(上接D13版)

金管理有限公司工作,所任行业研究员,基金经理助理。交易主管;2008年2月加入国泰基金管理有限公司,2008年 2月至2009年8月任交易部总监;2009年9月至2011年6月任研究部总监;2011年1月已兼任投资制总监。2011年4月 起任国泰保本混合党业游投资基金的基金经理;2011年6月建新任国泰金牌保本增值指令证券投资基金的基金经

理。2010年11月起日社公司职工监事。 王骏、监事,硕士研究主,曾任国秦君专证券公司会计、清算部经理、2001年10月加人国泰基金管理有限公司, 从事基金登记核算工作,现任运营管理部总监。2007年11月起任公司职工监事。

3.高级管理人员 除勇胜、董事长、简历情况见董事会成员介绍。 金旭,总经理,简历情况见董事会成员介绍。 金旭,总经理、简历情况见董事会成员介绍。 世立康、硕士研究生、高级会计师、19年证券从业经历。1993年4月至1998年4月在华夏证券工作,历任营业部 财务经理、公司计划财务和则总经理维上海分公司财务部经理。1998年4月至2007年11月在华夏基金管理有限公 司工作、历任综合管理都总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。现任公司副总经理兼北京分公司 台经理

這經理。

愛之平、本科、15年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理、大成基金管理有限公司基金运营部总监 市场部总监兼客户服务中心总监 委托投资部总监、2008年4月加入国泰基金管理有限公司、任总经理助理兼财富管理中心总经理。现任公司副总经理兼深圳分公司总经理和财富管理中心总经理。
李峰、硕士研究生、16年银行证券基金从业经历。曾任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管。国际安基金管理有限公司监察辖核专员(信城基金管理有限公司等移长、美国富足系並洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009年2月加盟国泰基金管理有限公司,现任公司督察长。

4本基金拟任基金经理
查养(夏旦大学理论物理学博士、英国剑桥大学管理学研究生。曾任平安资产管理公司资产配置经理、量优货经理。2008年5月加盟国泰基金管理有限公司,任数量金融分析师。现担任上证180金融交易型开放式指数证券投资基金及取接基金和国泰沪深500指数基金的基金经理。

分对风度被近及积效或量率16条件。保500亩公益金五户建金五户建。 5.本基金投资决策委员会成员 本基金管理人设有公司投资决策委员会,其成员在公司总经理。分管副总经理、投资总监、研究部、固定收益 部基金管理局、财富管理中心、市场体系等负责人员由产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相 关人员担任成员,督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根 据有关法规和基金合同,审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则,以及研究科关投资管门提出的面大投资建议等。 投资决策委员会成员组成如下; 会新小士,台经理

梁之平先生:副总经理兼深圳分公司总经理和财富管理中心总经理

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

6.77年子选业划,目4年47日2月7人以目6.22年7年7人。 9.召集基金份额特有人大会; 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。

伍 基金管理人承诺 1.基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施、防止违反《证

》17919发生。 2.基金管理人承诺不从事违反《甚金法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止下列行

c: (i))將其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

6 路其固有財产或者他人財产混同于基金财产、
6)不公平地对待其管理的不同基金财产。
6)用用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;
4 阿基金份额持有人工规环治收益或者承担损失;
5 法律法规处中国证监会社的其他行为。
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
3 越级贵贵,不从事以下活动;
6 地域以或法规经营;
6 上域定基金合同或允赔协议;
6 放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 注中中国证监会报送的资料中弄虚作假;
6 拒绝,干扰,阻挠或产重影响中国证监会依法监管;
6 拒绝,干扰,阻挠或产重影响中国证监会依法监管;
6 矩定数字,滥用职权;

6 所忽职守,滥用职权。 7 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; 8 建反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

9)贬损同行,以抬高自己; (10)以不正当手段谋求业务发展;

5.基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

区基金经理承诺
 1依照有关法律法规和基金合同的规定,本省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、受雇人或任何第三者谋取利益;
 3.不世露在任职期间知题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)基金管理人内部控制制度
 1.内部控制制度
 1.内部控制制度

(七)基金管理人内部控制制度 1.内部控制制度概述 基金管理人为防范和化解经营运作中面临的风险,保证经营活动的合法合规和有效开展,制定了一系列组 织利制,管理方法,操作程序与控制措施,形成了公司完整的内部控制体系。该内部控制体系涵盖了内部会计控 制,风险管理控制和监察稽核制度等公司运营的各个方面,并通过相应的具体业务控制流程来严格实施。 (1)内部风险控制建随的原则 1)全面性原则,内部风险控制处须覆盖公司所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节; 2)独立性原则,公司设立独立的稽核监察部,稽核监察部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查; 3)相互制约原则;公司及各部门在内部组织结构的设计上形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系;

