# 国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

(上接B11版)

基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户,保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动,均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行监管机构的其他规定。

4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户,用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方书面同意擅自转让基金的任何证券账户;亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

5、债券托管账户的开立和管理

(1)《基金合同》生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户,并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2)基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议,正本由基金托管人保管,基金管理人保存副本。

6、期货结算账户的开立和管理

基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立期货结算账户。该账户按有关规则使用并管理。

7、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时,如果涉及相关账户的开设和使用,由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

8、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库;其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让,由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

9、投资者申购或赎回时现金替代、现金差额的查收与划付

基金托管人应根据登记结算机构的结算通知或者基金管理人的指令办理本基金因申购、赎回产生的现金替代和现金差额的结算。

10、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

对于无法取得二份以上的正本的,基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件,未经双方协商或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

(五)基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值的计算

(1)基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人,由基金管理人予以公布。

根据《基金法》,基金管理人计算并公告基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此,本基金的会计责任方是基金管理人,就与本基金有关的会计问题,如经双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。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。

2、基金资产估值方法

(1)估值对象

基金所拥有的股票、股指期货、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(2)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挂牌的市价(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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,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,确定公允价格。

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,确定公允价格;

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,确定公允价格;

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。交易所上市的资产支持证券,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。

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估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)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方法估值;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)股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

4)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。

5)对交易所上市的资产支持证券品种,鉴于其交易不活跃,各产品的未来现金流量也较难确认,按成本估值。

6)对只在上海证券交易所固定收益平台进行交易的公司债,按照成本法进行估值。

7)对只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的公司债,按照成本法进行估值。

8)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。

9)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。

10)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。

3、估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担,基金管理人对不应由其承担的责任,有权向向存在差错的责任人("差错责任方")追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的,由此造成的投资者或基金的损失,应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金,就实际向投资者或基金支付的赔偿金额,由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误,另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误,进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失,以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时,双方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对,如果最后仍无法达成一致,应以基金管理人的计算结果为准对外公布,由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任,基金托管人不负赔偿责任。

4、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后,应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册,对双方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧,应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现双方的账目存在不符的,基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正,保证双方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的,以基金管理人的账册为准。

5、基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后5个工作日内完成。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起45日内,基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上,并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告;在会计年度半年终了后60日内完成半年报告编制并公告;在会计年度结束后90日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在5个工作日内完成月度报告,在月度报告完成当日,对报告加盖公章后,以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核;基金托管人在3个工作日内进行复核,并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在7个工作日内完成季度报告,在季度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后7个工作日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在30日内完成半年度报告,在半年报完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后30日内进行复核,并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在45日内完成年度报告,在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人在收到后45日内复核,并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中,发现相关各方的报表存在不符时,基金管理人和基金托管人应共同查明原因,进行调整,调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后,基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书,相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致,基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告,基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后,需盖章确认或出具相应的复核确认书,以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6、暂停估值的情形

(1)基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2)因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

(3)中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(六)基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册,包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

本基金的基金登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金份额持有人名册由基金的基金登记结算机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册:《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册,并定期刻成光盘备份,保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途,并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

(七)争议解决方式

双方当事人同意,因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议,除经友好协商可以解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点在北京,仲裁裁决是终局性的并对双方均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

(八)托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更与终止

(1)托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案后生效。

(2)基金托管协议终止的情形

发生以下情况,在履行适当程序后,本托管协议终止:

1)《基金合同》终止;

2)基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产;

3)基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权;

4)发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

2、基金财产的清算

(1)基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4)基金财产清算程序:

1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

3)对基金财产进行估值和变现;

4)制作清算报告;

5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

6)将清算报告报中国证监会备案并公告。

7)对基金财产进行分配;

(5)基金财产清算的期限为6个月或根据登记结算公司的规定完成。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司等登记结算公司的最低结算备付金和交易席位保证金等未结事项占用资金,该资产可由基金管理人垫付后先行分配投资者,并由基金财产清算小组在相关登记结算公司对其进行调整并完成变现收回后返还基金管理人。

由于登记结算公司最低备付金、交易保证金制度及基金托管人清算规则的影响,以下作为清算未结事项:

1)证券账户销户;

2)托管资金账户销户;3)开立的其它交易结算账户销户、席位退租清理等事项;

