（上接B9版）

21）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22）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；
23）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； 24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集的认购款项、股票连同认购款项的银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
26）建立并保存基金份额持有人名册；
27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（五）基金管理人承诺
1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》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《中华人民共和国证券法》行为的发生；
2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》、《运作办法》、《销售办法》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）将基金用于下列投资或者活动：
(i)承销证券；
(ii)向他人贷款或者提供担保；
(iii)从事承担无限责任的投资；
(iv)买卖其他基金份额，但是法律法规或国务院另有规定的除外；
(v)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；
(vi)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；
(vii)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；
(viii)依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动；
(ix)证券法规规定禁止从事的其他行为。
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；
（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。
4、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、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。

（六）基金管理人的风险管理和内部控制体系
1、风险管理理念与目标
（1）确保合法合规经营；
（2）防范和化解风险；
（3）提高经营效率；
（4）保护投资人和股东的合法权益。
2、风险管理措施
（1）建立健全公司组织架构；
（2）树立监察稽核功能的权威性和独立性；
（3）加强内控培训，培养全体员工的风险管理意识和监察文化；
（4）制定员工行为规范和纪律程序；
（5）建立岗位分离制度；
（6）建立危机处理和灾难恢复计划。
3、风险管理和内部控制的原则
（1）全面性原则：公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；
（2）独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金财产、自有资产、其他资产的运作应当分离；
（3）相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要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）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；
（5）防火墙原则：基金财产、公司自有资产、其他资产的运作应当严格分开并独立核算。
4、内部控制体系
I、内部控制的组织架构
（i）董事会审计与风险控制委员会：负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。该委员会主要职责是：审议并批准公司内部控制制度和政策并检查其实施情况；监督公司内部审计制度的实施；向董事会提名外部审计机构；负责内部审计和外部审计之间的协调；审议公司的关联交易；对公司的风险及管理状况及风险管理能力及水平进行评价，提出完善风险管理和内部制度的意见，制定公司日常经营、拟募集基金及运用基金资产进行投资的风险控制指标和监督制度，并不定期对风险控制情况进行检查和监督，形成风险评估报告和建议，在例行董事会会议上提出公司上半个年度风险控制工作总结报告；监督和指导经理层所设立的风险管理委员会的工作及董事会赋予的其他职责。
（ii）风险管理委员会：是公司日常经营中整体风险控制的决策机构，该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构，负责公司整体运作风险的评估和控制，由总经理、副总经理、督察长，以及其他相关部门负责人或相关人员组成，其主要职责是：评估公司各机构、部门制度本身隐含的风险，以及这些制度在执行过程中显现的问题，并负责审定风险控制政策和策略；审议基金财产风险状况分析报告，基于风险与回报对业务策略提出质疑，需要时指导业务方向；审定公司的业务授权方案；负责协调处理突发性重大事件；负责界定业务风险损失责任人的责任；审议公司各项风险与内控状况的评价报告；需要风险管理委员会审议、决策的其他重大风险管理事项。
（iii）投资决策委员会：是公司投资领域的最高决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定公司投资的重大问题。投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、投资总监、投资研究部研究总监、投资研究部量化及ETF投资总监、固定收益部投资总监、国际投资部投资总监等组成，其主要职责包括：依照基金合同、资产管理合同的规定，确定各基金、特定客户资产管理的投资方针及投资方向；审定基金资产、特定客户资产管理的配置方案，包括基金资产、特定客户资产管理在股票、债券、现金之间的配置比例；制定基金、特定客户资产管理投资授权方案；对超出投资负责人权限的投资项目做出决定；考核包括基金经理、投资经理在内的投资团队的工作绩效；需要投资决策委员会决定的其它重大投资事项。
（iv）督察长：督察长制度是基金管理人特有的制度。督察长负责组织指导公司的监察稽核工作；可列席公司任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核；每月独立出具稽核报告，报送中国证监会和董事长。
（v）法律、监察稽核部：公司设立法律、监察稽核部，开展公司的监察稽核工作，并保证其工作的独立性和权威性，充分发挥其职能作用。法律、监察稽核部有权对公司各类规章制度及内部风险控制制度的完备性、合理性、有效性进行检查并提出相应意见和建议，并将意见和建议上报公司总经理、督察长和风险管理委员会进行讨论。法律、监察稽核部协助对全公司员工进行相关法律、法规、规章制度培训，回答公司各部门提出的法律咨询，并对公司出现的法律纠纷提出解决方案，同时组织各部门对公司管理上存在的风险隐患或出现的风险问题进行讨论、研究，提出解决方案，提交风险管理委员会、投资决策委员会或总经理办公会等进行审核、讨论，并监督整改。
II、内部控制的原则
公司的内部控制遵循以下原则：
(1) 健全性原则：内部风险控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程和业务环节，包括各项业务的决策、执行、监督、反馈及日常经营运行；
(2) 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；
(3) 独立性原则：公司在设立部门和岗位时要确保各部门和岗位在职能上保持相对独立并承担各自的风险控制职责，基金资产、受托资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。此外，公司独立的督察长和法律监察稽核部，督察长和法律监察稽核部在对公司内部控制制度的完善情况和执行情况，对公司内部控制状况的检查监督上具有高度的独立性和权威性；
(4) 相互制约原则：公司在制度安排、组织机构的设计、部门和岗位设置上形成权责分明、相互制约的机制，从而建立起不同岗位之间的制衡体系，消除内部风险控制中的盲点，强化督察长和法律监察稽核部的监督检查功能；
(5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，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。
