（上接D9版）

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码:939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股（包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股）。

截至2009年12月31日,中国建设银行实现净利润1,068.36亿元,较上年增长15.32%,每股盈利为0.46元,较上年增加0.06元,盈利水平好于预期;平均资产回报率为1.24%,较上年降低0.07个百分点,加权平均净资产收益率为20.87%,较上年提高0.19个百分点,整体盈利趋势向好;总资产达到96,233.55亿元,较上年增长27.37%;资产质量在国内大银行中保持领先,不良贷款额和不良贷款率持续双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为1.50%,较上年末下降0.71个百分点;拨备水平充分,拨备覆盖率为175.77%,较上年末提升44.19个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行,在悉尼设有代表处,拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）36,021台,拥有员工约30万人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,在2009年共获得50多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的“全球金融品牌500强”、“全球银行1000强”中分列第9位和第12位,被《亚洲货币》杂志评为2009年度“中国区最佳银行”,被《欧洲货币》杂志评为2009年度“中国最佳银行”,连续两年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”,荣获《亚洲银行家》杂志颁发的“中国风险管理成就奖”,中国扶贫基金会颁发的“20年特别贡献奖”等奖项,被中国红十字基金会评为“最具责任感企业”。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室,现有员工130余人。2008年,中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第70号（SAS70）进行的内部控制审计,安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”,中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

（二）主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2010年6月30日,中国建设银行已托管158只证券投资基金,其中封闭式基金6只,开放式基金152只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。2010年初,中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated）,并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

（一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（二）监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1.场外发售机构

（1）直销机构

信诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台
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
电话:（021）6864 9788
联系人:殷宇飞

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。网上交易网址:www.citicprufunds.com.cn.

（2）代销机构

1）中国建设银行股份有限公司
注册地址: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号楼长安兴融中心
法定代表人:郭树清
客服电话:95533
公司网站:www.ccb.com

2）中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:孔丹
客服电话:95558
联系人:丰靖
网址:http://bank.ecitic.com

3）东莞银行股份有限公司
注册地址:广东东莞运河东一路193号
办公地址:广东东莞运河东一路193号
法定代表人:廖玉林
联系人:胡昱
电话:0769-22119061
传真:0769-22117730
统一客户服务电话:0769-96228
公司网站:www.dongguanbank.cn

4）中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人:杨明辉
统一客户服务电话:400-600-8008
公司网站:www.cjis.cn

5）西藏同信证券有限责任公司
注册地址:拉萨市北京中路101号
办公地址:上海市永和路118弄24号
法定代表人:贾绍君
统一客户服务电话:4008811177

6）光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号（200040）
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨、李芳芳
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788、10108998
公司网址:www.ebscn.com

7）海通证券股份有限公司
地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
客户服务电话:021-95553或4008888001
联系人:李笑鸣
网址:www.htsec.com

8）招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
电话:（0755）82960223
传真:（0755）82943636
网址:www.newone.com.cn
客服电话:95565、4008888111

9）国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法人代表人:何如
联系电话:0755-82130833
基金业务联系人:齐晓燕
联系电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
全国统一客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

10）安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
联系人:陈剑虹
联系电话:0755-82825551
客服电话:4008001001
公司网站:?www.essence.com.cn

11）广发证券股份有限公司
法定代表人:王志伟
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:（020）87555305
公司网站:广发证券网 www.gf.com.cn

12）广发华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
客户服务电话:96326（福建省外请加拨0591）或拨打各城市营业网点咨询电话

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金,并及时公告。

13）长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:95579或4008-888-999
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
长江证券客户服务网站:www.95579.com

14）东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:吴宇
联系电话:021-63325888
客服电话:95503
公司网站:www.dfzq.com.cn

15）平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）
法定代表人:杨宇翔
全国免费业务咨询电话:4008816168
开放式基金业务传真:0755-82400862
全国统一总机:4008866338
联系人:周璐（zhoulu002@pingan.com.cn,0755-22626172）
网址:www.pingan.com

16）中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝内大街188号
法定代表人:张佑君
统一客户服务电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

17）齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20518号
办公地址:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

18）华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址:深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人:马昭明
联系人:庞晓芸
联系电话:0755-82492000
客服电话:95513
公司网站:www.lhzq.com