4)保持与业务发展的同等地位原则:公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上,内部风险

4 原持与业务发展的问号把LI原则;公司的及原来必须基本上的原本上的原则。 控制应与公司业务发展放在同等地位上; 5 定性和定量相结合原则,建立完备风险控制指标体系,使风险控制更具客观性和操作性。 6 内部会计控制制度 公司根据国家有关法律法规和财务会计准则的要求,建立了完善的内部会计控制制度,实现了职责分离和 岗位相互制约,确保会计核算的真实,准确、完整,并保证各基金会计核算和公司财务管理的相互独立,保护基金

○ MANACE TEACH MINING NAME OF THE METERS NAME OF

治理结构、合理的组织结构和分级授权、注重诚信并关注风险的道德观和经营理念、独立的监察稽核

取能等方面。
1 公司建立并完善了科学的治理结构。目前有独立董事4名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会、对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督。
2 连组织结构方面,公司设立的分管领导议事会议、总经理办公会议、投资决策委员会、风险控制委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任、既相互独立、又相互合作和制约、形成了合理的组织结构、决策设处和风险控制体系。
3 公司一贯坚持或信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念、形成了流信者本新抱修秘密理论会。也对

3/15日,以至可被同时3月59。 4/15日,以至时被同时3月59。 4/15日韓核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限,并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

2)控制的性质和范围

17/和英可控制 公司建立了完善的内部会计控制,保证基金核算和公司财务核算的独立性、全面性、真实性和及时性。 首先、公司根据国家有关法律法规、有关会计制度和准则、制定了完善的公司财务制度、基金会计制度以及 会计业务控制流程,做好基金业务和公司经营的核算工作,真实、完整、准确地记录和反映基金运作情况和公司 4,60。 其次,公司将基金会计和公司财务核算从人员上、空间上和业务活动上严格分开,保证两者相互独立,各基

、司还建立了严格的财务管理制度,执行严格的预算管理和财务费用审批制度,加强成本控制和监督

3 内部经制制度的实施 公司风险控制委员会首先从总体上制定了公司风险控制制度,对公司面临的主要风险进行辨识和评估.制 定了风险控制原则。在风险控制委员会总体方针指导下,各部门根据各自业务特点,对业务活动中存在的风险点 进行了揭示和梳理,有针对性地建立了详细的风险控制流程,并在实际业务中加以控制。

效遵循。
在确保现有内部挖制制度实施情况的基础上、公司会根据新业多开展和市场变化情况、对内部控制制度进行及时的更新和调整。以适应公司经营活动的变化。公司稽核监察都在对内部控制制度的执行情况进行监察稽核的基础上,也会重点对内部控制制度的有效性进行评估,并提出相应改进建议。
《 內部控制制度实施情况的报告
公司建立了有效的内部控制制度实施报告流程。各部门对于内部控制制度实施过程中出现的失效情况须及时向公司高级管理层和稽核监察部及时了解内部控制出现的问题并作出
宏参的理

妥善处理。 稽核监察部在对内部控制实施情况的监察中、对发现的问题均立即向公司高级管理层报告,并提出相应的 建议、对于重大问题,则通过督察长及时向公司董事长和中国证监会报告。同时稽核监察部定期出具独立的监察 榜核报告,直接报公司董事长和中国证监会。 3.基金管理人内部控制制度声明于 基金管理人民证以上关于内部控制制度的披露真实、准确,并承诺公司将根据市场变化和业务发展不断完 善内部控制制度,切实维护基金份额持有人的合法权益。 如 其全任务人

名称:中国银行股份有限公司 简称 中国银行" 住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日 注册资本:人民币或仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

医足代表尺:頁 的 基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字 [1998]24号

托管及投资者服务部总经理:李爱华 托管部门信息披露联系人:唐州徽

币》)评为2010年度房地产业 中国最佳商业银行",被英国 绘融时报》评为最佳私人银行奖,被The Asset(财资》)

中国银行开办各类基金往管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行目199年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管和「的监管要求、以控制和创造基金托管业务规处方生线、制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务推广则是国电场规划,是国电场通知。 保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节。在敏感都位建立了全全保密区和编造、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节。在敏感都位建立了全全保密区和制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时推确地披露相关信息。最近一年中,中国银行助基金托管业务和下及其条级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