公司制订内部控制制度遵循以下原则：
（1）合法合规性原则：公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；
（2）全面性原则：内部控制制度涵盖公司管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；
（3）审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；
（4）适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。
III、内部风险控制措施
建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系和完善的内部控制制度。公司成立以来，根据中国证监会的要求，借鉴外方股东的经验，建立了科学合理的层次分明的内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。通过不断地对内控制度进行修改，公司已初步形成了较为完善的内部控制制度。
建立健全了管理制度和业务规章：公司建立了包括风险管理制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作程序在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制。
建立了岗位分离、相互制衡的内控机制：公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易，交易与清算，公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了在岗位设置上减少和防范操作风险的分离制度。
建立健全了岗位责任制：公司通过建立健全岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任。
构建风险管理系统：公司通过建立风险评估、预警、报告和控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理，使管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。建立自动化监督控制系统：公司启用了电子化投资、交易系统，对投资比例进行限制，在"股票黑名单"、交叉交易以及防范操纵市场等方面进行电子化自动控制，将有效地防止合规性运作风险和操守风险。
使用数量化的风险管理手段：采用数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能减少损失。
提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工具有较高的职业水准，从培养职业化专业理财队伍角度控制职业化问题带来的风险。
5、基金管理人关于内部合规控制声明书
本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况
1、基本情况
名称：中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层
法定代表人：蒋超良
成立时间：2009年1月15日
注册资本：32,479,411.7万元人民币
联系电话：010-63201510
联系人：李芳菲
中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际，功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造"伴你成长"服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。
中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届"'金牌理财'TOP10颁奖盛典"中成绩突出，获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。
中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。
2、主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。
3、基金托管业务经营情况
截至2013年2月6日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共148只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、中证500交易型开放式指数证券投资基金。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明
1、内部控制目标
严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，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。
2、内部控制组织结构
风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。
3、内部控制制度及措施
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；业务管理实行严格的复核、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
基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。
当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：
1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
3、书面报告。对投资比例严重超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、网下现金发售和网下股票发售直销机构
直销机构：景顺长城基金管理有限公司
注册（办公）地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人：赵如冰
批准设立文号：证监基金字［2003］76号
电 话：（0755）82370388-1661
传 真：（0755）22381325
联系人：严丽娟
2、网下股票发售代理机构
详见基金份额发售公告。
3、网上现金发售代理机构
投资人可直接通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见基金份额发售公告。
本基金募集期结束前获得基金代销资格的深交所会员可通过深交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。
基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并另行公告。
（二）登记结算机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
联系人：崔巍
联系电话：010-59378856
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称：上海市通力律师事务所
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
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：吕红、黎明
联系人：黎明
（四）审计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：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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：杨绍信
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办会计师：单峰、王灵

六、基金的募集

（一）基金募集的依据
本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他法律法规的有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2012年11月19日证监许可【2012】1542号文核准募集。
（二）基金类型
股票型指数基金
（三）基金的运作方式
交易型、开放式
（四）标的指数
沪深300等权重指数
（五）基金存续期间
不定期
（六）基金份额初始面值