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

2.场内发售机构:深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位,具体名单见本基金份额发售公告。

二、注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金颖
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
联系电话:010-58598839
传真:010-58598907
联系人:朱立元

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
联系电话:（021）31358666
传真:（021）31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬

四、审计基金财产的会计师事务所
名称:毕马威华振会计师事务所
住所:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
办公地址:北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
法定代表人:萧伟强
电话:8621 2212 2888
传真:8621 6288 1889
联系人:王国蓓
经办注册会计师:王国蓓、黄小熠

第六部分 基金份额分级

本基金的基金份额分级及其基本运作如下。

一、基金份额结构

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

二、基金的基本运作概要

1.本基金通过场外、场内两种方式公开发售。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500A份额与信诚中证500B份额。（具体认购方法参见发售公告）

2.本基金合同生效后,信诚中证500份额接受场外与场内申购和赎回;信诚中证500A份额、信诚中证500B份额只上市交易,不接受申购和赎回。

3.本基金合同生效后,基金管理人将根据基金合同的约定办理信诚中证500份额与信诚中证500A份额、信诚中证500B份额之间的份额配对转换业务。

4.本基金合同生效后,基金管理人按照基金合同规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。折算后基金运作方式及信诚中证500A份额与信诚中证500B份额配比不变。

三、信诚中证500A份额、信诚中证500B份额概要

1.存续期限

自基金合同生效之日起存续。

2.基金份额配比

信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额配比始终保持4:6的比例不变。

3.信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额净值计算

信诚中证500A份额和信诚中证500B份额具有不同的净值计算规则,即信诚中证500A份额和信诚中证500B份额的风险和收益特征不同。

在本基金的存续期内,本基金将在每个工作日按照基金合同约定的净值计算规则对信诚中证500A份额和信诚中证500B份额分别进行基金份额净值计算。

本基金净资产优先分配信诚中证500A份额的本金及信诚中证500A份额的约定收益,本基金在优先分配信诚中证500A份额的本金及信诚中证500A份额的约定收益后的剩余净资产分配予信诚中证500B份额。

信诚中证500A份额的约定年收益率为一年期银行定期存款年利率（税后）加上3.2%。其中计算信诚中证500A份额约定年收益率的一年期银行定期存款年利率是指基金合同生效日或生效后每个运作周年的最后一个工作日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率。

例如:若本基金合同生效日为2011年1月21日,则以2011年1月21日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率（税后）加计3.2%作为第一个运作周年（2011年1月21日至2012年1月20日）的约定年收益率。若第一个运作周年的最后一个工作日为2012年1月20日,则以2012年1月20日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期整存整取基准年利率（税后）加计3.2%作为下一个运作周年的约定年收益率,依此类推。

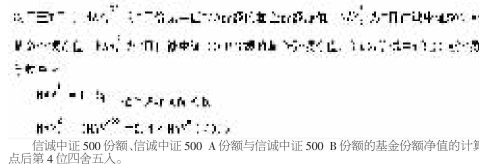
信诚中证500A份额的约定年收益率除以运作周年实际天数得到信诚中证500A份额的约定日收益率。信诚中证500A份额的基金份额净值以1.000元为基础,采用信诚中证500A份额的约定日收益率乘以应计约定收益的天数进行单利计算。其中,运作周年指自基金合同生效日或最近一个定期份额折算日次日起每满一周年的运作期间,运作周年实际天数为该期间内的实际天数。信诚中证500A份额在净值计算日应计约定收益的天数为自基金合同生效日或最近一个份额折算日次日至净值计算日的实际天数。

基金管理人并不承诺或保证信诚中证500A份额的约定收益,如在本基金存续期内基金资产出现极端损失的情况下,信诚中证500A份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

（1）信诚中证500份额的基金份额净值计算公式

T日信诚中证500份额的基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日本基金（包括信诚中证500份额、信诚中证500A份额、信诚中证500B份额）的基金份额余额总数

（2）信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额净值计算公式



信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额净值的计算均保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。

（3）信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额净值公告

信诚中证500A份额和信诚中证500B份额的基金份额净值在当天收市后计算,并在下一日内与信诚中证500份额的基金份额净值一同公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

