(上接B17版)
(5) 拒绝 干扰, 阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6) 拒绝 干扰, 阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
(6) 玩忽駅宁, 滥用职权, 不按照规定服行职责;
(7) 违反现行有效的有关法律, 法规、规章, 基金合同和中国证监会的有关规定, 泄漏在任职期间知悉的有关证券, 基金的商业报签。尚未依法公开的基金投资内容, 基金投资计划等信息, 或利用该信息从事或者明示, 暗示他人从 等。查查证明电速检查,用本KK在公开印整金过及页内各。查查过及可以对可信息。现代可接信总从争或看好小、幅小他人从事相关的交易活动; (8)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; (9)贬积同行。以拾高自己; (10)以不正当手段谋求业务发展; (11)有学社会公他,携带证券投资基金人员形象; (12)在公开信息按露和广告中故意各有虚假、误导、欺诈成分; (13)其他提供,开放迁级以及中国证验会禁止的行为。 4.基金管理人承诺严格遵守基金合同的规定,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生。

(15) 天地広年、行政法规以及中国血流云宗正的行为。
4.基金管理人承诺产格遵守甚金合同的规定,本若适宜的健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生。
5.基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。
六.基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。
六.基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。
六.基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。
六.基金管理人承诺不从事其他法规规定,在若适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.不能露在任职期间知恶的有关证券。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,且不利用放信息、财政营证人和证据的制度概述。
4.不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。
七.基金管理人内部定规制制度
1.内部还制制度概述
基金管理人内部定规制制度
1.内部还能制度概述
基金管理人的范积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,制定了一系列组织机制、管理方法,操作程序与控制措施、形成了公司宗整的内部定制度系。该内部控制标系涵盖了内部会计控制、风险管理控制和监察器检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。
(11)有强风险控制遵循的原则
1.全面性原则,公司政企业的储格选斯等。 (14)增加多过来不断失源。
2.1独立任何能农和金

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,内部风险控制

i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。

(3)/0級官 建空制的现象 公司为有效控制管理监管中的风险,建立了一整套完整的风险管理控制制度,其内容由一系列的具体制度构成, 主要包括。岗位分离和空间分离制度,投资管理控制制度,信息技术控制,营销业多控制,信息披露制度,资料保全制 要求地立的精格制度、人分资源管理以及相应的业务控制流程等。通过这些控制制度和流程,对公司面临的投资风险 和管理风险进行有效的控制。

(4)监察稽核制度 公司实行独立的监察稽核制度,通过对稽核监察部充分授权、对公司执行国家有关法律法规情况、以及公司内部控制制度的遵循特况和有效性进行全面的独立监察稽核、确保公司经营的合法合规性和内部控制的有效性。 2. 基金管理人内部控制制度要素 (1) 控制环境

公司经过多年的管理实践,建立了良好的控制环境,以保证内部会计控制和管理控制的有效实施,主要包括科学司治理结构、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、独立的监察稽核职能等方

的公司治理结构、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、独立的监察稽核职能等方面。

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则进行决策及监督;
2)在组织结构方面。公司设立的持方委员会、效分级管理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17之间有明确的接权分工和风险控制责任、抵相互独立、又相互合作和制的、形成了与距组组结构成,及接受权和风险控制体系。;
3)公司一贯坚持减估为投资人服务的道德观和这能制体系。;
3)公司一贯坚持减估为投资人服务的道德观和这能制体系;
(3)公司传收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计价和提出改进过议。
(2)控制的性形和出改进过议。
(2)控制的性形和出改进过议。
(2)控制的性形和分别合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计价和提出改进过议。
(3)控制的性别和分别,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。全时通过了完整的内部会计控制,公司推发国家有关运律注度,有关会计制度和控制、制度方规定和关系和反对基金会计制度以及会计处分控制、被定分部分和公司财务的投资工作,其实、整体确的也是对和反对财务经常从公司财务发展,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。各基金之间数到企业继、独立核算、保证基金贷产和公司财产之间,以及各基金定产间的相互放生。公司经过了严格的讨位即对分核控制,凭证与记录控制,资产按触控制,独立精格等制度,确保在基金核算和公司财务管理和应到对资格的对处制,有关知识的对策的对处,是由于公司的发生制,发生的对处,对于被的对策的可能被对,如同企业经验的发生的现代,则是对关系的可能被对,从可能会对的现代,可能会对对解处的企业和发生的对策。