本基金基金份额的发售面值为人民币1.00元
（七）基金最低募集份额总额和最低募集金额
本基金的募集份额总额应不少于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。
（八）募集方式
投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。
网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。
网下现金认购是指投资人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人通过基金管理人或其指定的发售代理机构以股票进行的认购。
基金投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。
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。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。
（九）募集场所
投资人应当在基金管理人或其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。
基金管理人、发售代理机构办理可接受的认购方式等基金发售业务的具体情况和联系方式，请参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。
（十）募集期限
本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。
本基金将自2013年3月25日起至2013年4月26日进行发售。本基金的发售方式有三种：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购。
网上现金认购的日期为2013年3月25日起至2013年4月26日，如证券交易所对网上现金认购时间做出调整，我司将做出相应调整并及时公告；
网下现金认购的日期为2013年3月25日起至2013年4月26日；
网下股票认购的日期为2013年4月22日起至2013年4月26日。
基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间（包括一种或多种发售方式的发售时间），并及时公告。投资人认购应提交的文件和办理的手续详见基金份额发售公告。
（十一）募集对象
中国境内的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者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。
（十二）认购开户
1、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所A股账户（以下简称"深圳A股账户"）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称"深圳证券投资基金账户"）。
(1)已有深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。
(2)尚无深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资人，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳A股账户和深圳证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。
2、账户使用注意事项
(1)如投资人需要参与网下现金认购或网上现金认购，应使用深圳A股账户或深圳证券投资基金账户；深圳证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。
(2) 如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳A股账户。
(3)如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，除了需持有深圳A股账户或深圳证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所A股账户（以下简称"上海A股账户"），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人用以认购基金份额的深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的托管证券公司与上海A股账户指定交易的证券公司应为同一发售代理机构。
(4)如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，应同时持有并使用深圳A股账户与上海A股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商，否则无法办理本基金的申购和赎回。
(5)已通过二级市场购买过景顺长城鼎益基金（LOF）、景顺长城资源垄断基金（LOF）的投资人，其所持有的深圳A股账户或证券投资基金账户可用于认购本基金。
(6) 已购买过由景顺长城基金管理有限公司担任登记结算机构的基金的投资人，其所持有的景顺长城基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。
（十三）认购费用
本基金的认购采用份额认购的原则。
基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照下表费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下股票认购时，可参照下表费率结构收取一定的佣金。

认购份额	认购费率
50万份以下	1.0%
50万份以上(含50万份)－100万份以下	0.5%
100万份以上(含100万份)	每笔1000元

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、登记结算等基金募集期间发生的各项费用。
（十四）网上现金认购
1、认购时间：网上现金认购的日期为2013年3月25日起至2013年4月26日。
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1000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。
3、认购申请：认购费用由发售代理机构在投资人认购时收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定备足认购资金，办理认购手续。投资人可多次提出认购申请，认购一经受理不可撤销，认购资金即被冻结。
4、认购金额和利息折算的份额的计算
本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：
认购金额＝认购价格 ×认购份额×(1＋佣金比率)
认购佣金＝认购价格 ×认购份额×佣金比率
利息折算的份额＝利息/认购价格
网上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。网上现金认购的利息和具体份额以登记结算机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。
例：某投资人通过发售代理机构采用网上现金方式认购本基金100,000份，假设该发售代理机构确认的佣金比率为1%，则需准备的资金数额计算如下：
认购金额＝1.00×100,000×（1＋1%）＝101,000元
认购佣金＝1.00×100,000×1%＝1,000元
又假设该笔资金在募集期间产生了10.8元的利息，则利息折算的份额＝10.8／1.00＝10 份（保留至整数位）
即，若该投资人通过发售代理机构认购本基金份额100,000 份，则需缴纳认购金额101,000 元，其中认购佣金1,000 元，并可获得利息折算的份额10份。
（十五）网下现金认购
1、认购时间：网下现金认购的日期为2013年3月25日起至2013年4月26日。
2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。
3、认购手续：认购费用由基金管理人在投资人认购时收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。投资人在认购本基金时，需按基金管理人的规定办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请一经受理不得撤销。
4、认购金额和利息折算的份额
本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：