4.信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的终止运作

经基金份额持有人大会决议通过,信诚中证500A份额与信诚中证500B份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过,即须经参加基金份额持有人大会的信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额各自的基金份额持有人或其代理人各自所持信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。

第七部分 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同,经2010年12月21日中国证监会证监许可2010［1877］号文件核准募集。

一、基金类型、运作方式和存续期间

基金类型:股票型
基金运作方式:契约型,开放式
存续期间:不定期

二、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（具体名单见本基金份额发售公告或相关业务公告）。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500A份额、信诚中证500B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500A份额、信诚中证500B份额的上市交易。

场外发售是指通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点,具体名单见基金份额发售公告）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500A份额与信诚中证500B份额。

三、募集期限

自基金份额发售之日起,最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

四、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。

五、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。

六、基金份额的场外认购

1、募集场所

本基金的场外认购通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点（具体名单详见基金份额发售公告）进行。

2、基金份额的初始面值、认购费用、认购价格及计算公式

（1）本基金份额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）场外认购费用

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	场外认购费率
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。

3、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基金的基金份额发售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基金基金份额发售公告和各销售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。

七、基金份额的场内认购

1、募集场所

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位（具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告）进行。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500A份额、信诚中证500B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500A份额、信诚中证500B份额的上市交易。

2、基金份额的初始面值、认购费用、认购价格及计算公式

（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。

（3）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。

（4）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500A份额与信诚中证500B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500A份额=认购份额总额×0.4
经确认的信诚中证500B份额=认购份额总额×0.6

信诚中证500A份额、信诚中证500B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500A份额=认购份额总额×0.4=20,020×0.4=8008份
经确认的信诚中证500B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500A份额为8008份、信诚中证500B份额为12012份。

3、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（具体名单见基金份额发售公告）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基金的基金份额发售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基金的基金份额发售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。

八、募集资金利息的处理方式

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。

九、募集资金的保管

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

第八部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件

1.本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售,且基金募集达到基金备案条件,基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。

2.基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

3.基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在基金合同生效后折成投资人认购的基金份额,归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

二、基金募集失败

1.基金募集期届满,未达到基金备案条件,则基金募集失败。

2.如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内返还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

3.如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后的存续期内,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

第九部分 信诚中证500份额的申购与赎回

本基金合同生效后,投资人可通过场外或场内两种方式对信诚中证500份额进行申购与赎回。信诚中证500A份额、信诚中证500B份额只上市交易,不接受申购与赎回。

一、信诚中证500份额申购和赎回场所

投资人办理信诚中证500份额场外申购与赎回业务的场所包括基金管理人和基金管理人委托的场外代销机构。

投资人办理信诚中证500份额场内申购与赎回业务的场所为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

投资人需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理场外申购、赎回业务;需使用深圳证券账户办理场内申购、赎回业务,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或证券投资基金账户。

本基金场外、场内代销机构名单将由基金管理人在发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。

投资人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信诚中证500份额的申购与赎回。若基金管理人或其委托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信诚中证500份额的申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

1.开放日及开放时间

申购与赎回的开放日是指为投资人或信诚中证500份额持有人办理信诚中证500份额申购、赎回等业务的上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日（基金管理人根据相关法律法规及基金合同的规定公告暂停信诚中证500份额申购、赎回时除外）。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2.信诚中证500份额申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理信诚中证500份额的场外申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理信诚中证500份额的场外赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

信诚中证500份额场内申购、赎回开始办理的时间由基金管理人根据基金注册登记机构的相关规定确定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理信诚中证500份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请并被受理的,其信诚中证500份额申购、赎回价格为下一开放日信诚中证500份额申购、赎回的价格。

三、信诚中证500份额申购与赎回的原则

1.“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的信诚中证500份额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,即信诚中证500份额的申购以金额申请,赎回以份额申请;

3.信诚中证500份额持有人在场外销售机构赎回信诚中证500份额时,遵循“先进先出”原则,即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回;

4.当日信诚中证500份额的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销,在当日业务办理时间结束后不得撤销;

5.投资人办理信诚中证500份额场外申购、赎回应使用基金账户,办理信诚中证500份额场内申购、赎回应使用深圳证券账户;

