南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）招募说明书

(上接D5版)

二、主要人员情况

1.董事会成员

吴万善先生,董事,中共党员,大学/EMBA。历任中国人民银行江苏省分行金融管理处科员、中国人民银行南京市分行江宁支行科员;华泰证券证券发行部副经理、总经理助理;江苏省证券登记处总经理;华泰证券副总经理、总裁、现任华泰证券股份有限公司董事长、党委副书记、南方基金管理有限公司董事长。

张海先生,董事,中共党员,博士研究生。历任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理、深圳总部副总经理、深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书、总裁助理兼董事会办公室主任;现任华泰证券股份有限公司副总裁、党委委员。

姜健先生,董事,中共党员,硕士研究生。历任南京农业大学教师;华泰证券人事处职员、人事处培训教育科科长、投资银行部股票事务部副经理、投资银行一部副总经理、投资银行一部高级经理、投资银行总部副总经理兼发行部总经理、资产管理总部总经理、投资银行业务总监兼投资银行业务南京总部总经理、总裁助理兼上海总部总经理、公司机构客户服务部总经理。现任华泰证券股份有限公司副总裁、董事会秘书、党委委员。

李真先生,董事,中共党员,材料工程、企业管理双学士,高级工程师。历任机械工业部科技司材料工艺处、科研管理处副主任科员、总工程师秘书、科技与质量监督司行业技术处副处长;深圳亚洲金刚石有限公司副总经理(干部交流);深圳市投资管理公司董事局秘书处副主任、综合部副部长、部长、总裁助理兼工业一部部长、办公室主任;深圳市通产实业有限公司党委书记、董事长;深圳会展中心管理有限责任公司党委书记、总经理、董事长;现任深圳市投资控股有限公司董事、总经理、党委副书记。

周建国先生,董事,中共党员,经济学硕士。历任某公社会计、团委书记;江西财经学院教师、企业财务教研室负责人、会计系办公室主任、会计系副主任、成人教育处处长(副教授);深圳中旅信实业有限公司副总经理;深圳市商贸投资控股公司审计部部长、计财部部长,兼任商控实业有限公司董事长、党委书记,深圳市商贸投资控股公司总裁助理;深圳市投资控股有限公司计划财务部部长;现任深圳市投资控股有限公司副总经理。

洪文瑾女士,董事,中共党员,硕士研究生。历任厦门经济特区建设发展公司财务部,厦门建发集团有限公司财务部副经理、厦门建发信托投资公司副总经理、总经理,厦门国际信托投资有限公司总经理,现任厦门国际信托有限公司董事长。

庄园芳女士,董事,工商管理硕士,经济师。历任兴业证券交易业务部总经理助理、负责人,证券投资部副总经理、总经理,投资总监;现任兴业证券股份有限公司副总裁。

高良玉先生,董事,中共党员,经济学硕士,经济师。历任南京农业大学审计处干部,中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长、南方基金管理有限公司副总经理,现任南方基金管理有限公司总裁、党委书记。

张磊先生,独立董事,工商管理硕士(MBA)及国际关系硕士,注册金融分析师(CFA),获得美国NASD Series 7 & 65证书。曾工作于耶鲁大学投资基金办公室(Yale Endowment)及美国新生市场投资基金(Emerging Markets Management，LLC),主要从事基金管理及投资研究。历任纽约证券交易所国际董事及中国首席代表;现任HCM投资管理有限公司高级合伙人、United World College of Southeast Asia Foundation校董、耶鲁大学校务委员会成员、国际顾问委员会成员、纽约金融分析师协会会员。

周春生先生,独立董事,博士,历任美国联邦储备委员会经济学家、美国加州大学及香港大学商学院教授、中国证监会规划发展委员会委员(副局级)、中国留美金融学会理事、美国经济学会、美国金融研究会会员、Annals of Economics and Finance编委、北京大学光华管理学院院长助理、EMBA中心主任、高层管理者培训与发展中心主任、财务金融学教授、香港大学荣誉教授、深圳证券交易所第一、二、三届上市委员会委员;现为长江商学院金融教授、EMBA和高层培训项目学术主任,国家杰出青年基金获得者。

王金洲先生,独立董事,中共党员,大学学历,1997年中国人民大学会计专业研究生班毕业,注册会计师、资产评估师、注册税务师;历任北京市财政局会计处副处长、北京会计公司总经理(正处级);现任北京兴华会计师事务所董事长、主任会计师。