认购金额＝认购价格 ×认购份额×（1＋认购费率）
认购费用＝认购价格 ×认购份额×认购费率
利息折算的份额＝利息/认购价格
网下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。网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。
例：某投资人通过基金管理人认购本基金500,000份，认购费率为0.5%，则该投资人的认购金额为：
认购金额＝1.00×500,000×（1+0.5%）=502,500 元
认购费用＝1.00×500,000×0.5%＝2,500 元
又假设该笔资金在募集期间产生了55.8元的利息，则利息折算的份额＝55.8／1.00＝55 份（保留至整数位）
即，若该投资人通过基金管理人认购本基金500,000份，则需缴纳认购金额502,500元，其中认购费用2,500元，并可获得利息折算的份额55 份。
5、T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人确认后，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。
（十六）网下股票认购
1、认购时间：网下股票认购的日期为2013年4月22日起至2013年4月26日。
2、认购限额：
以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是沪深300等权重指数成份股和已公告的备选成份股（基金管理人公告限制的除外）。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。投资人可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。
3、认购手续：
认购费用由发售代理机构或基金管理人在投资人认购时收取。投资人认购本基金时，需按销售机构的规定，到基金销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请一经受理不得撤销，投资人申报的股票予以冻结。投资人的认购股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日（不含）的冻结期间所产生的权益归投资人所有。
4、特别提示：投资人应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。
5、特殊情形
(1)已公告的将被调出沪深300等权重指数的成份股不得用于认购本基金。
(2)限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少3日公告限制认购规模的个股名单。
(3)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，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。
6、清算交收：T日日终(T日为本基金发售期最后一日)，发售代理机构将股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。T+1日起，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购股票，并将深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。基金管理人为投资人计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的佣金，从投资人的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额，登记结算机构根据基金管理人提供的有效认购申报股票数据，将上海和深圳的股票分别过户至本基金在上海、深圳开立的证券账户。基金合同生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资人净认购份额明细数据进行投资人认购份额的初始登记。
在基金管理人或发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用。
7、认购份额的计算公式：
投资人的认购份额＝Σ(第i只股票在T日的均价×有效认购数量)/1.00
其中，
(1)i代表投资人提交认购申请的第i只股票，如投资人仅提交了1只股票的申请，则i＝1,i≤300。
(2)"第i只股票在T日的均价"由基金管理人根据深圳证券交易所及上海证券交易所的T日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入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近一个交易日的均价作为计算价格。
若某一股票在T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，则由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在T日的均价进行调整：
①除息：调整后价格＝T日均价-每股现金股利或股息
②送股：调整后价格＝T日均价/(1＋每股送股比例)
③配股：调整后价格＝(T日均价＋配股价×配股比例)/(1＋每股配股比例)
④送股且配股：调整后价格＝(T日均价＋配股价×配股比例)/(1＋每股送股比例＋每股配股比例)
⑤除息且送股：调整后价格＝（T日均价-每股现金股利或股息）/（1＋每股送股比例）
⑥除息且配股：调整后价格＝（T日均价＋配股价×配股比例-每股现金股利或股息）/（1＋每股配股比例）
⑦除息、送股且配股：调整后价格＝(T日均价＋配股价×配股比例-每股现金股利或股息)/(1＋每股送股比例＋每股配股比例)
(3)"有效认购数量"是指由基金管理人确认的并由登记结算机构完成清算交收的股票股数。其中，
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：
公式：

q^{max}：限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量；
Cash: 网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额；
p_j、q_j：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；
w_i：该股按均价计算的其在网下股票认购日沪深300等权重指数中的权重，(认购期间如有沪深300等权重指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及沪深300等权重指数编制规则计算调整后的沪深300等权重指数成份权重，并以其作为计算依据)；
p_i：该股在网下股票认购日的均价。
如果投资人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，则根据认购日期的先后按照先到先得的方式确认。如同一天申报的个股认购数量全部确认将突破基金管理人可确认上限的，则按比例分配确认。
②若某一股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法冻结或执行，则基金管理人将根据登记结算机构确认的实际过户数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。??
8、认购费用（佣金）
?如投资人以现金支付认购费用/佣金，则其可得的基金份额和需支付的认购费用/佣金为：
认购份额＝ (第i只股票认购末日均价×有效认购数量)/认购价格
认购费用/佣金=认购份额/（1+认购费率）×认购费率×认购价格
如投资人以基金份额方式交纳认购费用/佣金，则其可得的基金份额和需支付的认购费用/佣金为：
认购份额＝ (第i只股票认购末日均价×有效认购数量)/认购价格
认购费用/佣金=认购份额/（1+认购费率）×认购费率
净认购份额=认购份额－认购费用/佣金
投资人网下股票认购时缴交的认购费用/佣金的计算保留到整数位，小数点后部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。
例：某投资人通过基金管理人以股票A 2,000股及股票B 1,000股认购本基金，假定认购末日股票A的均价为3.72元/股，股票B的均价为35.50元/股，对应认购费率为1.0%，则该投资人应当支付的认购费用/佣金以及净认购份额为：
① 以现金支付认购费用/佣金的情况下：
认购份额=（3.72×2,000+35.5×1,000）/1.00=42,940份
认购费用/佣金=42,940/（1+1%）×1%×1.00=425元（保留至整数位）