2)风险管理控制 公司在经营管理中建立了有效的风险管理控制体系,主要包括; 岗位分离和空间隔离制度,为保证各部门的相对地立性,公司建立了明确的岗位分离制度;同时实行空间隔离制度 度,建立防火墙,充分保证信息的隔离和保密; 投资管理。各控制,通过建立军整的研究业务控制,投资决策控制、交易业务控制,完善投资决策委员会的投资 决策即能和风险管理委员会的风险控制服能,实行投资总监书基金经理分级授权制度和股票池制度,进行集中交易, 以及风险管理部对投资交易实时监控等,加强投资管理控制,做到所究,投资,交易,风险控制的相互独立,相互部份 利相互配合,有效控制操作风险,建立了科学会理的投资风险量化评估和管理体系,经制设金。4中间临份市场风险、集中风险、流动性风险等,建立了科学合理的投资业绩绩效评估体系,对投资管理的风险和业绩进行及时评估和 反馈。

险,集中风险,流动性风险等;建近1科学合理的投资业频频效评估体系。对投资管理的风险机业频进行及时评估和 反馈; 信息技术控制,为保证信息技术系统的安全稳定,公司在硬件设备运行维护,软件采购维护,网络安全,数据库管理。总执处理机制等方面动制定了完善的制度和控制或程制。这一种企业,以保证在营销业多中对有关法律法规的 遵守,以及对经营风险的有效控制; 信息披露挖制所资料保全制度;公司制定了规范的信息披露管理办法,保证信息披露的及时,准确和完整;在资料保全有一建立了完善的性意对保全给仍系统,以及实验的会计,统计和各种业多等特性%。 独立的监察精体制度,稍被监察部有权对公司各业务部门工作进行精核检查,并保证精核的独立性和客观性。 3)内部控制制度的实施 公司风险管理委员会自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 风险控制限则。在风险管理委员会总体方针指导下,条部门报报各自业务特点,对业务活动中存在的风险点进行了揭示和规则。在风险管理委员会总体方针指导下,条部门报报各自业务特点,对业务活动中存在的风险点进行了揭示和规则。在风险管理委员会总体方针指导下,条部门报报各自业务特点,对业务活动中存在的风险点进行了揭示和规则。在风险管理委员会总体方针指导下,条部门报报各自业务特点,对业务活动中存在的风险点进行了揭示和规则。在风险管理委员会总体方针指导下,条部门报报各自业务特点,对业务活动中存在的风险点进行了揭示和规则。在风险管理委员会总体方针指导下,条部门报报各。以及内部控制制度实施情况的基础上、公司各业务活动中内部控制制度实施情况的基础上、公司各业务活动中风险器器程度致高的东市认识确保公司经营法法规,以及内部控制制度实施情况的基础上、公司各业对内部控制制度实施情况的设备。

(4)內部控制制度实施情况的报告 (4)內部控制制度实施情况的报告 本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 公司高级管理定和精焓监索部报告,使公司高级管理定和精核监察部及时了解内部控制出现的问题并作出妥善处

理。 稿核監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,则逾过管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稽核报告, 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,由时书 基金管理人保证以上关于内部控制制度的披露真实,准确,并承诺基金管理人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。 第四部分 基金托管人情况

ロース・カリロ: 17 映 27 宮 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基字[1998]12号 联系人: 田青

一。中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、 QFII托管处、养老金托管处、清算处、核黄处、跨塘托管运营处、监管稽核处等10个职能处案、在上海设有投资托管服务 上海备份中心、共有员工20%人。自2000年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内障工作手段。 (二)主要人员情况

(二)主要人员情况 起观雨,资产托管业多需总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行,总行信贷部、总行信贷一部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北信分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务、长期从事信贷业务、个人银行业务和、总行审计部担任领导职务、长期从事信贷业务、个人银行业务和、资产托管业务部副总经理,曾被职于中国建设银行首品分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室、长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。张为协资产托管业务部副总经理,曾被职于中国建设银行总行建设资产部、信贷率。信贷管理部、信贷经营部、公司业务部、并在总行集团客户部本中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。 黄莠莲、资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建设各种、银行、营业务等工作,具有主部的条件服务和业务管理经验。

