



（上接C7版）

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措,防止下列行为发生:
Q 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;
Q 对受托人待其管理的不同基金财产;
Q 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;
Q 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
Q 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。
3、本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚信务实、勤勉尽责,不从事以下活动:
Q 越权或违规经营;
Q 违反基金合同或托管协议;
Q 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;
Q 向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
Q 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
Q 玩忽职守、滥用职权;
Q 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄露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;

Q 违反证券交易所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;
Q 贬低同行,抬高自己;
Q 以不正当手段谋求业务发展;
Q 有失诚信,损害证券投资基金人形象;
Q 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
Q 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺
Q 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;
Q 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;
Q 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄露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;
Q 不得从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上交易后履行托管人职责做出如下承诺:
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

（二）根据《基金法》、《暂行办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资业务等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《暂行办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为,将及时以书面形式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并书面回复对基金托管人发出书面通知,在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人未按规定对通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为西南证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见:

- 1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;
- 2、基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

- （一）中国证监会批准上证中小盘交易所开放式指数证券投资基金设立的文件
- （二）《上证中小盘交易所开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《上证中小盘交易所开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）注册登记协议
- （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）华泰柏瑞基金管理有限公司募集设立上证中小盘交易所开放式指数证券投资基金的法律意见书

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,可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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。基金的投资业绩并不反映其将来表现,投资有风险,敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力进行投资。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一一年三月二十三日

基金合同摘要

1. 基金份额持有人的权利、义务
1. 基金份额持有人的权利:
 - Q 分享基金财产收益;
 - Q 参与分配清算后的剩余基金财产;
 - Q 依法转让或申请赎回或卖出其持有的基金份额;
 - Q 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
 - Q 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;
 - Q 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
 - Q 监督基金管理人的投资运作;
 - Q 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;
2. 基金份额持有人的义务:
 - Q 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
 - Q 缴纳基金认购、申购对价及基金合同约定的费用;
 - Q 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;
 - Q 不得从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法权益的活动;

3. 基金募集基金,办理基金备案手续;
 - Q 依照法律法规和基金合同规定管理运用基金财产;
 - Q 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;
 - Q 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,获得基金管理管理费,收取认购费、申购费、赎回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;
 - Q 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额;
 - Q 在本合同的有效期内,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中国证监会要求的前提下,基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同约定对基金财产,其他基金合同当事人的利益造成重大损失的,应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;
 - Q 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和其相关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;
 - Q 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管理,办理基金注册登记业务,并依照基金合同规定对基金注册登记机构进行必要的监督和检查;
 - Q 在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购赎回申请;
 - Q 在法律法规允许的范围内,为基金份额持有人的利益依法进行融资、融券;
 - Q 依据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益分配方案;
 - Q 按照法律法规规定,代表基金对被投资企业的行使股东权利,代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利;
 - Q 在基金托管人职责终止时,提名新的基金托管人;
 - Q 4 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;
 - Q 5 以基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或外部机构有确定有关费率;
 - Q 6 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的外部机构并确定有关费率;
 - Q 7 法律法规、基金合同规定的其他权利。

4. 基金管理人的权利、义务:
 - Q 依法募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构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;
 - Q 办理基金备案手续;
 - Q 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;
 - Q 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;
 - Q 建立健全内部控制、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;
 - Q 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;
 - Q 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;
 - Q 8 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;
 - Q 9 依法接受基金管理人的监督;
 - Q 10 编制季度、半年度和年度基金报告;
 - Q 11 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合基金合同等文件的的规定;
 - Q 12 计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回对价;
 - Q 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;
 - Q 14 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金合同、基金合同及其他有关规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
 - Q 15 按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回对价;
 - Q 16 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料;
 - Q 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、基金托管人依法召集基金份额持有人大会;
 - Q 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实施其他法律行为;
 - Q 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;
 - Q 20 在基金合同终止或基金合同约定的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
 - Q 21 基金管理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;
 - Q 22 法律法规、基金合同和中国证监会规定的其义务。