(6)清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(7)基金财产按下列顺序清偿:

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

3、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

4、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

**二十二、对基金份额持有人的服务**

基金管理人承诺为基金份额持有人提供系列服务,基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化,有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一)对账单寄送服务

1、在《基金合同》生效后15个工作日内,由基金管理人向认购本基金的基金份额持有人寄出认购确认单。

2、在未收到客户关于不需要对账单寄送的明确表示下,基金管理人将按照上述规则邮寄对账单。基金份额持有人可根据个人需要,通过基金管理人客服热线、网站、电子邮件等方式取消或恢复对账单寄送服务。

3、为保障对账单邮寄服务的及时准确,请务必预留准确的通讯地址及联系方式,并及时更新。

4、由于对账单记录信息属于个人隐私,基金份额持有人除邮寄对账单方式外,也可以通过基金管理人客服热线、电子邮件或者国投瑞银网站等方式查询相关账户信息。

5、基金管理人将随对账单定期或者不定期寄送相关基金资讯。

6、对账单以邮政平信方式寄出,基金管理人不对邮寄资料的送达做出承诺和保证,也不对因邮寄资料出现遗漏、泄露而导致的任何直接或间接损害承担赔偿责任。

(二)信息发送服务

基金管理人为基金份额持有人提供手机短信息和电子邮件的信息定制服务。

1、手机短信息的定制内容包括持有基金周末净值、基金交易确认信息、分红确认信息、月末账户余额报告等。

2、电子邮件信息定制内容包括周讯、月讯、电子对账单等。

3、手机短信息发送依托于外部通讯服务商,电子邮件发送通过互联网进行信息传送,基金管理人根据服务规则定期发送相关信息,并不对信息的送达做出承诺和保证。

基金份额持有人可以通过基金管理人网站、客服热线或以邮件形式提交信息定制申请或修改、取消该项服务。

(三)呼叫中心电话服务

呼叫中心自动语音系统提供7×24小时的自动语音服务和查询服务,客户可通过电话收听基金份额净值,自助查询基金账户余额和交易信息等。

客户服务中心的人工坐席服务时间为每周一至周五9:00—21:00,周六、周日9:00—17:00(法定节假日及因此导致的证券交易所休市日除外)。

客服热线:4008806868(免长途)

(四)网上查询服务

基金份额持有人可通过国投瑞银网站的"账户查询"平台完成基金账户的查询业务。

国投瑞银网址:www.ubssdic.com

(五)投诉受理服务

投资者可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心、书信、电子邮件、传真、登门拜访等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉,原则上是及时回复,对于不能及时回复的投诉,基金管理人将在48小时之内做出回复。对于非工作日提出的投诉,原则上顺延至下一工作日当日或次日回复。

客服邮箱:service@ubssdic.com

**二十三、其他应披露事项**

暂无。

**二十四、招募说明书存放及查阅方式**

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人和代销机构的住所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。招募说明书条款及内容应以招募说明书正本为准。

**二十五、备查文件**

(一)国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集申请核准文件

(二)《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四)关于国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集之法律意见书

(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)中国证监会要求的其他文件

存放地点:上述备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式:投资者可以在办公时间免费查询;也可按工本费购买本基金备查文件复制件或复印件,但应以基金备查文件正本为准。

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一三年八月二十三日

---

# 国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

(上接B9版)

2、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的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

3、本基金权益登记由登记结算机构在基金募集结束后完成过户登记。

**八、基金的验资与基金合同生效**

基金募集期限届满,本基金具备继今年备案条件的,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。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。

若《基金合同》不能生效,基金管理人在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项、股票及其孳息,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。

**九、本基金募集的当事人和中介机构**

(一)基金管理人
名称:国投瑞银基金管理有限公司
英文名称:UBS SDIC FUND MANAGEMENT CO., LTD
住所:上海市虹口区东大名路638号7层
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人:钱蒙
设立日期:2002年6月13日
电话:(0755)83575992
传真:(0755)82904048
联系人:杨蔓

(二)基金托管人
名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55 号
法定代表人:姜建清
成立时间:1984 年1 月1 日
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