富的客户服务和业务管理经验。
(三)基金托管业务经营协究
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险逻辑和内部控制。"常规管托管人的各项职责、切实维宁资产持有人的合法权益、为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金,社保基金、保险资金、基本茅老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务体系是目前国内托管业务体系是目前国内托管业务体系是目前国内托管业务体系是目前国内托管业务体系是目前国内托管业务体系是目前国内托管业务体系是目前国内社会成功的托管服务能力和业务水平。赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管入》并为"中国最往往管辖行"。
二、基金托管人的内部定制制度
(一一)内部控制日际

二、基金托膏人即內/衛佐亞剛中B2。
(一)內爾定納自标
(一)內爾定納自标
(一)內爾定納自标
(一)內爾定納自称
(中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规。行业监管规章和本行内有关管理规定。
(完整:建筑远在)严格监察。确保业务的稳能运行,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。
(二)內爾定納班班特勒
(二)內爾克納班班特勒

(二)內部挖納短犯结构 中国建设银行设有风险与内控管理委员会、负责全行风险管理与内部控制工作、对托管业务风险控制工作进行 检查指导。资产托管业务部专门设置了监督格校处、配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独 立行使监督格核工作职权和能力。 (三)內部控制制度及赶推施 资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系、建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作液配、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:业务管理严格实行复核、审核、检查制度、授权工作实行中 中控制、业务日单定规矩程联管、存放、使用、账户资料严格保管、能约机制产格有效、业务操作区专门设置,进行管理、实 海盲像监控、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

(一)监督方法 (一)监督方法 (任职《基金法)及其配套法规和基金合同的约定。监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业多综合 (企)基金监督子系统"。严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理、运作基金的投资比例,投资范 投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供 经营工会,在日常为基金投资运作的提供,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业。

(二)屆首の經 1,每工作日按时通过基金监督子系统、对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况、向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实。督促其纠正,并及时报告中国证监会。 2.收到基金管理人的设计台后,对特令要求等的实验任核查。 3.根据基金投资运作监督情况。定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性 等专项进行证例。据述计即证例、定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性

。 。通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国 第五部分 相关服务机构 -、基金份额发售机构

1、发售协调人 具体名单详见基金份额发售公告。 2、网下现金发售直销机构

	TALLA LANGUESIC CONTRACTOR IN THE NATIONAL					
	机构名称	机构信息				
	国泰基金 管理有限公司直销柜台	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼				
		办公地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层				
		客户服务专线:400-888-8688.021-31089000				
		传真:021-31081861	同址:www.gtfund.com			
3、网下现金发售代理机构、网下股票发售代理机构和网上现金发售代理机构具体名单详见本基金份额发售公						
以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。						

联系电话: 021-23238888 专真:021-23238800 经办注册会计师:许康玮、胡逸嵘 联系人:胡逸嵘

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,并经中国证监会证监许可【2016 7733号文(《关于准予国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金注册的批复)》准予注册募集。

二、基金类型和存续期限 1、基金类型:股票型证券投资基金 2、基金运作方式:交易型开放式 3、基金的存续期间:不定期 三、募集期限

二、於來明限 自基金份額发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。 引、募集方式

销售机构公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机 /用天公告。 投资人可速経网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购和种方式认购本基金。 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用上海证券交易所交易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及其指定的发售代理机构以现金进行的认购; 研下股票认购是指投资人通过基金管理人有定的发售代理机构以限要进行的认购。 基金管理人可以根据具体情况调整本基金的发售方式,并在基金份额发售公告或相关公告中列明。 密報或物

六、募集场所 投资人应当在基金管理人及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 提供的方式办理基金份额的认购。 基金管理人、发售代理机构接受的认购方式、办理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

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 册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。否 由于投资人过精而产生的任何损失由投资人自行承担。 七、基金份额初始而值、认购价格 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