近年管入的管理人选作基金进行监督的方法和程序根据中华人民共和国证券投资基金运入。在券投资基金运行企业分批分,由银行的基金行管理人并及时间发展。 中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管

	现金发售直销机构		
序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公司上海直 销柜台	地址:上海浦东世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		电话:021-38561759	传真:021-68775881
		客户服务专线:400-888-8688.021-38569000	
		联系人:蔡丽萍	网址:www.gtfund.com
2	国泰基金管理有限公司北京直 销柜台	地址:中国北京市西城区金融大街7号第5层	
		电话:010-66553078	传真:010-66553082
		联系人:王彬	

2、网下股票发售代理机构和网上现金发售代理机构 表演了成果文章(文章)的诗时与大观文章(文章) 具体名单详典基金份额发售公告。 基金管理人可根据有关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机

样及时公告。 C) 登记结算机构 名称:中国证券登记结算有限责任公司 地址:北京市西城区太平桥大街17号 法定代表人:金额 联系人:朱立元 电话: 010 59378839 传声: 010 59378839

传真: 010)59378907 仨) 灶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19楼 负责人:韩炯

传 真:021-31358600 联系人:黎明 经办律师:吕红、黎明

(四 庫) 基金财产的会计师事务所 名称: 普华永道中天会计师事务所有限公司 住所: 中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 块定代表人:杨绍信

传真: 021/23238800 联系人:单峰 经办注册会计师:汪棣、单峰

经办法部会计师,汪棣、单峰 六、基金的募集 (一 席金聚集的依据 本基金由基金管理人依照《基金法》、每作办法》、销售办法》、基金合同及其他有关规定,并经中国证监会证 F可 POII 1200号文格准聚集。 (二 席金类型和存线期限 1.基金类型: 段聚型 2.基金运作方式: 交易型开放式 3.基金的存线期间; 不定期 (一 评货售方式

仨 泼售方式 本基金通过基金管理人直销柜台和发售代理机构的网点向投资者公开发售,各发售代理机构的具体名单见

本基金加过基金官拜人里中把上中记了000年18 基金份额及借公告。 基金份额及借公告。 投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。 网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的 认购,因下现金认购是指投资者通过基金管理人以现金进行的认购;网下股票认购是指投资者通过基金管理人

指定的发售代理机构以股票进行的认购。 基金管理人和效值代理机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表其确实接收到认购申 请。认购的确认以登记连算机构或基金管理人的确认结果为准。 自基金份额发售之日起不超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

伍 灰 情可聚 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,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者。

V、除果初州 投资老应当在其全管理人及其指定发生代理机构办理其全发生业务的带业场所或按其全管理人 发生代理 据供的其他方式办理基金份额的认购。安售代理机构名单和联系方式见基金份额发售公告基金管理人可以根据情况增加或变更发售代理机构,并另行公告。

、投资者认购本基金时需具有证券账户,证券账户是指深圳证券交易所A股账户或深圳证券交易所证券投

总验账门"。 ① 尼有深圳A股账户或证券投资基金账户的投资者不必再办理开户手续。 ② 尚无深圳A股账户或证券投资基金账户的投资者,需在认购前持本人身份证明文件到中国证券登记结算 灵哲任公司歌州公司的开户代理机构办理深圳A股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳A股 中和证券投资基金账户的具体程序和功法、请到各开户阅点详细咨询看关规定。 2.账户使用注意事项: 1 加券投资基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需要参与网下股票认购或基金

的申购、赎回、则应开立和使用深圳A股账户。 仓)已购买过由国泰基金管理有限公司担任注册登记机构的基金的投资者,其拥有的国泰基金管理有限公 司开放式基金账户不能用于认购本基金。

(两贝用田)又贝有利豆,70两贝干如下农州小:				
认购份额 (M)	认购费率			
M<50万	0.8%			
50万≤M<100万	0.5%			
M≥100万	每笔1,000元			
t 夕答理 九理國下和今江歐地區 主託子弗達	以收的注购费用 安保化细机物力细网上和专注的 网工制			

基金管理人办理网下现金认购按照上表析。 票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。 (十)网上现金认购 1.认购时间详见基金份额发售公告。个人投资者和机构投资者在认购期内通过网上现金认购,随到随得 2.认购限额;网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限。