(三)基金份额销售机构

1、网下现金及网下股票发售机构
名称:国投瑞银基金管理有限公司直销中心
住所:上海市虹口区东大名路638号7层
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层
法定代表人:钱蒙
电话:(0755)83575993 83575992
传真:(0755)82904048 82904007
联系人:曹丽丽、杨蔓
客服电话:400-880-6868
网站:www.ubssdic.com

2、网上现金发售代理机构

投资者可通过以下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(排序不分先后):

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券。

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开放式基金销售系统办理本基金的认购业务。具体名单可在深交所网站查询,本基金管理人将不就此事项进行公告。

3、网下股票认购发售代理机构(以下排序不分先后):

(1)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层
法定代表人:万建华
电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:芮敏祺
客服电话:95521
公司网站:www.gtja.com

(2)中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
传真:010-65182261
联系人:权唐
客服电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

(3)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
联系人:周杨
客服电话:95536

(4)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
办公地址: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
电话:0755-82943666
传真:0755-83734343
联系人:林生迎
客服电话:95565、4008888111
公司网站:www.newone.com.cn

(5)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
电话:010-66568430
传真:010-66568990
联系人:田薇
客服电话:400-888-8888
公司网站:www.chinastock.com.cn

(6)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
电话:021-33388215
传真:021-33388224
联系人:曹晔
客服电话:95523或4008895523
公司网站:www.sywg.com

(7)海通证券股份有限公司
住所:上海市广东路689号
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:95553
公司网站:www.htsec.com

(8)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:李芳芳
客服电话:95525、4008888788
公司网站:www.ebscn.com

(9)平安证券有限责任公司
住所: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
法定代表人:杨宇翔
电话:0755-22626391
传真:0755-82400862
联系人:郑舒丽
客服电话:95511-8
公司网站:www.pingan.com

(10)安信证券股份有限公司
住所: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:深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1号楼9层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82558305
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
客服电话:4008-001-001
公司网站:www.essence.com.cn

(11)国盛证券有限责任公司
住所:南昌市北京西路88 号江信国际金融大厦
办公地址:南昌市北京西路88 号江信国际金融大厦
法定代表人:曾小普
电话:0791-86281305
传真:0791-86285337
联系人:陈明
客服电话:4008222111
公司网站:www.gsstock.com

(12)齐鲁证券有限公司
住所:山东省济南市经七路86号
办公地址:济南市经七路86号
法定代表人:李玮
电话:0531-68889155
传真:0531-68889185
联系人:吴阳
客服电话:95538
公司网站:www.qlzq.com.cn

(13)长城证券有限责任公司
住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
电话:0755-83516289
传真:0755-83515567
联系人:刘阳
客服电话:0755-33680000、400-6666-888
公司网站:www.cgws.com

(14)渤海证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
电话:022-28451709
传真:022-28451892
联系人:胡天彤
客服电话:400-651-5988
公司网站:http://www.bhzq.com

(15)中国中投证券有限责任公司
住所:深圳福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
联系人:刘毅
客服电话:400-600-8008、95532
公司网站:www.china-invs.cn

(16)广州证券有限责任公司
住所:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:刘东
电话:020-88836999
传真:020-88836654
联系人:林洁茹
客服电话:020-961303
公司网站:www.gzs.com.cn

(17)国都证券有限责任公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
电话:010-84183333
传真:010-84183311
联系人:黄静
客服电话:400-818-8118
公司网站:www.guodu.com

(18)国金证券股份有限公司
住所:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:028-86690070
传真:028-86690126
联系人:刘一宏
客服电话:4006-600109;95105111(四川省内拨打)
公司网站:www.gjzq.com.cn

(19)江海证券有限公司
住所:哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
联系人:张宇宏
客服电话:400-666-2288
公司网站:www.jhzq.com.cn

(20)华宝证券有限责任公司
住所:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人:陈林
电话:021-68777222
传真:021-68777222
联系人:汪明丽
客服电话:400-820-9898
公司网站:www.cnhbstock.com

(21)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:高冠江
电话:010-63081000
传真:010-63080978
联系人:唐静
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com

(22)国联证券股份有限公司
住所:江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702
法定代表人:姚志勇
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
联系人:沈刚
客服电话:95570
公司网站:www.glsc.com.cn

(23)中国国际金融有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人:金立群
电话:010-65051166
传真:010-65058065
联系人:罗春蓉 武明明
公司网站:www.cicc.com.cn