即，若该投资人通过基金管理人以上述股票认购本基金，则需缴纳认购费用/佣金425元，方可获得本基金份额42,940份。
② 以基金份额方式支付认购费用/佣金的情况下：
认购份额=（3.72×2,000+35.5×1,000）/1.00=42,940份
认购费用/佣金=42,940/（1+1%）×1%=425份（保留至整数位）
净认购份额=42,940－425=42,515份
即，若该投资人通过基金管理人以上述股票认购本基金，则需从认购份额中扣除425份用以支付认购费用/佣金，方可获得本基金份额42,515份。
注：代销机构对认购费用/佣金另有计算方式的，从其规定。
（十七）募集资金利息及募集股票权益的处理
认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额，归投资人所有。
基金网下股票认购所募集的股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日（不含）的冻结期间所产生的孳息归认购投资人本人所有。
（十八）募集期间的资金、股票与费用
基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。基金网下股票认购所募集的认购股票予以冻结。基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件
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2亿元人民币（含网下股票认购所募集的股票市值）且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售（包括一种或多种认购方式），并在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，向中国证监会办理基金备案手续。
基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人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。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购所募集的股票予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。
（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式
如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：
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日内返还投资人已缴纳的认购款项、股票及认购款项的银行同期存款利息，登记结算机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作。
3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售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产规模
基金合同生效后，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个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。
法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额折算与变更登记

基金合同生效后，为提高交易便利，本基金可以进行份额折算。
（一）基金份额折算的时间
基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。
（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。
基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对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折算后的基金份额享有权利并承担义务。
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。
（三）基金份额折算的方法
基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

九、基金份额的上市交易

(一)基金份额的上市
基金合同生效后，具备下列条件的，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基金份额上市：
1、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不低于2 亿元人民币；
2、基金份额持有人不少于1,000 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的3 个工作日前发布基金份额上市交易公告书。
(二)基金份额的交易
本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易，暂停或终止上市交易，应遵照《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》及其他有关规定。
(三)基金份额参考净值的计算与公告
基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司在相关证券交易所开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基金份额参考净值（IOPV）并由深圳证券交易所在交易时间内发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。
1、基金份额参考净值计算公式为：
基金份额参考净值＝(申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额＋申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和＋申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和＋申购赎回清单中的预估现金差额)/最小申购赎回单位对应的基金份额。
2、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。

十、基金份额的申购、赎回和非交易过户

(一)申购和赎回场所
投资人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式办理基金的申购和赎回。
基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，并予以公告。
投资人可以通过基金管理人直销中心办理基金申购、赎回业务，具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。
(二)申购和赎回的开放日及时间
1、开放日及开放时间
基金投资人办理基金份额的申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所及上海证券交易所的交易日，具体办理时间为相关证券交易所的正常交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
基金合同生效后，若出现相关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，并应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告；若证券交易场所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市，基金管理人在次日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
2、申购与赎回的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3个月开始办理申购、赎回。本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回；具体申购、赎回业务办理时间在申购、赎回开始公告中规定。
基金管理人应在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(三)申购和赎回的数额限制