八.认晚开产 投资人认购本基金时需具有上海证券账户。证券账户是指上海证券交易所A股账户(以下简称"上海A股账户") 或上海证券交易所证券投资基金账户(以下简称"证券投资基金账户")。 已有上海A股账户或证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。 尚无上海A股账户或证券投资基金账户的投资人,需任以购前持身份证明文件到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机场办理上海A股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海A股帐户和证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海A股帐户和证券投资基金帐户的从在程序和边上请到各开户间点详细咨询有关规定。 1.如投资人需新开立证券帐户,则应注意: (1.)证券投资基金账户风管无金的现金认购和二级市场交易,如投资人需要使用标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票以购或基金份额的申购、账回,则应开立和使用上海A股账户;如投资人需要使用标的指数成份股中的原则证券交易所上市股票参与网下股票以购或基金份额的申购。账回,则应开立和使用上海A股账户;如投资人需要使用标的指数成份股中的原则证券交易所上市股票参与网下股票以购或基金份额的申购。则则应用于动上使用上海A股账户;如投资人需要使用标的指数成份股中的原则证券交易所上市股票参与网下股票以购或基金份额的申购。则则应用于立上海证券账户和原则证券交易所A股账户。

(2)开户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

(2) 升户当日无法办理指定交易,建议投资人在进行认购前全少个工作日办理升户手续。 2. 如投资人民开立证券件户则应注意。 (1) 如投资人未办理指定交易或指定交易不在办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在 可办理本基金发售业务的证券公司。 (2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购,建议投资人在进行认购前至少1个工作日办理 指定交易或转指定交易手续。 九.认购费用 认购费用 认购费用。

Mc30万份 1.00% 50万份 1.00% 50万份 8Mc100万份 0.50% 0.5

到位的认规符金划注"预先开设的基金募集专户。

5.认购金额 = 认购价格 ×认购价额 × (用金比率)
认购佣金 = 认购价格 ×认购价额 × (用金比率)
认购佣金 = 认购价格 ×认购价额 × (1 + 佣金比率)
认购佣金 = 以购价格 ×认购价额 × (1 + 佣金比率)
认购佣金 = 以购价格 ×认购价额 × (1 + 佣金比率)
认购佣金 = 以购价格 ×认购价额 × (1 + 佣金比率)
认购用金 = 1,00×1,000×1,000 + 2,000×1,000 + 2,000×1,000 + 2,000×1,000 + 1,000
则投资人需准备1,010×1,000×1,000 + 1,010元
则投资人需准备1,010元资金,方可认购到1,000份本基金基金份额。
6.认购确抗,在基金合用全效后,投资人应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。
十一、网下现金认购
通过基金管理人及其指定的发售代理机构进行网下现金认购,认购以基金份额申请。
1.认则时间,详见基金份额发售公告
1.认则时间,详见基金份额发售公告
1.认则时间,详见基金份额发售公告
1.认则明确;两个现金认购以基金份额申请,投资人单笔认购须为1,000份或基整数倍。投资人在募集期内可多次
认购,认购到前间单个投资人的繁计认购到缴接及有限制。
3.认购申请:投资人在以购本基金时,需按销售机构的规定,到销售网点办理相关认购手续,并备足认购资金。 阿下聚金认购明间单个投资人的繁计从购现搬货者限制。
3.认购申请请投资后任间制均规处的时间之后不得撤销。
4.清算交收,于由通过基金管理人是公价阿下现金认购申请。11通过基金管理人是公价阿下现金认购申请。200年,在11通过基金管理人是公价阿下现金认购申请。200年,在11通过基金管理人是公价的不完全以购申请汇总的,通过上海证券交易所上限定价度分置系统代数投资人是空机中强金以购申请,由该发售代户报查、11通过推广行额交收,并将有效认购数据发送发售协调人,发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预