3、认购金额的计算 本基金认购金额的计算如下: 认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

认购金额=认购价格x认购份额x (1+佣金比率) 争认购金额=认购价格x认购份额 总认购份额=认购份额+认购金额产生的利息认购价格 现金认购款项在基金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。利息折算的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计人基金财产。利息和具体份额以中国证券登记结算有限责任公司的记 付出。 例:某投资者到某发售代理机构网点认购1,000份本基金,假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.8%,募集

例,某投资者到某发售代理机构网点认购1,000份本基金。假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.8%,募集司产生的利息为5.20元,则需准备的资金金额计算如下: 认购佣金—1.00×1,000×0.8%—8元 认购金额—1.00×1,000×0.9%—8元 认购金额—1.00×1,000—1,000元 总认购份额—1.00×1,000—1,000元 总认购份额—1.000+5.201,000—1,005 即投资者咨询过网上现金认购本基金1,000份,需准备1,008元资金,假定该笔认购金额产生利息为5.20元,投资者可得到1,005份本基金金价额。 4.认购申请:投资者在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金、办理认购手续。投资者可多相报、不可撤单、申报一签确认;认购资金即被冻结。

购期內通过阿下现金认购。随到随得。 2、认购限额:阿下现金认购以基金份额申请。投资者单笔认购须为1000份或其整数倍。投资者在募集期內可多次认购;认购期间单个投资者的累计认购规模沒有限制。

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率 认购金额=认购价格x认购份额x (1+认购费率)

争认购金额=认购价格x认购份额 总认购份额=认购份额+认购金额产生的利息认人购价格 理会认例参加的工程。 理会认例参加在赛集期间产生的和良料折算为基金份额归基金份额持有人所有.认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位.小数部分舍去,舍去部分计人基金财产。 例、某投资者到基金管理人直销柜台认购100,000份基金份额,假定认购金额产生的利息为10元,则需准备的

人购费用=1.00×100,000×0.8%=800元

认购费用=1.00×100、000×0.8%=800元
认购金额=1.00×100、000× 4+0.8% ≥100.800元
净让购金额=1.00×100、000=100.000元
净让购金额=1.00×100、000=100.000元

意认购价额=100、000+101.00=100.010份

期投资者者测过基金管理人认购本基金100、000份,需准备100.800元资金,假定该笔认购金额产生利息10
元则投资者可得到100.010 份本基金基金价额。
4.认购手续;投资者在认购本基金时,需按基金管理人的相关规定办理相关认购手续,并备足认购资金。网下现金认购申请撤交后不得撤销。
5.清算交收。环已测过基金管理是提交的网下现金认购申请,由基金管理人于*1日进行有效认购款项的清算交收。环边航财资金则人基金管理人提交的网下现金认购申请。由基金管理人于*1日进行有效认购款项的清算交收。环边购资金则人基金管理人所先开设的基金募集专户。

什二 网下股票认购

1.认购的资金则人基金管理人预先开设的基金募集专户。

1.认购的资金则人基金管理人所先开设的基金募集专户。

1.认购的资金则人基金管理人的现象,但公告,具体业多力理时间由指定发售代理机构确定。
2.认购限额;网下股票认购以单只股票股数申报,用以认购的股票必须是标的指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1000股,超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请,累计申报股数不及上限。

申请,革订甲极股数不设上限。 3.认购手续,投资者在认购本基金时,需按销售机构的规定,到销售网点办理认购手续,并备足认购股票。网 下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销,发售代理机构对投资者申报的股票进行冻结。

4.特殊情形
0) 已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。
0) 职公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情块定是否对个股认购规模进行限制,并在网下股票认购日前公告限制认购规模的个股名单。
6) 临时拒绝个股认购。对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股、基金管理人可公舍,全部或部分拒绝该股票的认购申报。 5、清算交收:投资者通过发售代理机构办理网下股票认购的,每日日终,发售代理机构将当日的股票认购数 。清算交近以近沒有测过及图门运机的外边间,形成形成的时,并可由于不及图门达的时间上间2025年2025级 据按投资者证券帐户产品竞奖给基金管理人。在阿下股票从购最后一日。基金管理人为步确认各成份股的有效 认购数量。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据,将投资者申请认购的股票过户至本基金组合证券认 映专户,完成整资后划人基金证券账户。基金管理人为投资者计算认购份额,并根据发售代理机构提供的数据 算投资者应以基金份额方式支付的认购佣金,并从投资者的认购份额中扣除,为发售代理机构增加相应的基金

。 登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。 6.认购份额的计算公式:

(i)代表投资者提交认购申请的第i只股票,n代表投资者提交的股票总只数。如投资者仅提交了1只股票的

青.则n=1。 ②TT与列下股票认购期最后一日。 ③)第只股票在T日的均价"由基金管理人根据深圳证券交易所的T日行情数据,以该股票的总成交金额除 总成交股数计算。以四舍五人的方法保留小数点后两位。若该股票在T日停牌或无成交,则以同样方法计算最 一个本具口的均价作为计量价格。

500人处处引手,化产品工作的方法体制的效应与可能。在2005年11日子种级元战文,则此间于方法计算和一个交易目的均价作为计算价格。 若某一股票在1日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息,送股 转增)。配股等权益变动,则 于投资者获得了相应的权益,基金管理人将按加下方式对该股票在T日的均价进行调整: (1除息:调整后价格=T日均价-4据股边股上例)。 (2)送股:调整后价格=T日均价-4据股边股上例)。

①对于经公告限制认购规模的个股,基金管理人可确认的认购数量上限为:

(2)这些: 词整石炉格=1日均的(+相联达度比例) ④送股且配股: 词整石价格。印均价+配股价/施股比例)(4)每股配股比例) ④送股且配股: 调整石价格。印均价+配股价/配股价/配股比例)(4)每股送股比例+每股配股比例) ⑤除息且送股: 调整石价格。印均价-每股现金股利成股息)(4)4每股送股比例) ⑥除息且还股: 调整石价格。 印均价-每股现金股利成股息)(9)4每股起股比例) ⑦除息、这股且配股: 调整石价格。 (7)日均价+和股价、配股比例—每股现金股利或股息)(9)4每股达股比例+每 ⑦除息、送股且配股: 调整石价格。 (7)日均价+和股价、配股比例—每股现金股利或股息)(4)年每股送股比例+每

4) 有效认购数量"是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。其中,

为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量, 为网上现金认购和网下现金认购的合计 为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股当日均价 和认购申报数量乘积, 为该股按均价计算的其在T日标的指数中的权重(认购期间如有标的指数调整公告,

则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及标的指数编制规则计算调整后的标的指数构成权重,并以其作 为计算依据), 为该股在T日的均价 如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限,则按照各投资者的认购申报

本基金募集期限届满具备下列条件的,或本基金在募集期限内符合下列条件,基金管理人提前结束募集的,

基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续: 基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续: 1.基金赛集份额总额不少于2亿份.基金募集金额。含网下股票认购所募集的股票市值)不少于2亿元人民币; 2.基金份额持有人的人数不少于200人。 □ 癌面的备案 基金募集期限结束,具备上述基金备案条件的,基金管理人应当自募集期限届满之日起10日内聘请法定验 构验贷,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。 巨 基金合同的生效

任。基金台同的主致。

(三 基金台同的主数。

(三 基金台同的主数。

(三 基金各中面的人之日起,基金各案手续办理完毕,基金台同生效。

(三 基金赛果大阪的处理方式

基金赛果斯限品商。

(四 基金赛果斯取品商。

(1) 以其固有财产派担因募集行为而产生的债务和费用。

(2) 在基金赛果期限品商。

(2) 在基金赛果期限品商。

(3) 有力。

(4) 有力。

(5) 有力。

(6) 有力。

(7) 有力。

(7) 有力。

(8) 有力。

(8) 有力。

(9) 有力。

基金合同生效后,基金管理人应逐步调整实际组合直至达到跟踪标的指数要求,此过程为基金建仓。基金建 仓期不超过3个月。 基金建仓期结束后,基金管理人可向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记。本基金进行基金份 额折算的,基金管理人确定基金份额折算日,并提前公告。 (二,基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人向登记结算机构申请办理,并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。折算 是並分類打算日基金管理人问意记给异凡似中请办理,并目意记得异凡似近行基金的确则变更意记。打算后的基金份额持算后,本基金的基金份额持算后,本基金的基金份额追额与基金份额持有人持有的基金份额持有人特有的基金份额持有人持有的基金份额持有人持有的基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后,基金份额持有人将按照扩展后的基金份额步有权利并承担义务。如果基金份额折算过程中发生不可抗力,基金管理人可延迟办理基金份额折算。 (早基金份额折算过程中发生不可抗力,基金管理人可延迟办理基金份额折算。 (早基金份额折算过程中发生不可抗力,基金管理人可延迟办理基金份额折算。

、基本近时他们并在时一711年公环, 的基金管理人确定基金份额所算口 fr日),并提前公告。 2 fr日收市后,基金管理人计算当日的基金资产净值X.折算前基金份额总额Y,并与基金托管人进行核对。 6 l假设于日标的指数收盘值为1,则T日的目标基金份额净值为14000.基金份额折算比例的计算公式为:

4)基金管理人根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算,折算后的基金份额计算至整数位。小数部分含去。含去部分计入基金财产,加总得到折算后的基金份额总额。基金管理人将折算后的各基金份额持有人持有的基金份额数据发送给查记结算机构,并将折算后的基金份额高级据发送给查金托管人。
6) 语记结算机构成据基金管理人是供的数据为基金份额持有人进行基金份额的变更登记。
6. 基金管理人基金托管人根据折算后的基金份额总额,进行相应的会计处理,计算T日折算后的基金份额备额,进行相应的会计处理,计算T日折算后的基金份额备额,进行相应的会计处理,计算T日折算后的基金份额备额,进行相应的会计处理,计算T日折算后的基金份额

券交易所申请上市:
1.基金募集金额 俭网下股票认购所募集的股票市值)不低于2亿元;

1.基金券米金基的 信何了及示价等的参索地级示印值 不能 1.2亿元 2.基金份额持有人不少于1000人; 3. 泰圳证券交易所证券投资基金上市规则)规定的其他条件。 基金份额上市前,基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在深圳证券交易所上市 的,基金管理人应在基金份额上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。 C. E. 基金份额任产交易 本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照 秦圳证券交易所交易规则》、秦圳证券交易所证券

投资基金上市规则》。《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务字施细则》等有关规定 E. 暂停上市交易基金份额上市交易后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:

金型的电压中交流压动。 1. 不再具备本部分第(一款规定的上市条件; 2. 违反法律、行政法规、中国证监会决定暂停其上市; 3. 严重违反废押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。

4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。 (四 終止上市交易 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。 若因上述1.4项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的,本基金将在履行适当 后由交易型开放式基金变更为同一标的指数的非上市的开放式指数基金。若届时本基金管理人已有以该指 心标的指数的指数基金,则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的 作为标的指数的基金。则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的 作为标的指数的基金。则本基金将本着维护投资者合法权益的原则,履行适当的程序后选取其他合适的

基金管理人任每一父易日并市即问涤圳证券父易所提供当日的甲购赎回清单,涤圳证券父易所在并市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据,计算并发布基金份额参考净值(OPV),供投资者交易、 申购、赎回基金份额时参考

申购赎回清单中的预估现金部分)最小申购、赎回单位对应的基金份额。 2、基金份额参考净值的计算以四舍五人的方法保留小数点后3位。若深圳证券交易所调整有关基金份额参 3. 基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式,并予以公告。

验者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方 %基础运动中研究的发出。 基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商,并予以公告。在相关条件许可的前提下,基金管可增加或调整申购赎回代理机构,并予以公告。

基金管理人可提指情况变更或增减基金申歇赎回代理券商,并予以公告。在相关条件许可的前提下,基金管理人可增加或调整申歇赎回代理机构,并予以公告。

(二 申歐与赎回办理的开放日及时间
本基金可在基金份额上市交易之前开始办理申购,但在基金份额申请上市期间基金可暂停办理申购。
本基金自基金合同建设日后不超过少月的时间内开始办理赎回。
基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前按照 信息披露办法,附有关规定在指定媒体公告。
申购和赎回的开放日为添别证券交易所交易日 盛金管理人暂停申购或赎回时除外,)投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放时间为上午9:30至11:30、7年1:00至3:00。
若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要,基金管理人可对申购,赎回开放日和具体业务办理时间进行调整并在指定媒体公告。

(三 申购与赎回的原则

在中期時,與回的原則

1.本基金采用份額申购和份额赎回的方式,即申购和赎回均以份额申请。

2.本基金采用份額申购和份额赎回的方式,即申购和赎回均以份额申请。

2.本基金的申购对价。规回对价包括组合证券,现金替代、现金差额及其他对价。

3.申购,赎回申请提交后不得撤销。

4.申购,赎回应益等,每期证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则的规定。
基金管理人可根据基金运作的实际情况。在不损害基金份额持有人实质利益、不违背交易所相关规则的情况下更改上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报
中間市路会会。 /四 /申购与赎回的程序

资者须按申购赎回代理券商规定的手续,在开放日的业务办理时间提出申购,赎回的申请。投资者申购本 基金时,须根据申购赎回清单备足申购对价,否则所提交的申购申请无效而不予成交。投资者提交赎回申请时, 必须持有足够的基金份额余额和现金,否则所提交的赎回的申请无效而不予成交。 2. 申购和赎回申请的确认 基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价,则申购申请失 如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金。或本基金投资组合内不具备 如投资者持有的符合要求的赎回对价,则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购,赎回的销售网点查询有关申