(24)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
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7-10层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
联系人:张腾
客服电话:96326(福建省外加拨0591)
公司网站:www.hfzq.com.cn

(25)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3层、5层
法定代表人:宋德清
电话:010-58568235
传真:010-58568284
联系人:黄恒
客服电话:010—58568118
公司网站:www.hrsec.com.cn

(26)爱建证券有限责任公司
住所:上海市浦东世纪大道1600 号陆家嘴商务广场32楼
办公地址:上海市浦东世纪大道1600 号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人:郭林
电话:021-32229888
传真:021-62878783
联系人:戴莉丽
客服电话:021-63340678
公司网站:www.ajzq.com

(27)东北证券股份有限公司
住所:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
电话:0431-85096517
传真:0431-85096795
联系人:安岩岩
客服电话:400-600-0686
公司网站:www.nesc.cn

(28)东吴证券股份有限公司
住所:苏州工业园区星阳街5号
办公地址:苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
联系人:方晓丹
客户服务电话:4008-601-555
网址:www.dwzq.com.cn

(29)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
办公地址: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

(30)华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪家新
电话:021-64339000
传真:021-64333051
联系人:陈敏
客服电话:021-32109999;029-68918888
公司网址:www.cfsc.com.cn

(四)基金注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
办公地址:北京西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
联系人:崔巍
电话:(010)59378856
传真:(010)58598907

(五)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
经办律师:刘佳、张兰

(六)会计师事务所和经办注册会计师
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:上海市湖滨路202 号普华永道中心11 楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23236837
传真:(021)23238800
经办注册会计师:薛竟、张晓艺
联系人:张晓艺

**十、网下股票认购清单**

本基金募集期间,网下股票认购名单如下表所示,但是募集期结束前已公告的将被调出沪深300金融地产指数的成份股不得用于认购本基金。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个工作日公告限制认购规模的个股名单。对于在网下股票认购期间价格波动异常、认购申报数量异常等允许其认购可能影响基金份额持有人利益的个股,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。

| 股票代码 | 股票简称 | 股票代码 | 股票简称 | 股票代码 | 股票简称 |
|---|---|---|---|---|---|
| 000001 | 平安银行 | 600015 | 华夏银行 | 601166 | 兴业银行 |
| 000002 | 万科A | 600016 | 民生银行 | 601169 | 北京银行 |
| 000024 | 招商地产 | 600030 | 中信证券 | 601288 | 农业银行 |
| 000046 | 泛海建设 | 600036 | 招商银行 | 601318 | 中国平安 |
| 000402 | 金融街 | 600048 | 保利地产 | 601328 | 交通银行 |
| 000562 | 宏源证券 | 600109 | 国金证券 | 601336 | 新华保险 |
| 000656 | 金科股份 | 600208 | 新湖中宝 | 601377 | 兴业证券 |
| 000686 | 东北证券 | 600266 | 北京城建 | 601398 | 工商银行 |
| 000718 | 苏宁环球 | 600340 | 华夏幸福 | 601555 | 东吴证券 |
| 000728 | 国元证券 | 600369 | 西南证券 | 601601 | 中国太保 |
| 000750 | 国海证券 | 600376 | 首开股份 | 601628 | 中国人寿 |
| 000776 | 广发证券 | 600383 | 金地集团 | 601688 | 华泰证券 |
| 000783 | 长江证券 | 600649 | 城投控股 | 601788 | 光大证券 |
| 002142 | 宁波银行 | 600837 | 海通证券 | 601818 | 光大银行 |
| 002146 | 荣盛发展 | 600895 | 张江高科 | 601901 | 方正证券 |
| 002500 | 山西证券 | 600999 | 招商证券 | 601939 | 建设银行 |
| 002673 | 西部证券 | 601009 | 南京银行 | 601988 | 中国银行 |
| 600000 | 浦发银行 | 601099 | 太平洋 | 601998 | 中信银行 |

国投瑞银基金管理有限公司
2013年8月23日

---

# 国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要

(上接B9版)

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后两个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

(六)表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

1、一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,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。

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。

(七)计票

1、现场开会

(1)如大会由基金管理人或基金托管人召集,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和代理人中选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,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选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不出席大会的,不影响计票的效力。

(2)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。

(3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4)计票过程应由公证机关予以公证,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。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)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,不影响计票和表决结果。

