后，由于受市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能发生偏离而出现折/溢价交易风险。尽管份额配对转换机制有助于将折/溢价交易风险降低至较低水平，但信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的某一级份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于份额配对转换机制的影响，信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的交易价格可能会相互影响，尤其是在临近份额配对转换业务的办理时点的时候。

4）风险收益特征变化风险

根据本基金份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算。在实施基金份额折算后，信诚中证 500 A 份额持有人或信诚中证 500 B 份额持有人将会获得一定比例的中证 500 份额的场内份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

当信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额终止运作后，信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额将全部转换成信诚中证 500 份额的场内份额，基金份额持有人所持有的基金份额也将面临风险收益特征出现变化的风险。

5）份额转换的风险

在实施基金份额折算后，信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额的净值增长将全部折算成信诚中证 500 份额的场内份额；当信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额终止运作后，信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额将全部转换成信诚中证 500 份额的场内份额。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以办理投资人赎回基金份额的业务。因此，基金份额持有人可能面临会员单位不具备基金代销业务资格而导致的不能直接赎回信诚中证 500 份额的场内份额的风险。此风险需要引起投资者注意，投资人可以选择在份额折算前将信诚中证 500 A 份额或信诚中证 500 B 份额卖出，或者将新增的信诚中证 500 份额的场内份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

一、本次基金份额发售基本情况

（一）基金名称及代码

信诚中证 500 指数分级证券投资基金（基金代码：165511）

场外基金简称：信诚中证 500 指数

场内基金简称：信诚 500

（二）基金类别

股票型证券投资基金

（三）基金运作方式

契约型开放式

（四）基金存续期限

不定期

（五）基金份额初始面值（认购价格）

每份基金份额初始面值为人民币 1.00 元

（六）上市交易所

深圳证券交易所

（七）基金的投资目标

本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证 500 指数的有效跟踪，为投资者提供一个投资中证 500 指数的有效工具。

（八）募集对象

个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（九）募集方式和募集场所

本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

场内发售是指通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售基金份额的行为。尚未取得基金代销资格，但属于深交所会员的其他机构，可在信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额上市后，代理投资人通过深交所交易系统参与信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额的上市交易。

场外发售是指通过基金销售机构（包括基金管理人的直销中心及代销机构，具体名单见本公告的附件）场外公开发售基金份额的行为。

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。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

本基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为信诚中证 500 份额；场内认购的全部份额将按 4:6 的比例确认为信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额。

若投资人欲于基金合同生效后持有信诚中证 500 份额，应选择认购信诚中证 500 场外份额；若投资人欲于基金合同生效后持有信诚中证 500 A 份额或信诚中证 500 B 份额，应选择认购信诚中证 500 场内份额。

（十）销售渠道与销售地点

1、直销中心

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台

信诚基金管理有限公司（上海）

地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

电话：021-68649788

传真交易专线：021-50120895

客服电话：400-666-0066 或 021-51085168

发售期间，客户可以通过本公司客户服务中心电话进行募集相关事宜的问询、开放式基金的投资咨询及投诉等。

网上交易平台地址：www.citicprufunds.com.cn

2、代销机构

代销机构的联系方式请见本公告的附件，如在募集期间新增代销机构，则另行公告。

3、场内代销机构

具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

基金管理人可根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

（十一）基金的最低募集份额总额和金额

基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元。

（十二）募集时间安排与基金合同生效

本基金的募集期限为 2011 年 1 月 6 日至 2011 年 1 月 28 日。基金管理人可根据认购的情况，依据法律法规和基金合同的规定适当延长或缩短募集期，但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

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，基金管理人应当自基金募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

二、募集方式与相关规定

募集期间，投资人可通过场外认购和场内认购两种方式认购本基金。

（一）基金份额的场外认购

1、本基金的初始面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元/份。

2、本基金场外认购采用金额认购方法，投资人在认购本基金时缴纳认购费，认购费用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

本基金场外认购费率不高于 5.0%，实际执行费率结构如下表：

单笔认购金额	认购费率
M<100 万	1.0%
100万≤M<200 万	0.6%
200万≤M<500 万	0.3%
M≥500 万	1000元/笔

（注：M：认购金额；单位：元）

投资人重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

3、场外认购份额的计算

本基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为信诚中证 500 份额。

本基金采用前端收费模式，即投资人在认购基金时缴纳认购费。

注册登记机构根据单次认购的实际确认金额确定每次认购所适用的费率并分别计算，具体计算公式如下：

当认购费用适用比例费率时，认购份数的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额初始面值

当认购费用为固定金额时，认购份数的计算方法如下：

认购费用=固定金额

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份数=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

场外认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以注册登记机构的记录为准。利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例如：某投资人通过场外认购本基金 10,000 元，所对应的认购费率为 1.0%。假定该笔认购金额产生利息 7.25 元。则其可得到的信诚中证 500 份额计算如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）=10,000/（1+1.0%）=9,900.99 元

认购费用=认购金额-净认购金额=10,000-9,900.99=99.01 元

认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额面值=（9,900.99+7.25）/1.00=9,908.24 份

即：该投资人投资 10,000 元通过场外认购本基金份额，在基金发售结束后，经确认的信诚中证 500 份额为 9,908.24 份。

4、投资人对基金份额的场外认购

（1）场外认购的时间安排

投资人可在募集期内前往本基金场外销售机构的网点办理基金份额认购手续，具体的业务办理时间详见本公告或各代销机构相关业务办理规则。

（2）投资人场外认购应提交的文件和办理手续

投资人场外认购应提交的文件和具体的办理手续详见本公告或各代销机构的相关业务办理规则。

（3）场外认购的方式和确认

1）投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3）投资人在 T 日规定时间内提交的认购申请，通常应在 T+2 日到原认购网点查询认购申请的确认情况。