从培国先生,独立董事,法学硕士。历任北京大学法律系经济法教研室助教、经济师讲师、经济法教研室副主任、美国加州大学洛杉矶校区(UCLA)客座教授、北京大学副教授;现任北京君佑律师事务所合伙人、事务所主任。

米志明先生,独立董事,本科,高级经济师、注册会计师。历任江苏省委堰税务局副局长、扬州市财政局副局长、党组书记、扬州市人民政府副秘书长、建设银行扬州市分行行长、党组书记、财政部深圳专员办专员、巡视员。

2.监事会成员

骆新都女士,职工监事,经济学硕士,经济师。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、顾问;现任南方基金管理有限公司监事会主席。

舒本姝女士,监事,本科。历任熊猫电子集团公司财务处财务处长,华泰证券计划资金部副总经理(主持工作)、稽查监察部副总经理、总经理;现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

周景民先生,监事,工学硕士、工商管理硕士(MBA),经济师。历任深圳三九企业集团三九贸易公司职员,深圳大鹏证券有限公司投资银行部项目经理、加拿大西蒙弗雷泽大学工商管理学院MBA学生兼助教,广东美的集团战略发展部高级经理,招商局集团中国南山开发(集团)公司研究发展部高级项目经理,深圳市投资控股有限公司投资部副经理、经理;现任深圳市投资控股有限公司投资部高级主管。

苏荣坚先生,监事,学士学位,高级经济师。历任三明市财政局、财委,厦门信达股份有限公司财务部、厦门国际信托投资公司财务部业务主办、副经理,自营业务部经理;现任厦门国际信托有限公司财务部总监兼财务部总经理。

郑威美先生,监事,中共党员,经济学硕士。历任兴业证券华林营业部客户经理、研究发展中心市场分析师、经纪业务部市场分析师、办公室文秘部经理、南平滨江路营业部副总经理(主持工作)、计划财务部副总经理、财务部总经理;现任兴业证券董事会秘书处总经理兼计划财务部总经理。

苏民先生,职工监事,博士研究生,工程师。历任安徽国投深圳证券营业部电脑工程师、华夏证券深圳分公司电脑部经理助理、南方基金管理有限公司运作保障部副总监、市场服务部总监;现任南方基金管理有限公司电子商务部兼风险管理部总监。

3.总裁及其他高级管理人员

高良玉先生,董事,总裁,中共党员,经济学硕士,经济师。历任南京农业大学审计处干部、中国人民银行金融管理司主任科员、中国证监会发行部副处长、南方基金管理有限公司副总经理,现任南方基金管理有限公司总裁、党委书记。

俞文宏先生,副总裁,中共党员,工商管理硕士,经济师。历任江苏省投资公司业务经理、江苏国际招商公司部门经理、江苏省国际信托投资公司投资银行部总经理、江苏国信高科技创业投资有限公司董事长兼总经理。现任南方基金管理有限公司副总裁、董事会秘书、党委副书记。

郑文祥先生,副总裁,工商管理硕士。曾任职于湖北省荆州市农业银行、南方证券公司、国泰君安证券公司,任职南方基金管理有限公司期间,历任国债投资经理、专户理财部副总监、南方避险增值基金经理、总经理助理兼养老金业务部总监,现任南方基金管理有限公司副总裁。

朱运东先生,副总裁,中共党员,经济学学士。曾任职于财政部地方预算司及办公厅、中国经济开发信托投资公司,2002年加入南方基金,历任北京分公司总经理、产品开发部总监、总裁助理、首席市场执行官,现任南方基金管理有限公司副总裁。

秦长奎先生,督察长,中共党员,工商管理硕士。历任华泰证券有限公司营业部总经理、部门总经理、总裁助理。现任南方基金管理有限公司督察长、党委委员、纪委委员。

4.基金经理

黄亮先生,2001年毕业于北京大学光华管理学院,获工商管理硕士学位。9年证券从业经历,2005年获得基金从业资格。曾任职于招商证券资产管理部和天华国际投资公司海外发展部,2005年1月加入南方基金,现任南方全球精选配置基金经理、南方金砖四国指数证券投资基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

总裁高良玉先生,总裁助理邱魏先生,总裁助理兼国际业务部总监丁晟女士。

6.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;

(2)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

(3)办理基金备案手续;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理、分别记账,进行证券投资;

(6)按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(7)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(8)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;

(9)依法接受基金托管人的监督;

(10)编制中期和年度基金报告;

(11)采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

(12)计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

(13)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(14)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予以保密,不得向他人泄露;