5. 基金托管人的权利、义务:
 - Q 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;
 - Q 依照基金合同的约定获得基金托管费;
 - Q 监督基金管理人对本基金的投资运作;
 - Q 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、基金合同规定的其权利。
6. 基金托管人的义务:
 - Q 安全保管基金财产;
 - Q 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;
 - Q 按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
 - Q 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得以基金财产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;
 - Q 对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;
 - Q 保存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;
 - Q 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
 - Q 按照基金合同的约定,根据基金管理人的指令,及时办理清算、交割事宜;
 - Q 保守基金商业秘密,除《基金法》、基金合同及其他有关规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;
 - Q 10 根据法律法规及本合同的约定,办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
 - Q 11 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见,说明基金管理人各在重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
 - Q 12 建立、保存基金份额持有人名册;
 - Q 13 复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值;
 - Q 14 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
 - Q 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之外的赎回对价;
 - Q 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;
 - Q 17 按照法律法规监督基金管理人的投资运作;
 - Q 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;
 - Q 19 因基金管理人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,除法律法规另有规定外,基金托管人不承担赔偿责任;
 - Q 20 法律法规、基金合同和中国证监会规定的其义务。

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或基金份额持有人的合法授权代表组成。基金份额持有人持有每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金的联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决,其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数,在本本基金基金份额持有人大会的权益登记日,联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例,计算结果按照四舍五入的方法,保留到整数位。

本基金的联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权,但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人的代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的,须先通知联接基金合同当事人约定的召集联接基金的基金份额持有人大会,联接基金的基金份额持有人大会决议授权召集或召集本基金份额持有人大会的,由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

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

1. 终止基金合同;
2. 转换基金运作方式;
3. 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. 变更基金类别;
6. 变更基金投资目标、范围或策略;
7. 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序;
8. 本基金与其他基金合并;
9. 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等法律法规规定的其他事项;
10. 法律法规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）有下列情形之一的,可由基金管理人、基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:

1. 调低基金管理费、基金托管管理费;
2. 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;
3. 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修订;
4. 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变化;
5. 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;
6. 除法律法规和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. 除法律法规或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。
2. 基金管理人未按规定召集或不能召集时,基金份额持有人认为有必要召开的,应当自行召集。

3. 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,基金托管人认为有必要召开的,应当自行召集。

4. 代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。

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

6. 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。

7. 召开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
1. 召开基金份额持有人大会,召集人应当于会议召开前30天在至少一种指定媒体上公告。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:

- Q 会议召开的日期、地点、方式;
- Q 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式;
- Q 代理投票授权委托书送达时间和地点;
- Q 会务涉及联系人姓名、电话;
- Q 权益登记日;
2. 如采用书面表决方式,会议通知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、投票表的截止日以以及表决的送达地等信息。
3. 如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人代为监督人向指定地点交付书面表决意见的票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人作为监督人向指定地点交付书面表决意见的票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人作为监督人向指定地点交付书面表决意见的票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的票进行监督的,不影响计票和表决效力。

（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和通讯方式开会。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或基金托管人的授权代表应当出席,基金管理人或托管人拒不派代表参加的,不影响计票效力;通讯方式开会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,但决定基金管理人更换或基金托管人更换、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会议:

1. 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席者持有委托的委托出席持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同及会议通知的规定;
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,全部有效凭证所代表的基金份额权益登记日基金总份额的50%以上;

在同时符合以上条件时,通讯开会的方式视为有效:

1. 召集人按基金合同约定公布会议通知后,在两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权益登记日基金总份额的50%以上;

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者持有出具的委托材料具有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同及会议通知的规定;

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个工作日内),且确定有权出席基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

（七）议事内容及提案权
1. 议事内容为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. 基金份额持有人、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前至少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出的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

- Q 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,应在本次基金份额持有人大会上进行解释和说明。
- Q 程序性。大会召集人对于提案涉及的事项性问题做出决定,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议的程序进行审议。
- Q 代表基金份额10%以上基金份额持有人提案基金份额持有人大会审议表决的提案,或基金份额持有人或基金管理人提案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。

4. 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。

（八）表决
1. 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,报经中国证监会备案或审批后,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内公告会议的公告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。

（九）表决权
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:

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(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。

（十）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用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。

（十一）计票
1. 现场开会
Q 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。

Q 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。

Q 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票票进行重新清点;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票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,不影响计票和计票效力。

（十二）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,自公告之日起5日起生效并报中国证监会核准或备案。基金份额持有人大会决定的事项由中国证监会依法核准或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议。

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至少在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,必须将公证证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（十三）法律法规或监管机构对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。
（一）基金收益分配原则
1. 本基金收益分配采用现金方式;

2. 每一基金份额享有同等分配权;

3. 基金管理人每季度对基金相对标的指数的超额收益进行一次评估,基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上,可进行收益分配;

4. 基于本基金的特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使单位基金份额净值低于面值;