6.投资人办理信诚中证500份额的场内申购、赎回业务时,需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。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场内申购、赎回业务规则有新的规定,按新规定执行;

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可依法更改上述原则,但应在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

四、信诚中证500份额申购与赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出信诚中证500份额申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构和深圳证券交易所规定的方式备足申购资金,投资人在提交赎回申请时须持有足够的信诚中证500份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效。

2.申购和赎回申请的确认

基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司作为注册登记机构代为办理注册登记业务。注册登记机构应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日）,在正常情况下,注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况,如投资人未进行前述查询,因申请未得到注册登记机构的确认而造成的损失,由投资人自行承担。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

在法律法规允许的范围内,本基金注册登记机构可根据业务规则,对上述业务办理时间进行调整,本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

3.申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人委托的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后,基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

五、信诚中证500份额申购和赎回的数额和价格

1.申购金额、赎回份额及余额的处理方式

（1）投资人在办理信诚中证500份额场内申购时,单笔申购的最低金额为1,000元人民币。投资人办理信诚中证500份额场外申购时,单笔最低金额为1,000元人民币（含申购费）。通过直销中心首次申购的最低金额为50万元人民币（含申购费）,追加申购最低金额为1,000元人民币（含申购费）。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制,但受追加申购最低金额的限制。通过本公司网上交易系统办理信诚中证500份额申购业务的不受直销网点单笔申购最低金额的限制,申购最低金额为单笔1,000元。本基金直销中心单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。

代销网点的投资人欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整首次申购的最低金额。

投资人可多次申购,对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（2）信诚中证500份额持有人在销售机构赎回时,每笔赎回申请不得低于1000份信诚中证500份额,且通过场内单笔申请赎回的信诚中证500份额必须是整数份;信诚中证500份额持有人赎回时或赎回后将导致在销售机构（网点）保留的信诚中证500份额余额不足1000份的,需一并全部赎回。

（3）信诚中证500份额持有人每个交易账户的最低份额余额为1000份。信诚中证500份额持有人因赎回、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的信诚中证500份额低于1000份时,注册登记系统可对该剩余的基金份额自动进行强制赎回处理。

2.基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前2日依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案。

3.信诚中证500份额的申购份额计算

信诚中证500份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。注册登记机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。计算公式如下:

当申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下:
净申购金额=申购金额/（1+申购费率）
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

当申购费用为固定金额时,申购份额的计算方法如下:
申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的,申购份额计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担;通过场内方式进行申购的,申购份额计算结果采用截尾法保留至整数位,不足1份部分对应的申购资金将返还给投资人。

例一:某投资人通过场外投资5,000元申购信诚中证500份额,对应费率为1.2%,假设申购当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.128元,则其可得到的申购份额为:
净申购金额=5,000/（1+1.2%）=4,940.71元
申购费用=5,000-4,940.71=59.29元
申购份数=4,940.71/1.128=4,380.06份

即:该投资人通过场外投资5,000元申购信诚中证500份额,假设申购当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.128元,则可得到4,380.06份信诚中证500份额。

例二:某投资人通过场内投资10,000元申购信诚中证500份额,对应的申购费率为1.2%,假设申购当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.025元,则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:
净申购金额=10,000/（1+1.2%）=9,881.42元
申购手续费=10,000-9,881.42=118.58元
申购份额=9,881.42/1.025=9,640.41份

因场内申购份额计算结果采用截尾法保留至整数份,故投资人申购所得份额为9,640份,不足1份部分对应的申购资金将返还给投资人。具体计算公式为:
实际净申购金额=9,640×1.025=9,881元
退款金额=10,000-9,881-118.58=0.42元

即:该投资人投资10,000元从场内申购信诚中证500份额,假设申购当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.025元,则其可得到信诚中证500份额9,640份,退款0.42元。

4.信诚中证500份额的赎回金额计算

投资人在赎回信诚中证500份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下:
赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率
净赎回金额=赎回金额-赎回费

赎回金额单位为元,计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

例三:某信诚中证500份额持有人持有10,000份信诚中证500份额一年后（未满2年）决定从场外赎回,对应的赎回费率为0.25%,假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值是1.148元,则可得到的净赎回金额为:
赎回总金额=10,000×1.148=11,480元
赎回费用=11,480×0.25%=28.70元
净赎回金额=11,480-28.70=11,451.30元