记记的经过行解决之处,开付有以从购效强发达及查协调人人及首协调人有关外,到证的从购负或或列生基金管理人则 开设的基金繁荣学。 5.认购资金额的计算 (1)通过基金管理从进行网下现金认购的投资人,认购以基金份额申请,认购费用和认购金额的计算如下; 1)超选用比例费率,计算公式如下; 认购货格:以购价格、以助价额、以购货额。 (1 + 认购货格)以购分额。 (1 + 认购费率) 总以购货物量,以购价格,以财分额。 (1 + 认购费率) 总以购货物量,以购货物量,以购金额产生的利息。 (1 + 以购费等) 总以购货物量,以购货物量,以购金额产生的利息。 (1 + 以购费等) 总以购货物量,以购货物量,因定费用 以购货物量,以购货物量,因定费用 以购货物量,以购货物量,因完费用。 (1 + 以购金额产生的利息,为的格 以购费用由基金管理人的投资人收取。 及资人需以现金方式支付认购费用。 市通过基金管理人进行两下现金认购的有效认购资金在等集期间产生的利息。 (4 + 的有力,多基金份额归投资人所有,中利息转份额出金金管理人的证录分率,和包扩算的的物理重整效企,或都分全之。含去部分计入基金财产。 例:某投资人到基金管理人直销柜台入期间00.000份基金份额,认购费率为1.00%。 假定认购金额产生的利息为 8.亿元则需准备的资金金额计算如下; 以购费用 = 100×100,000×(1 + 1.00%) = 101,000元 总认购份额 = 100,000(1 + 1.00%) = 101,000元 总以购份额 = 100,000(1 + 1.00%) = 100,100分 以购货份第 = 100,000(1 + 1.00%) = 100,100分 以购货份等 = 100×100,000×(1 + 1.00%) = 100,100分 以购货份额 = 100,000 + 10.821,00。 = 100,000元 总人可得到100,010份法基金基金份额。 (2 )通过发生代理机构工从购本基金的0000份,需准备101,000元资金,假定该金额产生利息10×8元,则 资人可得到100,010份未基金基金份额 (2 )通过发生代理机构设的计算。 人可得到100,010份法基金基金份额 (2 )通过发生代理机构的计算。 有一100~100。1000 + 1000。1000 + 1000

、1009年间 投资人在认购本基金时,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

### ∑(第i只股票在阿下股票认为非最后一日的均价×有效认购数量)/1.00

=1。 (2) "第只股票在阿下股票认购期最后一日的均价"由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据,以该股票 或交金额除以总成交股数计算,以四舍五人的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交,则以同样 比计算最近一个交易日的均价作为计算价格。 若某一股票在何下股票认购期最后一日至注册登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股(转增),配 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网下股票认购期最后一日的

处了河晚; 1)除息;调整后的价格 = 网下股票认购期最后一日的均价 - 每股现金股利或股息 2)送股;调整后的价格 = 网下股票认购期最后一日的均价 / (1 + 每股送股比例) / (1+每股配股比例) (X)区域12月7) 5)除息目送股:调整后的价格 = (网下股票认购期最后一日的均价 - 每股现金股利或股息)/(1 + 每股送股

, 5)除息且配股:调整后的价格 = ( 网下股票认购期最后一日的均价 + 配股价×配股比例 - 每股现金股利或股 3.) // [1498] [18] // [1498] [18] // [19] //

(3) "有效认购数量"是指由基金管理人确认的并由注册登记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:

## $q^{max} - \left(Cash - \sum p_j q_j\right) \times 10^{3} \% \times \% / p_j$

其中,a<sup>mer</sup>为取为达到规模与并且不够设备。co应该的这种数量。co或为图: 基金认为在医不规会认为七台并申请教练,pp的先进限制体的规模的个证》提高。 着四人个部型部分位对一第二个股际外的具体个股本商下股票供助到最后。目的 战争》 he版本:2 表型整理。如今淡淡的内的计算也只当两个规模认识是最后。(1 在影的企物中自然重点的法规能的有益的法数调整分子,则是否企业人根据分类 《何·李后二·夏奇斯名羊·以及尼二指教籍引持规则》[\$(何·李后的尼的·李邦)] 物权量。 》: 步步的 医牙掌依据的 网络的现在医区投票认识某最后 人们的均衡。 四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,则按照各投资人的认购申报数量

基金券集制间募集的资金应当存人专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。募集的股票按照交易所基金券集制间募集的资金应当存人专门账户,在基金募集制间募集的流程为理股票的统律和过户。 是最全募集制间房间接的政策及《计师资·提尔费比及其他费用,不得从基金财产中列文。 (津师费以及其他费用,不得从 第七部分 基金合同的生效

一、基金备案的条件 本基金目基金份额发售之日起3个月內,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额(含网下股票认购所募 股票市值)不少于2亿元人民币且基金认购,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 决定停止基金发售,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