(15)按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(16)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

(17)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

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

(19)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、处置等工作;

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

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

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

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

(24)基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(25)法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1.基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2.基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1)将基金管理人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,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)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;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6)玩忽职守,滥用职权;

(7)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;

(8)除按本公司制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他股票投资;

(9)协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易;

(10)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;

(11)贬损同行,以提高自己;

(12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

(13)以不正当手段谋求业务发展;

(14)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(15)其他法律、行政法规禁止的行为。

五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

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.买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

5.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;

6.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;

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、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

六、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.不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

3.不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;

4.不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的内部控制制度

1.内部控制制度概述

为了保证公司规范运作,有效地防范和化解管理风险,经营风险以及操作风险,确保基金财务和公司财务以及其他信息真实、准确、完整,从而最大程度地保护基金份额持有人的利益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是对各项基本管理制度的总揽和指导,内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

2.内部控制原则

健全性原则:内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员,并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个运作环节。

有效性原则:通过科学的内控手段和方法,建立合理的内控程序,维护内控制度的有效执行。

独立性原则:公司各机构、部门和岗位在职能上应当保持相对独立,公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

相互制约原则:公司内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡,并通过切实可行的措施来实行。

成本效益原则:公司应充分发挥各机构、各部门及各级员工的工作积极性,运用科学性的方法尽量降低经营运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3.主要内部控制制度

(1)内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务会计制度、会计工作操作流程和会计岗位职责,并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、复核制度、账务处理程序、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法、财产登记保管和实物资产盘点制度、会计档案保管和财务交接制度等。

(2)风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门制定,风险控制制度由风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险控制的具体制度、风险控制制度执行情况的监督等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险管理制度、财务风险控制制度、信息技术系统风险控制制度以及岗位分离制度、防火墙制度、反馈制度、保密制度等程序性风险管理制度。

(3)监察稽核制度

公司设立督察长,负责监督检查基金和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。督察长由总经理提名,董事会聘任,并经全体独立董事同意。

督察长负责组织指导公司监察稽核工作。除应当回避的情况外,督察长享有充分的知情权和独立的调查权。督察长根据履行职责的需要,有权参加或者列席公司董事会以及公司业务、投资决策、风险管理等相关会议,有权调阅公司相关文件、档案。督察长应当定期或者不定期向全体董事报送工作报告,并在董事会及董事会下设的相关专门委员会定期会议上报告基金及公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

公司设立监察稽核部门,具体执行监察稽核工作。公司配备了充足合格的监察稽核人员,明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的职责和工作流程。

监察稽核制度包括内部稽核管理办法、内部稽核工作准则等,通过这些制度的建立,检查公司各业务部门和人员遵守有关法律、法规和规章的情况;检查公司各业务部门和人员执行公司内部控制制度、各项管理制度和业务规章的情况。

7. 境外投资顾问

本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、聘任、更换或撤销境外投资顾问,并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

8. 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》、基金合同及其他有关规定,并经中国证监会2011年6月20日证监许可[2011]968号文批准募集。

本基金为契约型开放式基金。基金存续期限为不定期。

一、募集期

自基金份额发售之日起,最长不超过3个月,具体发售时间见基金份额《发售公告》。

二、发售对象

本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者和中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

三、募集目标

本基金的募集目标将按照中国证监会和外管局核准的额度(美元额度需折算为人民币)设定。本基金的募集目标详见《发售公告》中的有关规定。

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

四、发售方式和销售渠道

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

本基金认购的申请方式为书面申请或管理人公布的其他方式。基金投资者在募集期内可多次认购,认购一经受理不得撤销。

基金份额首次发行面值为人民币1.00元,按首次发行面值发售。本基金认购的币种为人民币。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。若资金未全额到账则认购无效,基金管理人将认购无效的款项退回。基金投资者在募集期内可多次认购基金份额,认购一经受理不得撤销。当日(T日)在规定时间内提交的申请,投资者通常可在T+2日到网点查询交易情况。

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或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

五、认购费用

本基金场外认购时投资者可以选择支付前端认购费用或后端认购费用;场内认购时投资者只能选择支付前端认购费用。本基金前端认购费率最高不高于1.1%,且随认购金额的增加而递减,后端认购费率最高不高于1.2%,且随持有时间的增加而递减,如下表所示:

前端收费:

购买金额(M)	认购费率
M<100万	1.1%
100万≤M<500万	0.6%
500万≤M<1000万	0.2%
M≥1000万	每笔1000元

后端收费(其中1年为365天):