4）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。认购的确认以注册登记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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

（4）在募集期内，除份额发售公告另有规定外，投资人在代销机构销售网点每笔认购最低金额为 1,000 元人民币（含认购费）；投资人在直销中心首次认购最低金额为 50 万元人民币（含认购费），追加认购的最低金额为 1,000 元人民币。通过本公司网上交易平台办理本基金认购业务的不受直销网点最低认购金额的限制，最低认购金额为单笔 1,000 元。本基金直销网点单笔认购最低金额可由基金管理人酌情调整。

（二）基金份额的场内认购

1、本基金份额的初始面值为人民币 1.00 元，挂牌价格为人民币 1.00 元/份。

2、本基金的认购费用应在投资人认购基金份额时收取。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

场内会员单位应按照场外认购费率设定投资人的场内认购费率。

3、场内认购份额的计算

本基金发售结束后，场内认购的全部份额将按 4:6 的比例确认为信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额。

本基金场内认购采用份额认购的方式。计算公式为：

净认购金额=挂牌价格×认购份额

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率

（注：对于适用固定金额认购费的认购，认购费用=固定认购费金额）

认购金额=净认购金额+认购费用

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。计算公式为：

利息折算的份额=利息/挂牌价格

认购金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入。利息折算份额的计算截位保留到整数位，剩余部分计入基金财产。

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额

经确认的信诚中证 500 A 份额=认购份额总额×0.4

经确认的信诚中证 500 B 份额=认购份额总额×0.6

信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额的计算保留至整数位（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

例如：某投资人通过场内认购本基金 20,000 份，若会员单位设定发售费率为 1.0%，假定该笔认购产生利息 20 元。则认购金额和利息折算的份额为：

挂牌价格=1.00 元

净认购金额=挂牌价格×认购份额=1.00×20,000=20,000 元

认购费用=挂牌价格×认购份额×认购费率=1.00×20,000×1.0%=200 元

认购金额=净认购金额+认购费用=20,000+200=20,200 元

利息折算的份额=利息/挂牌价格=20/1.00=20 份

认购份额总额=认购份额+利息折算的份额=20,020 份

经确认的信诚中证 500 A 份额=认购份额总额×0.4=20,020×0.4=8008 份

经确认的信诚中证 500 B 份额=认购份额总额×0.6=20,020×0.6=12012 份

即：该投资人通过场内认购 20,000 份基金份额，需缴纳 20,200 元，加上认购资金在认购期内获得的利息，在基金发售结束后，经确认的信诚中证 500 A 份额为 8008 份、信诚中证 500 B 份额为 12012 份。

4、投资人对基金份额的场内认购

（1）场内认购的时间安排

投资人可在募集期内前往具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位办理基金份额的场内认购手续，具体的业务办理时间详见本公告或各代销机构相关业务办理规则。

（2）投资人场内认购应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本公告或各代销机构相关业务办理规则。

（3）场内认购的方式及确认

1）投资人认购前，需按办理场内认购业务相关机构规定的方式备足认购的金额。

2）基金募集期内，投资人可多次认购基金份额，但已申请的认购不允许撤销。

3）投资人在 T 日规定时间内提交的认购申请，通常应在 T+2 日到原认购网点查询认购申请的受理情况。

4）办理场内认购业务的相关机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表办理场内认购业务的相关机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

（4）场内认购的限额

场内认购单笔最低认购份额为 1000 份，超过 1000 份的须为 1000 份的整数倍，且每笔认购最大不超过 99,999,000 份基金份额。

（下转 D12 版）

信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

投资人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，投资人自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《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《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。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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.依法转让其持有的信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额，依法申请赎回其持有的信诚中证 500 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或仲裁；

9.法律法规和基金合同规定的其他权利。

（二）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1.遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2.提供基金管理人和监管机构要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

3.交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

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.执行生效的基金份额持有人大会决议；

7.返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

8.法律法规和基金合同规定的其他义务。

（三）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

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.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3.发售基金份额；

4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5.在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

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

7.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理信诚中证 500 份额的申购和赎回申请；

8.在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

9.自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10.选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11.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；

12.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13.依法召集基金份额持有人大会；

14.法律法规和基金合同规定的其他权利。

（四）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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.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，确保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、信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的基金份额净值、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额终止运作后的份额转换比例和信诚中证 500 份额的申购、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.按规定受理信诚中证 500 份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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.依据《基金法》等的规定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.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24.执行生效的基金份额持有人大会决议；

25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（五）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

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资料；

8.法律法规和基金合同规定的其他权利。

（六）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

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；如果基金管理人有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.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

10.按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的基金份额净值、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额终止运作后的份额转换比例和信诚中证 500 份额的申购、赎回价格；

13.按照规定监督基金管理人的投资运作；

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.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；

18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19.参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21.执行生效的基金份额持有人大会决议；

22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23.建立并保存基金份额持有人名册；

24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（七）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称变更而有所改变。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人大会的审议事项应分别由信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额、信诚中证 500 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

（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、单独或合计持有信诚中证 500 份额、信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额各自基金份额 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（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；

（5）变更基金份额持有人大会程序；

（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，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）终止信诚中证 500 A 份额与信诚中证 500 B 份额的运作；

（10）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

（11）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或其他相关法律文件，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整信诚中证 500 份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

（3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（下转 D12 版）