可以庆定停止基金发售,并在10日內期請法定验资机构验资。自收到验资报告之自起10日內,向中国证监会办理基金
基金募集法对基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金签案手续并取得中国证监会市面确认之日起(基金 品)主党: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》主处:在数单设于以 公告。基金管理人应准基金募集期间原集的资金在人专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。网下股 买认购募集的股票出位发售代理机构予以冻结。 一基金合同不能生业的募集资金的处理方式, 如果募集期限届满。未满足基金备条条件。基金管理人应当承担下列责任: 1.以其商和财产承担包募集行方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款项,并加计银行同期存款利息。对于基金募集期间网下股 买认购商等条件的要,发售产理机构应予以整体。 3.如基金募集使的要,发售产理机构。2018年。 1.以其商单的要,发售产理机构。2018年。 1.以其应等数集大行之一切费用应由各方全日再担。 三基金存结期内的基金价额特有人数量和资产规模 《基金合图》生效后、建设20个工作自出现基金份额特有人数量不满200人或者基金资产净值低于3000万元情形的 总金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前法情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并 提出被展为有级定约,从其规定。

法律法规另有规定时,从其规定。

(本年は死力有规定时,从具规定。 第八部分 基金份额折算与变更登记 基金合同生效后,本基金可以进行份额折算。 并全///wife/www.incom

:份额折算的时间 理心事先确定基金份额折算基准日,并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。 份额折徵的同则

第九部分 基金份额的上市交易

一。金並的和上印 基金合同生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》向上海证券交 申请基金份额上市; 1.基金募集金额(含何下股票认购所募集的股票市值)不低于2亿元; 2.基金价额持有人不少于1000人;

3.《上海证券交易所证券投资基金上市交易规则》规定的其他条件。 基金十市前、基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的,基金管理人 规制关规定交布基金上市交易公告书。

应按照相关规定发布基金上市交易公告书。

—基金的细胞上市交易
—基金的多色的瘤化上海证券交易所的上市交易须遵照《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放工物数基金业务实施组则》、以及《上海证券交易所交易规则》等有关规定。
三基金的独自充交易后有下列情形之一的、上海证券交易所交易规则》等有关规定。
:其金的细胞上克易。有下列情形之一的、上海证券交易所交易规则等有关规定。
1、不再具备本部分第一条规定的上市条件:
2、基金合同终生;
3、基金份密特有人大会决定终止上市。
4、基金合同约定的终止上市的其他情形。
5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。
5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。
若因上述1.3.4.3顶等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的,本基金将在履行适当程序后由交易但开放工基金更更为假聚间一种的指数的非上市的开放式指数基金、无需召开基金份额持有人大会审议。届时,基金管理人可变更本基金的注册登记机场并相应调整申购赎回业务规则,若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数价排数的指数的指数的排数是。则本基金符准者维护基金份额持有人合法权益的原则,选取其他合适的指数作为标的指数,排中国证监会各案并及时公告。
四基金管细参考单位的计算与公告
基金管理人在每一交易日开市前印中证指数有限公司提供当日的申购赎回清单,中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和经负不受条件各只证券的实时或交数据计算,并通过上海证券交易所发布基金份额参考单值(10FV),供投资人交易,申购,则但基金管价或价量的参考。
1、基金份额参考单值,中则,则是包套经价的营入金额,申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和,申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和,申购赎回清单中退入股份数金等价值(10FV),供收费分发量与最新成交价相乘之和,申购赎回清单中退入股份额次是分量,有以股级的发展,是多数的股份,更多数人的股份的数量,是多常是一个原则,使过对应的基金份额。

一、中學科學是到的 投资人应当在申购赎回代理券商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份额的申购与赎 基金管理人将在开始办理申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单,并可依据实际情况调整申购赎回代理

二、申购和赎回的开放日及时间 1.开放日及开战时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回。具体办理时间为上海证券交易所、深圳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。 基金合同产效后,活出更新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况或根据规令需要,基金管 理人有权税情况对前途开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指 经税金卜企业

张介上公告。 2.申购,赎回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,具体业务办理时间在相关公告中规定。 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在相关公告中规定。 本基金守在基金上市交易之的开始办理申唤,赎回(在在基金申请上市期间,可暂停办理申购。赎回 在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指