持有期限(N)	认购费率
N<1年	1.2%
1年≤N<2年	1.1%
2年≤N<3年	0.8%
3年≤N<4年	0.5%
4年≤N<5年	0.2%
N≥5年	0

投资者重复认购,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。

六、认购期利息的处理方式

《基金合同》生效前,投资者的认购款项只能存入专门账户,不得动用。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,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

七、基金认购份额的计算

(一)场外认购份额的计算

1.基金场外认购采用"金额认购、份额确认"的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为:

(1)若投资者选择缴纳前端认购费用,则认购份额的计算公式为:

净认购金额 = 认购金额/(1+前端认购费率)

前端认购费用 = 认购金额-净认购金额

认购份额 =(净认购金额+认购利息)/基金份额面值

例:某投资者投资10万元场外认购本基金,该笔认购产生利息50元。若该投资者选择缴纳前端认购费,对应认购费率为1.1%,则其可得到的认购份额为:

净认购金额=100,000/(1+1.1%)=98,911.97元

前端认购费用=100,000-98,911.97=1,088.03元

认购份额 =(98,911.97+50)/1.00 =98,961.97份

(2)若投资者选择缴纳后端认购费用,则认购份额的计算公式为:

认购份额=(认购金额+认购利息)/基金份额面值

当投资者提出赎回时,后端认购费用的计算方法为:

后端认购费用=赎回份额×认购当日基金份额净值x后端认购费率

例:某投资者投资10万元场外认购本基金,该笔认购产生利息50元。若该投资者选择后端认购费,则其可得到的认购份额为:

认购份额 =(100,000+50)/1.00 = 100,050份

若投资者赎回本基金,其后端认购费用的计算详见《基金份额的申购与赎回》。

2.场外认购金额、份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入;由此产生的误差计入基金财产。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,其中利息转份额以基金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舍去,余额计入基金财产。

(二)场内认购份额的计算

1.基金场内认购采用"份额认购、份额确认"的方式,计算公式为:

净认购金额=认购份额×挂牌价格

认购费用=认购份额x挂牌价格x认购费率

认购金额=净认购金额+认购费用

认购利息结转份额=认购利息/挂牌价格

实得认购份额=认购份额+认购利息结转份额

例:某投资者通过场内认购本基金100,000.00份,且认购期利息为50.50元,则其可得到的认购份额为:

净认购金额=100,000.00x1.00=100,000.00元

认购费用=100,000.00x1.00x1.1%=1100.00元

认购金额=100,000.00x1.00+1100=101,100.00元

认购利息结转份额=50.50/ 1.00=50份

实得认购份额=100,000.00+50=100,050份

2.认购期内本基金份额的面值为1.00元,挂牌价格为基金份额初始面值。

3.场内认购金额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额持有人所有,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。利息折算的份额采用截位法保留至整数位(最小单位为1份),余额计入基金财产。

八、基金认购金额的限制

本基金场外代销机构首次认购和追加认购最低金额均为人民币1,000元,具体认购金额以各基金代销机构的公告为准。本基金直销机构最低认购金额由基金管理人制定和调整。

本基金场内单笔认购份额应为1,000份或其整数倍,且每笔认购最大不超过99,999,000份基金份额。

九、基金份额的认购和持有限额

基金管理人不对每个账户的认购和持有基金份额进行限制。

9. 基金合同的生效

一、基金备案的条件

自本基金基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金管理人可以依据相关法律法规和招募说明书的规定决定停止基金发售并向中国证监会申请办理基金备案手续。

二、基金的备案

基金募集期结束,具备上述基金备案条件的,基金管理人应当自募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续。

三、基金合同的生效

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

四、基金合同不能生效时的处理方式

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

1.以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;

2.在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。

五、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后的存续期内,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现上述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的,按其规定办理。

10. 基金份额的上市交易

一、基金上市

1.上市交易的地点

深圳证券交易所。

2.上市交易的时间

本基金合同生效后三个月内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报刊和网站上刊登上市交易公告书。

3.基金上市条件

基金合同生效后具备下列条件,基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》,向深圳证券交易所申请上市:

(1)基金募集金额不低于2亿元;

(2)基金份额持有人不少于1000人;

(3)《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前,基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的,基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。

三、暂停上市交易

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

1.不再具备本章第一款规定的上市条件;

2.违反法律、行政法规,中国证监会认定暂停其上市;

3.严重违反深圳证券交易所有关规则的;