(八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。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,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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。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、基金托管人均有约束力。

(九)本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对相应内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

**三、基金收益分配原则、执行方式**

(一)基金收益分配原则

1、每份基金份额享有同等分配权;

2、基金管理人每月定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估,基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,基金管理人可以进行收益分配;

3、在符合上述基金分红条件的前提下,本基金收益每年至多分配12次,每次基金收益分配数额的确定原则为:使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率;若基金合同生效不满3 个月可不进行收益分配;

4、基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补亏损为前提,收益分配后有可能使基金份额净值低于面值,即基金收益分配基准日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值;

5、本基金收益分配采取现金方式;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在遵守法律法规的前提下,基金管理人、登记结算机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整,并及时公告。

(二)基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日,基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率。

基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算)。

截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过1%时,基金管理人可以进行收益分配。

2、当基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配数额。

(三)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的基金收益分配对象、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,在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日。

(五)基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的手续费用由投资者自行承担。

**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、基金标的指数使用费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6、基金上市费及年费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的证券交易费用;

9、基金的银行汇划费用;

10、基金收益分配中发生的费用;

11、基金的开户费用、账户维护费用;

12、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.13%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.13%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3、《基金合同》生效后的标的指数使用费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下,指数使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提,且收取下限为每季度(包括基金成立当季)人民币5 万元。计算方法如下:

H=E×0.03%÷当年天数

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算,逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令,经基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

在基金存续期内,如果基金管理人与指数所有人中证指数有限公司签订的指数使用许可协议中关于"指数使用费"的内容有所修改的,将按照最新的内容进行费用计提和支付,此事无须召开份额持有人大会。

上述"一、基金费用的种类中第4—12项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(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失;

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;

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)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定酌情调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人须于新的费率实施日前在指定媒体上公告。

**五、基金财产的投资方向和投资限制**

(一)投资目标

本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

(二)投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债存债、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

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

本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产的90%;权证、股指期货以及其他金融工具的投资比例须符合法律法规和中国证监会的规定。

(三)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资于标的指数成份股票及其备选成份股票的市值不低于基金资产的90%;

(2)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%;本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;本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%;本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)不得超过基金资产净值的100%;本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%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

(3)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%;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%;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%;

(4)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%;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%;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%;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%;

(5)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;

(6)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;

(7)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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(8)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金申购或赎回带来现金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个月内使基金的投资组合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。

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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

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)违反规定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,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5)向基金管理人、基金托管人出资;

(6)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;

(7)依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

本基金运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,符合中国证监会的规定,并履行信息披露义务。

法律法规或监管部门调整上述限制的,本基金从其规定。

**六、基金资产净值的计算方法和公告方式**

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

2、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挂牌的市价(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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,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,确定公允价格。

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,确定公允价格;

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,确定公允价格;

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。交易所上市的资产支持证券,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。

(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估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)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方法估值;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)股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

(4)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。

(5)对交易所上市的资产支持证券品种,鉴于其交易不活跃,各产品的未来现金流量也较难确认,按成本估值。

(6)对只在上海证券交易所固定收益平台进行交易的公司债,按照成本法进行估值。

(7)对只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的公司债,按照成本法进行估值。

(8)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。

(9)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。

(10)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。

3、基金资产净值、基金份额净值的公告

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

**七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算**

(一)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案后生效,自决议生效后两日内在指定媒体公告。

(二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行适当程序后,《基金合同》应当终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;

2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

3、《基金合同》约定的其他情形;

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序:

(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

(3)对基金财产进行估值和变现;

(4)制作清算报告;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7)对基金财产进行分配;

5、基金财产清算的期限为6个月或根据登记结算公司的规定完成。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司等登记结算公司的最低结算备付金和交易席位保证金等未结事项占用资金,该资产可由基金管理人垫付后先行分配投资者,并由基金财产清算小组在相关登记结算公司对其进行调整并完成变现收回后返还基金管理人。

由于登记结算公司最低备付金、交易保证金制度及基金托管人清算规则的影响,以下作为清算未结事项:

(1)证券账户销户;

(2)托管资金账户销户;

(3)开立的其它交易结算账户销户、席位退租清理等事项;

(四)清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五)基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六)基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七)基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

**八、争议解决方式**

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会,按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

**九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。