即:该信诚中证500份额持有人持有10,000份信诚中证500份额一年后（未满2年）从场外赎回,假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值是1.148元,则可得到的净赎回金额为11,451.30元。

例四:某信诚中证500份额持有人从场内赎回10,000份信诚中证500份额,赎回费率为0.5%,假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.148元,则可得到的净赎回金额为:
赎回总金额=10,000×1.148=11,480元
赎回费用=11,480×0.5%=57.40元
净赎回金额=11,480-57.40=11,422.60元

即:该信诚中证500份额持有人从深圳证券交易所场内赎回10,000份信诚中证500份额,假设赎回当日信诚中证500份额的基金份额净值为1.148元,则可得到的净赎回金额为11,422.60元。

5.信诚中证500份额的基金份额净值计算

信诚中证500份额的基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

六、信诚中证500份额申购与赎回的费用

1.信诚中证500份额的申购费用由投资人承担,不列入基金资产,用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。信诚中证500份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2.根据基金合同的规定,信诚中证500份额的申购费率不超过5%,赎回费率不超过5%。

3.信诚中证500份额的场外申购费率如下:

单笔申购金额	场外申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<200万	0.8%
200万≤M<500万	0.4%
M≥500万	1000元/笔

（注:M:申购金额;单位:元）

信诚中证500份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

4.信诚中证500份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减,场外赎回的实际执行的费率如下:

持有时间	场外赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

（注:Y:持有时间,其中1年为365日,2年为730日）

信诚中证500份额的场内赎回费率为固定值0.5%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。

从场内转托管至场外的信诚中证500份额,从场外赎回时,其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

5.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,针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人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信诚中证500份额的申购费率和赎回费率。

6.基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前2日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人对信诚中证500份额的申购申请:

1.因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。

2.证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4.基金管理人合理判断认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5.基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形,并且基金管理人决定拒绝或暂停申购的,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的信诚中证500份额赎回申请或延缓支付赎回款项:

1.因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2.证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3.连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

4.发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或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账户申请量占申请总量的比例支付给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过20个工作日,并在指定媒体上公告。投资人在场外申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以延期赎回或取消赎回。在暂停赎回的情况消除后,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。对于场内赎回部分,当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤消。

九、巨额赎回的情形及处理方式

1.巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的信诚中证500份额净赎回申请（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）超过前一开放日的基金总份额（包括信诚中证500份额、信诚中证500A份额和信诚中证500B份额）的10%,即为巨额赎回。

2.巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。对于场内赎回部分,当日未获受理的赎回申请将不会延至下一开放日而自动撤销。

（1）全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,按照投资人在提交赎回申请时事先选择的延期赎回或取消赎回区别处理,选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回:信诚中证500份额连续2日以上（含本数）发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受信诚中证500份额的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

3.巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1.发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

2.如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登信诚中证500份额重新开放申购或赎回公告,并公布最近1个开放日的基金份额净值。

3.如发生暂停的时间超过1日但少于2周（包括2周）,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在指定媒体上刊登信诚中证500份额重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的基金份额净值。

4.如发生暂停的时间超过2周,暂停期间,基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在指定媒体上连续刊登信诚中证500份额重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的信诚中证500份额的基金份额净值。

十一、基金转换

在法律法规及监管机构允许且相关注册登记机构业务规则允许的情况下,本基金管理人可以开展信诚中证500份额与其它基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

十二、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理信诚中证500份额定期定额投资计划,具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理信诚中证500份额定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

第十部分 信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的上市交易

一、上市交易的基金份额

本基金合同生效后,基金管理人将根据有关规定,申请信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的上市交易。

二、上市交易的地点

深圳证券交易所

三、上市交易的时间

在符合下述第四项规定的基金上市条件的前提下,信诚中证500A份额与信诚中证500B份额拟在基金合同生效后六个月内申请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公告。

四、基金上市的条件

如基金具备下列条件,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交易。

1.基金募集金额不低于2亿元人民币;

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。

五、上市交易的规则

1.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额分别采用不同的交易代码上市交易;

2.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额上市首日的开盘参考价分别为各自前一交易日的基金份额净值;

3.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为10%,自上市首日起实行;