5. 基金收益分配比例不得低于收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的100%,自基金合同生效日起不满3个月不可进行收益分配,基金收益分配每年至多4次;

6. 法律、法规及监管机构另有规定的从其规定。

（二）基金收益分配原则的确定原则
1. 在收益评价日,基金管理人计算基金累计报酬率,标的指数同期累计报酬率。
基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去1乘以100%; 标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘日基金份额折算日标的指数收盘价之比减去1乘以100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益率=基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率

截至收益评价日基金超过标的指数的超额收益= (基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率)×收益评价日发行在外的基金份额总额×基金份额折算日基金份额净值

2. 每基金份额的应分配收益为上述确定的基金超额收益数额除以收益评价日发行在外的基金份额总额,保留小数点后3位,第4位舍去。

（三）收益分配方案
基金收益分配方案中应载明基金超额收益、基金收益分配对价、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（四）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后确定,基金管理人按法律法规的规定向中国银监会备案并公告。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

（五）基金收益分配中发生的费用
基金收益分配时应当向本基金的注册登记机构支付一定的收益分配费用,该部分费用在基金财产中列支。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例
（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. 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和诉讼费;

7. 基金资产的审计、汇划费用及开户费用;

8. 基金上市费及年费;

9. 基金收益分配中发生的费用;

10. 指数使用费用;

11. 按照国家有关法律法规规定和基金合同约定,可以列入的其他费用。
本基金上市清算时发生费用,按实际支出从基金资产总值中扣除。

（二）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
基金管理人按基金资产净值的0.50%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值0.50%年费率计提。计算方法如下:
H= E×0.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人的。

2. 基金托管人的基金托管费
基金托管人按基金资产净值的0.10%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值0.10%年费率计提。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为前一日基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3. 指数使用费用
本基金的指数使用费即指可使用费用,为ETF年度基金资产净值的0.03% (3bp), 扣除管理费后的净支出(即每年季人民币约50,000元(即不足5万部分按实际发生取),在通常情况下,指数资金使用基点费按前一日ETF基金资产净值的0.03% (3个基点)的年费率计提。指数款可使用费用每日计算,逐日累计。

计算方法如下:
H= E×0.03%÷当年天数
H为每日应付的指数款可使用费用,E为前一日ETF基金资产净值。

4. 本条第(一)款第3至第11项费用基金管理人、基金托管人根据关法规及相关协议的规定,列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:

1. 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;
2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3. 基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费等费用;
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金费用调整基金托管费的调整
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。

（五）基金运作过程中涉及的各项纳税主体,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
（一）投资目标
紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（二）投资范围
本基金以标的指数的成份股、备选成份股为主要投资对象,指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的95%,如因标的指数成份股调整导致基金投资比例不符合上述标准的,基金管理人将在10个工作日内进行调整,同时为了更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券、非公开发行股、股指期货及其他中国证监会允许基金投资的其他金融工具,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,但因法律法规的规定而受限制的除外。

（三）投资策略及参与限制
1. 禁止用本基金财产从事以下行为
Q 承销证券;

Q 向他人贷款或提供担保;

Q 向从事承销业务的机构提供承销服务;

Q 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

Q 购买非本基金、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;

Q 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;

Q 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;

Q 6 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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人可在履行适当程序后不受上述规定的限制。

2. 基金投资组合比例限制
本基金的投资组合将遵循以下限制:

- Q 基金财产参与股票发行申购,单只基金所申报的金额超过基金总资产,单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- Q 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%;
- Q 在任何交易日日终,持有的买入股指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);
- Q 在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过持有的股票总市值的20%;
- Q 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持有的股票总市值的20%;
- Q 在任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;
- Q 本基金合同关于投资范围和投资比例等约定;
- Q 中国证监会规定禁止的其他情形。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人以外的原因导致投资组合比例不符合上述规定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个工作日内进行调整,以达到标准,法律法规另有规定的从其规定。

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,基金管理人可在依法履行相应程序后,本基金可相应调整投资组合中的基金品种。

6. 基金份额净值的计算方法及公告方式
（一）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、赎回对价应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

（二）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。

（三）估值对象
基金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
Q 1 上市流通股票的估值
Q 1.1 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。

Q 1.2 未上市股票的估值
新股、可转债、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,以最近交易日的收盘价估值。

首次发行未上市股票,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。

（五）有明确锁定期的股票
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,按交易所上市的不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. 固定收益品种的估值办法
（一）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,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,确定公允价值。

（二）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