投资人申购、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200万份，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》的有关规定指定媒体公告并报中国证监会备案。
(四)申购和赎回的原则
1、申购、赎回应遵守《登记结算业务实施细则》及其他相关规定。
2、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
3、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
4、申购、赎回申请提交后不得撤销。
基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
(五)申购和赎回的程序
1、申购和赎回申请的提出
(1)投资人办理申购或赎回业务，应同时持有并使用深圳A股账户和上海A股账户，并保证该两个账户的证件号码和名称属于同一投资人所有；
(2)投资人的相关证券和基金份额应当托管在申购赎回代理券商，且投资人深圳A股账户的托管单元与上海A股账户指定交易的交易单元为同一申购赎回代理券商；
(3)投资人通过该申购赎回代理券商申报申购、赎回业务。
基金投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
投资人在申购本基金时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额和现金。
2、申购和赎回申请的确认
基金投资人申购、赎回申请在T+1日进行确认。
对于投资人提交的申购申请，申购赎回代理券商根据投资人提交的申购申请以及T日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资人账户内的组合证券、现金替代款和预估现金差额，登记结算机构在完成T日全部登记结算业务处理后，对申请申购的组合证券予以冻结，并将处理结果发送给基金管理人。T+1日，基金管理人对冻结情况符合要求的申购申请予以确认。如冻结情况不符合要求，则申购申请失败。
对于投资人提交的赎回申请，申购赎回代理券商根据投资人提交的赎回申请以及T日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资人账户内的基金份额、预估现金差额，登记结算机构在完成T日全部登记结算业务处理后，对申请赎回的基金份额予以冻结，并将处理结果发送给基金管理人。T+1日，基金管理人根据冻结情况对投资人的赎回申请予以确认。如投资人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足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。
投资人可在T+2日及之后通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资人应及时查询有关申请的确认情况。
3、申购和赎回的清算交收与登记
本基金申购赎回过程中涉及的组合证券和基金份额交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规则。
T+1日，登记结算机构根据基金管理人对申购、赎回申请的确认信息，为投资人办理组合证券、基金份额的清算交收，并将结果发送给相关证券交易所、申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。通常情况下，投资人T日申购所得的基金份额、赎回所得的组合证券在T+2日可用。现金替代和现金差额由基金管理人与申购赎回代理券商于T+1日进行清算，T+2日进行交收，登记结算机构可以依据相关规则对此提供代收代付服务并完成交收。对于确认失败的申请，登记结算机构将对冻结的组合证券和基金份额予以解冻，申购赎回代理券商将对冻结的资金予以解冻。
如果登记结算机构在清算交收时发生不能正常履约的其他情形，则依据《登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。
投资人应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额、现金替代和现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资人追偿并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。
若投资人用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有权机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记结算机构依法进行相应处置；如该情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资人进行赔偿。
4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所和登记结算机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。
(六)申购、赎回的对价、费用
1、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
2、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通知深圳证券交易所及登记结算机构，并在深圳证券交易所及基金管理人网站公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。
3、投资人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申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。
(七)申购赎回清单的内容与格式
1、申购赎回清单的内容
T日申购赎回清单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日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。
2、组合证券
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的各成份证券名称、证券代码及数量。
3、现金替代相关内容
现金替代是指申购、赎回过程中，投资人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。
采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资人的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，以保护基金份额持有人利益为出发点，并进行及时充分的信息披露。
（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。
（2)可以现金替代
①适用情形：可以现金替代的证券一般是因停牌等原因导致投资人无法在申购时买入的证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。
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＝替代证券数量×该证券经除权调整的T-1日收盘价×(1＋现金替代保证金率)
对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。
③替代金额的处理程序
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，并据此在T+2日收取替代金额。
在T+1日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T＋3日)内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。
T＋3日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本(包括买入价格与交易费用)的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T＋3日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。
特例情况：若自T+1日起，相关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入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。