4.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额买入申报数量为100份或其整数倍;

5.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币;

6.信诚中证500A份额、信诚中证500B份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等其他有关规定。

六、上市交易的费用

信诚中证500A份额、信诚中证500B份额上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

七、上市交易的行情揭示

信诚中证500A份额、信诚中证500B份额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

八、上市交易的注册登记

投资人T日买入成功后,注册登记机构在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续,投资人自T+1日（含该日）后有权卖出该部分基金;

投资人T日卖出成功后,注册登记机构在T日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

九、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

信诚中证500A份额、信诚中证500B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

十、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无须召开基金份额持有人大会,但应在本基金更新的招募说明书中列示。

十一、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,基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

第十一部分 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务

一、基金份额的登记

1.本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转登记从场内转入的信诚中证500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;信诚中证500A份额、信诚中证500B份额以及场内认购、申购或通过跨系统转登记从场外转入的信诚中证500份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人的深圳证券账户下。

2.登记在证券登记结算系统中的信诚中证500份额可以申请场内赎回;登记在注册登记系统中的信诚中证500份额可以申请场外赎回。

3.登记在证券登记结算系统中的信诚中证500A份额、信诚中证500B份额只能在深圳证券交易所上市交易,不能直接申请场内赎回。

二、系统内转托管

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

2.基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理信诚中证500份额赎回业务的销售机构（网点）时,须办理已持有信诚中证500份额的系统内转托管。

3.基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理信诚中证500A份额、信诚中证500B份额上市交易或信诚中证500份额场内赎回的会员单位（交易单元）时,须办理已持有基金份额的系统内转托管。

4.募集期内不得办理系统内转托管。

5.基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

三、跨系统转登记

1.跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的信诚中证500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.信诚中证500份额跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

3.募集期内不得办理跨系统转登记。

4.基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

五、基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

第十二部分 基金的份额配对转换

本基金合同生效后,基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

一、份额配对转换是指本基金的信诚中证500份额与信诚中证500A份额、信诚中证500B份额之间的配对转换,包括分拆和合并两个方面。

1.分拆。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500A份额与六份信诚中证500B份额的行为。

2.合并。基金份额持有人将其持有的每四份信诚中证500A份额与六份信诚中证500B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。

二、份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人届时发布的相关公告。

投资人应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、注册机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构,并予以公告。

三、份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换自基金合同生效后不超过6个月的时间内开始办理,基金管理人将在开始办理份额配对转换前2日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外）,具体业务办理时间见招募说明书,在招募说明书规定的上述时间之外不办理份额配对转换业务。

若深圳证券交易所交易时间、交易规则或注册登记机构规则更改或实际情况需要,基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

四、份额配对转换的原则

1.份额配对转换以份额申请。

2.申请进行“分拆”的信诚中证500份额的场内份额必须是10的整数倍。

3.申请进行“合并”的信诚中证500A份额与信诚中证500B份额必须同时配对申请,且基金份额数必须同为整数且两者的比例为4:6。

4.信诚中证500份额的场外份额如需申请进行“分拆”,须跨系统转登记为信诚中证500份额的场内份额后方可进行。

5.份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整,并在正式实施前2日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。

五、份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则,具体见相关业务公告。

六、暂停份额配对转换的情形

1.基金管理人认为继续接受份额配对转换可能损害基金份额持有人利益时决定暂停份额配对转换的情形。

2.其他基金管理人出于保护投资人利益的角度,决定暂停份额配对转换的情形。

3.深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务的情形。

4.法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的,基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时,基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理,并依照有关规定在至少一家指定媒体公告。

七、份额配对转换的业务办理费用

投资人申请办理份额配对转换业务时,份额配对转换业务办理机构可按照不高于0.3%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用,具体见相关业务公告。

第十三部分 基金的投资

一、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。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证500指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证500指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的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%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

三、投资策略

本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在中证500指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略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,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:

（1）基本面替代:按照与被替代股票所属行业,基本面及规模相似的原则,选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库;

（2）相关性检验:计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合,以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,求解组合中替代股票的权重,并构建替代股组合。

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。

四、标的指数与业绩比较基准

1.标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证500指数。

中证500指数是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。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