9輛认情况。
3. 用與兩眼回的清算交收与登记
本基金中映點回於看來之的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和登记结算机构的结算规则。
本基金中映點回近程中涉及的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所和登记结算机构的结算规则。
投资者1日申购、赎回成功后,第已结算机构在1日收市后为投资者为理组合证券的清算交收以及基金份
收金替代等的清算。在19-1日办理基金份额,现金替代的交收以及现金差额的清算。在19-1日办理基金份额。现金替代的交收以及基金差额的指数。在19-12日办理基金差额的 6. 并将结果发送给申映赎回代理券商。基金管理人和基金托管人、如果登记结算机构在清算交收时发现不能 6. 据线用处资的,即使据,但国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金 经信单业务实施细则的的关键定进行处理。
登记结章机构可在注键注册允许的范围内,对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。 任了申睦与理即的数数额积量

伍 申购与赎回的数额限制 投资者申购,赎回的基金份额需为最小申购,赎回单位的整数倍。本基金最小申购,赎回单位为100万份。基金管理人可根据市场情况、调整申购与赎回的数额限制,基金管理人必须在调整生效前依照。信息披露办法的有管理人可以重要的重要。 关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。 (六) 坤駒,赎回的对价、费用及其用途 1. 坤购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、投资者应收或应付的现金差额及其

他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时,基金管理人应交付给赎回人的组合证券,现金替代,投资者应收 或应付的现金差额及其他对价。申购对价,赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购,赎回的基金份额数额确

2、投资者在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金,其中包含证券 。所、登记结算机构等收取的相关费用。 3.申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情

日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券、现金替代、T日预估现金部分、T-1日

2、组合证券但为1744 组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应 证外合的、ULV)、ULVA、ANDASA 金替代相关内容 替代是指申购、赎回过程中,投资者按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的

一定数量的现金。 ① 现金替代分为3种类型:禁止现金替代标志为禁止")、可以现金替代标志为"允许"和必须现金替代 标志为 必须")。 禁止现金替代是指在申购,赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。 可以现金替代是指在申购基金份额时,允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代,但在赎回基金份 额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。 必须现金替代是指在申购,赎回基金份额时,该成份证券必须使用现金作为替代。

戶 河以现金替代①适用情形:可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买人的证券或基金管理 (以自用间》)以死金融。因此必少取定出,与种种原因十五双及自己在任中规则实人的证券或商业自建人认为可以适用的其他情况。 ②替代金额,对于可以现金替代的证券、替代金额的计算公式为: 替代金额,对于可以现金替代的证券,基金管理人需在证券恢复交易后买人,而实际买人价格加上相关交易费用后与 申期时的最新价格可能有所差异。为便于操作,基金管理人在申顺规时的最新价格可能有所差异。为使于操作,基金管理人在申顺规时的最新价格可能有所差异。为使于操作,基金管理人在中顺顺也需求中现先确定现金替代保证金单、并据 地收取替代金额。如果积少取的金额而于基金购人该部分证券的实际成本,则基金管理人将自投资者收取欠缺的差额。 须含基件金额价和理识。

T日,基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并据此收取替代金额。在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日 衛称为T+2日 内,基金管理人将以收到的替代金额买人被替代的部分证券。T+2日日 条,若已购人全部被替代的证券,则以替代金额与被特化率转变率的处。成本 包起买人价格与交册 n的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。若未能购人全部被替代的证券,则以替代金额与所购人的部分被替代证券实购购人成本加上按照T+2日收盘价计算约末购人的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。 特例情况。若自T日起,深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日,则以替代金额与所购人的部分被替代证券实所购人成本加上按照最近一次收盘价计算的未购人的部分被替代证券价值的差额,确定基金应退还投资者或投资者应补之的款项。 若现金替代日 行日 后至T+2日 倍在特例情况下,则为T 日起第20个交易日 期间被替代的证券发生除息,送股 转增,和股股以及由于股权分置改革等发生的权益变动,则进行相应调整。
T+2日后第1个市场交易日 偌在特例情况下,则为T日起第21个交易日)基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给意记结算机构。登记结算机构为理现金替代多退入补资金的之,并22日后第2个工作日 倍在特例情况下,则为T日起第2个工作日第2个工作日,各过结算机构为理现金替代多退入补资金的资效。 T日,基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并据此收取替代金额。在T日后被替代的成份证