T＋3日后第1个工作日(若在特例情况下，则为T+1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申购赎回代理券商和基金托管人，现金替代多退少补资金的清算和交收在T＋3日后2个工作日(若在特例情况下，则为T+1日起第22个交易日)内完成，登记结算机构对此提供代收代付服务。
④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为n。
(3)必须现金替代
①适用情形：必须现金替代的证券一般是因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、预估现金差额相关内容
预估现金差额是指由基金管理人估计并在T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。
预估现金差额的计算公式为：
T 日预估现金差额＝T-1 日最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 日经除权调整后的开盘参考价乘积之和＋申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T 日经除权调整后的开盘参考价乘积之和)
其中，T 日经除权调整后的开盘参考价主要根据中证指数公司所提供的标的指数成份证券调整后开盘参考价确定。另外，若T 日为基金分红除息日，则计算公式中的"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。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。
5、现金差额相关内容
T 日现金差额在T+1 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：
T 日现金差额＝T 日最小申购赎回单位的资产净值- (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 日收盘价乘积之和＋ 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T 日收盘价乘积之和)
T 日投资人申购、赎回基金份额时，需按T+1 日公告的T 日现金差额进行资金的清算交收。
现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时，如现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将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，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。
6、申购赎回清单的格式
T日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息					
最新公告日期：					
基金名称：					
基金管理公司名称：					
基金代码：					
拟合指数代码：					
T-1日信息内容					
现金差额：					
最小申购、赎回单位资产净值：					
基金份额净值：					
T日信息内容					
预估现金差额：					
可以现金替代比例上限：					
是否需要公布IOPV：					
最小申购、赎回单位：					
最小申购赎回单位现金红利：					
申购赎回组合证券只数：					
是否开放申购：					
是否开放赎回：					
是否开放保证金申购：					
组合信息内容					
证券代码	证券简称	股票数量	现金替代标志	现金替代保证金率	固定替代金额
000001	平安银行		允许	21.00%	
000002	万科A		允许	21.00%	
000009	中国宝安		允许	21.00%	
000012	南 玻A		允许	21.00%	
000024	招商地产		允许	21.00%	
000039	中集集团		允许	21.00%	
000046	泛海建设		允许	21.00%	
000059	辽通化工		允许	21.00%	
000060	中金岭南		允许	21.00%	
000061	农 产 品		允许	21.00%	
000063	中兴通讯		允许	21.00%	
000069	华侨城A		允许	21.00%	
000100	TCL集团		允许	21.00%	
000157	中联重科		允许	21.00%	
000338	潍柴动力		允许	21.00%	
000401	冀东水泥		允许	21.00%	
000402	金 融 街		允许	21.00%	
000422	湖北宜化		允许	21.00%	
000423	东阿阿胶		允许	21.00%	
000425	徐工机械		允许	21.00%	
000527	美的电器		允许	21.00%	
000528	柳工		允许	21.00%	
000538	云南白药		允许	21.00%	
000559	万向钱潮		允许	21.00%	
000562	宏源证券		允许	21.00%	
000568	泸州老窖		允许	21.00%	
000581	威孚高科		允许	21.00%	
000596	古井贡酒		允许	21.00%	
000623	吉林敖东		允许	21.00%	
000625	长安汽车		允许	21.00%	
000629	攀钢钒钛		允许	21.00%	
000630	铜陵有色		允许	21.00%	
000651	格力电器		允许	21.00%	
000686	东北证券		允许	21.00%	
000703	恒逸石化		允许	21.00%	
000709	河北钢铁		允许	21.00%	
000718	苏宁环球		允许	21.00%	
000725	京东方A		允许	21.00%	
000728	国元证券		允许	21.00%	
000729	燕京啤酒		允许	21.00%	
000750	国海证券		允许	21.00%	
000758	中色股份		允许	21.00%	
000768	中航飞机		允许	21.00%	
000776	广发证券		允许	21.00%	
000778	新兴铸管		允许	21.00%	
000780	平庄能源		允许	21.00%	
000783	长江证券		允许	21.00%	
000792	盐湖股份		允许	21.00%	
000800	一汽轿车		允许	21.00%	
000807	云铝股份		允许	21.00%	
000825	太钢不锈		允许	21.00%	
000839	中信国安		允许	21.00%	
000858	五 粮 液		允许	21.00%	
000869	张 裕A		允许	21.00%	
000876	新 希 望		允许	21.00%	
000878	云南铜业		允许	21.00%	
000883	湖北能源		允许	21.00%	
000895	双汇发展		允许	21.00%	
000898	鞍钢股份		允许	21.00%	
000933	神火股份		允许	21.00%	
000937	冀中能源		允许	21.00%	
000960	锡业股份		允许	21.00%	
000961	中南建设		允许	21.00%	
000968	煤气化		允许	21.00%	
000969	安泰科技		允许	21.00%	
000970	中科三环		允许	21.00%	
000983	西山煤电		允许	21.00%	
000999	华润三九		允许	21.00%	
002001	新和成		允许	21.00%	
002007	华兰生物		允许	21.00%	
002024	苏宁电器		允许	21.00%	
002038	双鹭药业		允许	21.00%	
002069	獐子岛		允许	21.00%	
002073	软控股份		允许	21.00%	
002081	金螳螂		允许	21.00%	
002092	中泰化学		允许	21.00%	

002106	莱宝高科		允许	21.00%	
002122	天马股份		允许	21.00%	
002128	露天煤业		允许	21.00%	
002142	宁波银行		允许	21.00%	
002146	荣盛发展		允许	21.00%	
002155	辰州矿业		允许	21.00%	
002202	金风科技		允许	21.00%	
002236	大华股份		允许	21.00%	
002241	歌尔声学		允许	21.00%	
002299	圣农发展		允许	21.00%	
002304	洋河股份		允许	21.00%	
002310	东方园林		允许	21.00%	
002344	海宁皮城		允许	21.00%	
002353	杰瑞股份		允许	21.00%	
002375	亚厦股份		允许	21.00%	
002378	章源钨业		允许	21.00%	
002385	大北农		允许	21.00%	
002399	海普瑞		允许	21.00%	
002405	四维图新		允许	21.00%	