4.深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时,基金管理人应向深圳证券交易所提出恢复上市申请,经深圳证券交易所核准后可恢复本基金上市,并在至少一家指定媒体发布基金恢复上市公告。

四、终止上市交易

基金份额上市交易后,有下列情形之一的,深圳证券交易所可终止基金的上市交易,并报中国证监会备案:

1.自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的;

2.基金合同终止;

3.基金份额持有人大会决定终止上市;

4.深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

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

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

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

11. 基金份额的申购和赎回

一、申购与赎回场所

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

基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构,并予以公告。

二、申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回日(《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理。基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

申购和赎回的开放日为深圳和上海证券交易所及本基金投资的主要市场同时交易的交易日。本基金目前投资的主要市场为中国中小盘股票指数成份股挂牌交易的主要证券交易所,即香港交易所。若本基金投资的主要市场发生变更,将在招募说明书(更新)中进行列示。本基金的开放时间由基金管理人和代销机构遵照有关法律法规约定,投资者应当在开放日的开放时间办理申购和赎回申请。基金管理人可与销售机构约定,在非开放日或开放日的其他时间受理或者拒绝投资者的申购、赎回申请,届时以基金管理人或者销售机构的公告为准。如果本基金接受投资者在非开放时间提出的申购、赎回申请的,其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对开放日和开放时间进行调整,但此项调整应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

三、申购和赎回的原则

1."未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日基金份额净值为基准进行计算;

2."金额申购、份额赎回"原则,即申购以金额申请、赎回以份额申请;

3.当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

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

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

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

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

8.基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人应按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

四、申购与赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序,在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资者在提交赎回申请时,必须有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2.申购和赎回申请的确认

投资者T日提交的申购、赎回申请,正常情况下,注册登记机构在T+2日内对该交易申请的有效性进行确认,T日提交的有效申请,投资者应在T+3日后(包括该日)及时向销售网点或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对投资者申购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。因申请不符合基金管理人、销售机构、注册登记机构的规定而不予确认而造成的损失,由投资者自行承担。投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

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

3.申购和赎回的款项支付

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,申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请确认后,基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项。基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+10日内将赎回款项划往基金份额持有人账户;如基金投资所处的主要市场或外汇市场正常或非正常停市时,赎回款项支付的时间将相应调整;如遇不可抗力,基金管理人适当延迟通过注册登记机构及其相关基金销售机构将赎回款项划往基金份额持有人账户的时间。在发生巨额赎回时,赎回款项的支付办法按本基金合同、招募说明书的有关规定处理。

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

五、申购与赎回的数额限制

1.本基金场外首次申购和追加申购的最低金额均为1,000元,基金代销机构另有规定的,以基金代销机构的规定为准。本基金不对场外单笔最低赎回份额进行限制,基金份额持有人可将其全部或部分基金份额场外赎回,基金代销机构另有规定的,以基金代销机构的规定为准。本基金场内申购和赎回的数额限制须遵守注册登记机构和销售机构的约定。

2.本基金不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制。

3.本基金不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制。

4.基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购金额和赎回份额的数量限制,基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

六、申购费用和赎回费用

1.本基金场外申购时投资者可以选择支付前端申购费用或后端申购费用;场内申购时投资者只能选择支付前端申购费用。

本基金前端申购费率最高不高于1.3%,且随申购金额的增加而递减,后端申购费率最高不高于1.4%,且随持有时间的增加而递减,如下表所示:

前端收费:

购买金额(M)	申购费率
M<100万	1.3%
100万≤M<500万	0.7%
500万≤M<1000万	0.2%
M≥1000万	每笔1000元

后端收费(其中1年为365天):

持有期限(N)	申购费率
N<1年	1.4%
1年≤N<2年	1.3%
2年≤N<3年	1.0%
3年≤N<4年	0.7%
4年≤N<5年	0.4%
N≥5年	0

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2.本基金场外赎回费率不高于0.5%,随申请份额持有时间增加而递减(其中1年为365天)。具体如下表所示:

申请份额持有时间(N)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.3%
N≥2年	0

本基金场内赎回费率为0.5%。

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产,赎回费归入基金财产的比例不得低于25%。

3.本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

4.对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和赎回费率,并另行公告。

5.基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

七、申购份额与赎回金额的计算

1.基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

(1)若投资者选择缴纳前端申购费用(适用于场外、场内),则申购份额的计算公式为:

净申购金额 = 申购金额/(1+前端申购费率)

前端申购费