说明:假设当天可以现金替代的股票只数为n。 (B) 经项现金替代 (B) 经项现金替代 (D)适用情形:必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除,或基金管理人出于保护持有人利益 原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。 (2)替代金额、对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金,即 固定替代金额"。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的T-1日收盘价。

4.1项目光显射力 [1天] 24 预估现金部分是指由基金管理人计算并在TF目由咖啡同清单中公布的当日现金差额的预估值,预估现金部

T-1日最小申购、赎回单位的基金资产净值"需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负

T-I 日最小申购,赎回单位的基金资产争值"需扣減相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。
5.现金差额相关内容
T日现金差额在T+I 目的申购赎回清单中公告,其计算公式为;
T日现金差额在T+I 目的申购赎回常单中公告,其计算公式为;
T日现金差额在T+I B 小申购,赎回单位的基金资产净值。申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和。申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和。
T日投资者申购,赎回基金份额时,需按T+I 口公告的T日现金差额进行资金的清算之收。
T日投资者申购,赎回基金份额时,需按T+I 口公告的T日现金差额为正数、则投资者应根据其申购的基金份额较相应的现金,如现金差额为负数,则投资者将根据其申购的基金份额较得相应的现金,在基金份额特有人赎回时,如现金差额为正数、则基金份额对有机度的现金。如现金差额为直数,则基金份额持有人应根据其赎回的基金份额获得相应的现金,如现金差额为企数,则基金份额持有人应根据其赎回的基金份额获得相应的现金,如现金差额为负数,则基金份额持有人应根据其赎回的基金份额获得相应的现金,如现金差额为负数,则基金份额持有人应根据其赎回的基金份额支行相应的现金。
6.申购赎回清单的格式

基本信息 最新公告日期 基金名称 2012-01-06 中小成长 国泰基金管理有限公司 基金管理公司名称 基金管理公司名称 399602 现金差额(单位:元) 765.00 最小电购赎回单位资产净值 单位:元)751,000.00 基金份额净值 (单位:元)0.751

新和成 002008 1700 21% 002012 世荣兆业 002022 900 21% 002024 002029 七匹狼 300 21% 久联发展 002038 21% 002039 002041 登海种业 21% 21% 002065 东华软件 500 21% 獐子岛 1300 21% 300 002081 金螳螂 400 21% 002093 国脉科技 600 21% 600 21% 天康生物 002100 200 21% 莱宝高科 紫鑫药业 500 002123 荣信股份 800 21% 002124 露天煤业 200 002138 21% 002139 200 21% 002142 2600 荣盛发展 石基信息 21% 002183 怡亚通 002202 金风科技 002218 21% 002226 21% 002242 600 002244 800 21% 21% 002250 联化科技 002271 21% 002285 世联地产 200 21% 200 002304 002310 002311 海大集团 300 21% 002340 002353 21% 002362 002375 亚夏股份 002399 海普瑞 002408 21%

广联达

爱施德

雏鹰农牧

超日太阳

002410

002437

002475

002482

002493

002506

002563

002588

1 因不可抗力导致基金无法正常运作或无法接受申购,赎回申请;2 因特殊原因 包括但不限于深圳证券交易所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市),导致基金管理

200

100

法计算当日基金资产净值; (3)深圳证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购或赎回,或者指数编制单 位、深圳证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见 可控制的情形,包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等;

21%

21%

21%

21%

可於制即情形。包括但不限于系统双摩。网络双摩、通川双摩、电刀双摩、双琚馆戾等; 4 次生基金与同规定的暂序基金资产估值情况。 6 法律法规、深圳证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。 在发生暂停事购或赎回的情形之一时,本基金的申顺和赎回可能同时暂停。 发生上述情形之一旦基金管理人决定暂停申购或赎回的,基金管理人应当在当日报中国证监会备案,并及告。在暂停申购或赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购,赎回业务的办理并予以公告。 行》像不申助或赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购,赎回业务的办理并予以公告。 行》像不申助与证单的思 保合 11% 35% [2006] "我会管理人可开放集合申购,即允许多个投资者集合其持有的组合证券,共同构成最小申购,正成其整数倍,进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下,基金管理人有权制定集合申购业务的

。 件允许时,基金管理人也可采取其他合理的申购、赎回方式,并于新的申购、赎回方式开始执行前予以公告。 登记结算机构可依据其业务规则,受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务,并收取一定的手续费用。 十二、基金认购,申购和赎回等业务的代理