002415	海康威视		允许	21.00%	
002422	科伦药业		允许	21.00%	
002431	棕榈园林		允许	21.00%	
002500	山西证券		允许	21.00%	
002570	贝因美		允许	21.00%	
002594	比亚迪		允许	21.00%	
002603	以岭药业		允许	21.00%	
002673	西部证券		允许	21.00%	
600000	浦发银行		允许	21.00%	
600005	武钢股份		允许	21.00%	
600009	上海机场		允许	21.00%	
600010	包钢股份		允许	21.00%	
600011	华能国际		允许	21.00%	
600015	华夏银行		允许	21.00%	
600016	民生银行		允许	21.00%	
600019	宝钢股份		允许	21.00%	
600022	山东钢铁		允许	21.00%	
600027	华电国际		允许	21.00%	
600028	中国石化		允许	21.00%	
600029	南方航空		允许	21.00%	
600030	中信证券		允许	21.00%	
600031	三一重工		允许	21.00%	
600036	招商银行		允许	21.00%	
600037	歌华有线		允许	21.00%	
600048	保利地产		允许	21.00%	
600050	中国联通		允许	21.00%	
600058	五矿发展		允许	21.00%	
600062	华润双鹤		允许	21.00%	
600066	宇通客车		允许	21.00%	
600068	葛洲坝		允许	21.00%	
600085	同仁堂		允许	21.00%	
600089	特变电工		允许	21.00%	
600096	云天化		允许	21.00%	
600100	同方股份		允许	21.00%	
600104	上汽集团		允许	21.00%	
600108	亚盛集团		允许	21.00%	
600109	国金证券		允许	21.00%	
600111	包钢稀土		允许	21.00%	
600115	东方航空		允许	21.00%	
600118	中国卫星		允许	21.00%	
600123	兰花科创		允许	21.00%	
600125	铁龙物流		允许	21.00%	
600132	重庆啤酒		允许	21.00%	
600143	金发科技		允许	21.00%	
600150	中国船舶		允许	21.00%	
600153	建发股份		允许	21.00%	
600157	永泰能源		允许	21.00%	
600160	巨化股份		允许	21.00%	
600166	福田汽车		允许	21.00%	
600169	太原重工		允许	21.00%	
600170	上海建工		允许	21.00%	
600177	雅戈尔		允许	21.00%	
600188	兖州煤业		允许	21.00%	
600196	复星医药		允许	21.00%	
600208	新湖中宝		允许	21.00%	
600216	浙江医药		允许	21.00%	
600219	南山铝业		允许	21.00%	
600221	海南航空		允许	21.00%	
600252	中恒集团		允许	21.00%	
600256	广汇能源		允许	21.00%	
600259	广晟有色		允许	21.00%	
600266	北京城建		允许	21.00%	
600267	海正药业		允许	21.00%	
600271	航天信息		允许	21.00%	
600276	恒瑞医药		允许	21.00%	
600309	烟台万华		允许	21.00%	
600315	上海家化		允许	21.00%	
600316	洪都航空		允许	21.00%	
600331	宏达股份		允许	21.00%	
600340	华夏幸福		允许	21.00%	
600348	阳泉煤业		允许	21.00%	
600352	浙江龙盛		允许	21.00%	
600362	江西铜业		允许	21.00%	
600369	西南证券		允许	21.00%	
600372	中航电子		允许	21.00%	
600376	首开股份		允许	21.00%	
600383	金地集团		允许	21.00%	
600395	盘江股份		允许	21.00%	
600406	国电南瑞		允许	21.00%	
600415	小商品城		允许	21.00%	
600432	吉恩镍业		允许	21.00%	
600456	宝钛股份		允许	21.00%	
600489	中金黄金		允许	21.00%	
600497	驰宏锌锗		允许	21.00%	
600498	烽火通信		允许	21.00%	
600508	上海能源		允许	21.00%	
600516	方大炭素		允许	21.00%	
600518	康美药业		允许	21.00%	
600519	贵州茅台		允许	21.00%	
600528	中铁二局		允许	21.00%	
600535	天士力		允许	21.00%	
600546	山煤国际		允许	21.00%	
600547	山东黄金		允许	21.00%	
600549	厦门钨业		允许	21.00%	
600550	天威保变		允许	21.00%	
600582	天地科技		允许	21.00%	
600583	海油工程		允许	21.00%	
600585	海螺水泥		允许	21.00%	
600588	用友软件		允许	21.00%	
600598	北大荒		允许	21.00%	
600600	青岛啤酒		允许	21.00%	
600637	百视通		允许	21.00%	
600642	申能股份		允许	21.00%	
600649	城投控股		允许	21.00%	
600655	豫园商城		允许	21.00%	
600660	福耀玻璃		允许	21.00%	
600664	哈药股份		允许	21.00%	
600674	川投能源		允许	21.00%	
600690	青岛海尔		允许	21.00%	
600694	大商股份		允许	21.00%	
600703	三安光电		允许	21.00%	
600718	东软集团		允许	21.00%	
600739	辽宁成大		允许	21.00%	
600741	华域汽车		允许	21.00%	
600770	综艺股份		允许	21.00%	
600779	水井坊		允许	21.00%	
600783	鲁信创投		允许	21.00%	
600795	国电电力		允许	21.00%	
600804	鹏博士		允许	21.00%	
600809	山西汾酒		允许	21.00%	
600811	东方集团		允许	21.00%	
600827	友谊股份		允许	21.00%	
600832	东方明珠		允许	21.00%	
600837	海通证券		允许	21.00%	
600839	四川长虹		允许	21.00%	
600859	王府井		允许	21.00%	
600863	内蒙华电		允许	21.00%	
600873	梅花集团		允许	21.00%	
600875	东方电气		允许	21.00%	
600881	亚泰集团		允许	21.00%	
600886	国投电力		允许	21.00%	
600887	伊利股份		允许	21.00%	
600893	航空动力		允许	21.00%	
600895	张江高科		允许	21.00%	
600900	长江电力		允许	21.00%	
600970	中材国际		允许	21.00%	
600971	恒源煤电		允许	21.00%	
600997	开滦股份		允许	21.00%	
600999	招商证券		允许	21.00%	
601001	大同煤业		允许	21.00%	
601006	大秦铁路		允许	21.00%	
601009	南京银行		允许	21.00%	
601018	宁波港		允许	21.00%	
601088	中国神华		允许	21.00%	
601098	中南传媒		允许	21.00%	
601099	太平洋		允许	21.00%	
601101	昊华能源		允许	21.00%	
601106	中国一重		允许	21.00%	
601111	中国国航		允许	21.00%	
601117	中国化学		允许	21.00%	
601118	海南橡胶		允许	21.00%	
601158	重庆水务		允许	21.00%	
601166	兴业银行		允许	21.00%	
601168	西部矿业		允许	21.00%	
601169	北京银行		允许	21.00%	
601179	中国西电		允许	21.00%	
601186	中国铁建		允许	21.00%	
601216	内蒙君正		允许	21.00%	
601233	桐昆股份		允许	21.00%	
601238	广汽集团		允许	21.00%	
601258	庞大集团		允许	21.00%	

（下转B11版）