平然並「比較並上以入場之間/月月月月月日日 在衛定申與所任為學院用子始計同后、基金管理人应在申與、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指 定媒介上公告申與与赎回的原则 1.本基金采用份額申與和份额赎回的方式、即申與永赎回知以份額申请; 2.本基金分申與邓价、赎回对价生括组合证券、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、赎回应遵守上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定。 基金管理人可在法律注处允许的情况下对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息 披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。 2.申购和赎回的申请方式 投资人必须根据申购赎回代理券商规定的程序、在开放日的具体业多办理时间内提出申购或赎回的申请。 投资人必须根据申购赎回代理券商规定的程序、在开放日的具体业多办理时间内提出申购或赎回的申请。 投资人在提交申购申请时、须根据申购赎回清单备足申购对价、否则所提交的赎回申请方效。基金份额持有人提 交赎回申请时,必须持有足够的基金份额余额和现金。否则所提交的赎回申请无效、投资人办理申购、赎回等业务时 应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各申购赎回代理券 商的具体规定为准。

交懸回申請計。忽朔特有足够的基金份额余额和现金。否则所提交的赎回申请无效。投资人力理申詢、赎回等业务时
应接交的文件和小理手续,办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前揭下,以名申赖赎回代理券
商的具体规定为准。
2.申聆对赎回申请的确认
正常情况下,投资人的申购,赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价,则申购申
请失败。如投资人特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,则则和申请失败。
投资人可在申请当日通过某办理申询,赎回申请处等商查询有关申请的确认情况。
投资人可在申请当日通过某办理申询,赎回申请处等商查询有关申请的确认情况。
投资人明的以基金份额当日可卖出,当日申购当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回;投资人顺回获得的股票当日可卖出,即在目前结算规则下、T日申购的基金份额当日可卖出,T日申购当日未卖出的基金份额,T日用平购当日未卖出的基金份额,T日用中购当日未卖出的基金份额,T日年间的清算交收与6亿。
本基金申购赎回过程中涉及的基金份额,组合证券,现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业多实施租则》、《中国证券签记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式指数基金业多实施租则》、《中国证券签记结算有限责任公司关于上海证券交易所产务,及于本基金的申购业务采用净额结算和该定全额结算相对企业分量,发生并未是的中国业务采用净额结算和或定至全额结算相对企业分量,发生并未是的的基金份额及对应的强力证券交易所上市的成份股份现金替代采用逐年的。对于本基金的原回业务采用净额结算和代设化价料结合的方式。其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代、用服签任的。这种证券等,是则证券等的发生,是加强金差额的资量,是加于电路处于现金差额的交收,是加强金差额的交收,是加强金差额的交收,是加强企差额的交收,并将结果发送的申购或金替代的交收与申购当日来实出基金份额的交收各证的及现金差额的清算,在于14日办理现金差额的资量,在于14日办理现金差额的资量,在于14日办理现金差额的资量,在于14日办理服金差额的交收,并将结果发达的申购实现,并被重要公务所是不可的成份股级金替代的交收上及观查差额的通时的发出的重用申购取出。在当新完全分别完全的原则证据全多的方法和更现的股份。在一种联定的分别是的人对接的发行。是一种政策的自然,在一种政策是一种政策的自然,在一种政策的关键的,在一种政策的是数量,在一种政策的是被定的,是一种政策的现代。是一种政策的是一种政策的是一种政策的是一种政策的是一种政策的是一种政策的是一种政策的是一种政策的是对证,以对由助除

回清单中公告。
3.基金管理人可根据基金运作情况、市场情况和投资人需求,在法律法规允许的情况下,调整申购和赎回的数额限制。基金管理人必须在调整前依照(信息披露办法)的有关规定在指定媒介上公告。 六、申购和赎回的对价和费用 1.本基金份额种值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四含五人,由此产生的收益或损失由基金财产承担。11日的基金份额单值的主货、并在11日的基金份额单值在当天收市后计算,并在11日内公告。如遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并积中国证 60个多零 温会备案。
2. 申與对份是指投资人申與基金份額时应交付的组合证券,现金替代,现金差额及其他对价。 赎回对价是指基金份额持有,规恒基金份额时。基金管理人应交付的组合证券,现金替代,现金差额及其他对价。 3. 申以对价,赎回运金份额时,基金管理人应交付的组合证券,现金替代,现金差额及其他对价。
3. 申以对价,赎回运价根据申以赎担回洁单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。
申以赎回清单由基金管理人编制,可由申购赎回营单在当日上海证券交易所开市前公告。
4. 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0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易