如果中证500指数被停止编制及发布,或中证500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证500指数不宜继续作为标的指数,或证券市场上有代表性更强、更合适投资的指数推出,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益并履行适当程序的前提下,更换本基金的标的指数和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

2.业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:95%×中证500指数收益率+5%×金融同业存款利率。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。

本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准,基金管理人应于变更前在中国证监会指定的媒体上公告。

五、风险收益特征

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500A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;信诚中证500B份额具有高风险、高预期收益的特征。

六、投资决策与投资管理流程

1.投资决策依据

以《基金法》和本基金基金合同等有关法律法规为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2.投资决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定基金投资的整体策略和原则,审定基金定期投资检讨报告及决定基金禁止的投资事项等。基金经理负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3.投资管理流程

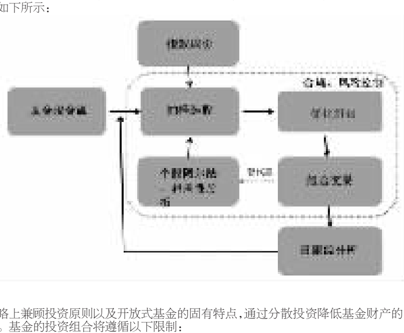
（1）每日跟踪分析:本基金跟踪指数,因此指数跟踪的偏离度和风险分析尤为重要。数量分析组对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行每日跟踪测算,并提供数量风险分析报告。投研部行业研究员对基准指数成份股中基本面变化、流动性变化的企业情况提供及时的风险分析报告。运营部每日提供基金申购赎回的数据分析,供基金经理投资决策参考。

（2）基金经理根据数量风险分析和申购赎回分析报告,在追求跟踪误差最小化的目标下,控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险,降低交易成本。

（3）交易部依据基金经理指令,制定交易策略,通过组合交易系统执行指数投资组合的交易。

（4）风险管理部根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议。监察稽核部对指数化抽样复制的执行过程进行合规监控。基金经理依据申购赎回和成份股停牌等情况控制投资组合的流动性风险。

投资管理流程图如下所示:



七、投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

（1）本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

（2）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

（4）本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%;

（5）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

（6）本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

（8）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

（9）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

（10）基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

（11）本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

（12）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

（13）本基金在任何交易日日终,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%;

（14）基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;其中,有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等;

（15）基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;

（16）基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计（轧差计算）不低于基金资产净值的90%,且不得超过基金资产净值的95%;

（17）基金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%;

（18）基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的资产配置比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

（1）承销证券;

（2）向他人贷款或者提供担保;

（3）从事承担无限责任的投资;

（4）买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

（8）依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;

（9）法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

八、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益;

2.不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

3.有利于基金财产的安全与增值;

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

九、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

第十四部分 基金的财产

一、基金资产总值

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

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

三、基金财产的账户

本基金的基金财产以基金名义开立银行存款账户,以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销,不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

第十五部分 基金资产估值

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

二、估值方法

1.证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等）,以其估值日在证券交易所的收盘价估值;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,确定估值价;

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定估值价;

（3）交易所上市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得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定估值价;

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。

2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;在证券交易所挂牌的同一股票在估值日无交易的,以根据1.（1）确定的同一股票的估值价估值;

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值价估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3.全国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。

4.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。

5.如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

6.相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

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

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

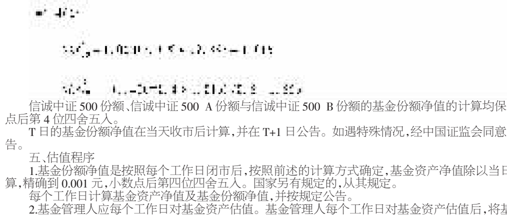
四、基金份额净值的计算

本基金分别计算并公告信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额净值。

1.信诚中证500份额的基金份额净值计算

T日信诚中证500份额的基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日本基金（包括信诚中证500份额、信诚中证500A份额、信诚中证500B份额）的基金份额余额总数

2.信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额净值计算



信诚中证500份额、信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的基金份额净值的计算均保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

五、估值程序

1.基金份额净值是按照每个工作日闭市后,按照前述的计算方式确定,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1.差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2.差错处理原则

（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,给当事人造成损失的,由差错责任方对直接损失承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”）,则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（下转D11版）