所,注册·登记机构等收取的相关费用。 1. 申购赎回清单的内容与结式。 1. 申购赎回清单的内容与结式。 1. 申购赎回清单的内容包括最小申购、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日现金差额基金经额净值及其他相关内容。

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

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 的现金。
(1)现金替代分为4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"),必须现金替代志为"必须")和退补观金替代(标志为"退补")。
禁止现金替代适用于上海证券交易所上市的成份证券,是指在申购,赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现。

家正规途管行适用于上海证券交易所上市的成份证券,选指在中购,原归金查份额时,该成份证券不为针使用现。 途下为替代。 可以现金替代适用于上海证券交易所上市的成份证券,是指在中购基金份额时,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。 必须现金替代适用于所有成份证券,是指在中购,赎回基金份额时,该成份证券必须使用固定现金作为替代。 退料观金替代适用于照加证券交易所上的成份证券,是指在中购,赎回基金份额时,该成份证券必须使用现金 作为替代,根据基金管理人买卖情况,与投资人进行退款或补款。 1)可以现金替件。 ①适用情形:可以现金替付的证券一般是由于停牌等原因导致投资人无法在申购时买人的证券或基金管理人认 为可以适用的其他情形。目前仅适用于标的指数中的上海证券交易所提票。 ②谐传允金额,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,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,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,替代金额的计算公式为, 当年、"参与传常"目前为该证券前一交易目除级和最后的收盘价。 如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化,以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。 取取观金替长溢价的原因是,对于使用现金替代的证券,基金管理人,循证等恢复及易后买人,而实际买人价格 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 替代溢价化规则,并据此收取费替代金额。如果仍实收取一类等的实际成本,则是会是从各退

\$代溢价比例,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 5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 ◎音代本網的及近程程序 TFL基金管理人在甲烷胂但清单中公布现金替代溢价比例,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(简称为T+2日)内,基金管理人将以收到的替代金额买人被 ... 终,若已购人全部被替代的证券,则以替代金额与被替代证券的实际购人成本(包括买人价格与交易费

11-72-11号、"三国风·兰瑞典党首代的证券,则以管代金额与教管代证券印美师则人成本(包括头人的格与支急期)的差额。确定基金应退还投资人或投资人或投资人或补仓的实现,若未能购人金融被替作证券实际购人成本加上按照1+2日收盘价计算的未购人的部分被替代证券实价的总项。确定基金应退还投资人或投资人应补之的总项。 特例情况;若曰「日起、上海证券交易所正常交易日已达到90日而该证券正常交易日低于2日,则以替代金额与所纳人的部分被替代证券实际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人或投资人应补交的裁项。 日(T日)后至T+2日(若在特例情况下,则为T日起第20个交易日)期间发生除息、送股(转增)、配股

# 等权益变动,则进行相应调整。 T+2日后第十工作日(若在特例情况下,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及汇总 数据设送给相关申购赎回代理券商和基金柱管人,相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。 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。 现金替代比例(%) = $\sum_{i=1}^{n}$ 第 1 只替代证券的數量 $\times$ 该证券参考价格 $\times$ 100%

申购基金份额×参考基金份额净值 共平: 该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权赊息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变 化以上海证券交易所逾知规定的参考价格为难。 参考基金份额净值目前为该正下前一交易日除权除息后的收盘价,如果上海证券交易所参考基金份额净值计算 方式发生变化,以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

2)1必須班金替代 ①适用情形:必須現金替代的证券一般是由于标的指数调整,即将被剔除的成份证券;或处于停牌的成份证券。 律注规限制投资的成份证券;或基金管理人由于除护特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调整后T日开盘参考价。 3)退补现金替代

3 1退补现金替代 ①适用情形: 退补观金替代的证券目前仅适用于标的指数中深圳证券交易所股票。 ②替代金额:对于退补现金替代的证券: 替代金额的计算公式为; 申购的替代金额 = 替代证券数量、该证券项键系与日平最速多物个×(1 + 现金替代溢价比例); 眼间的替代金额 = 替代证券数量×该证券调整后日日开盘参考价×(1 - 现金替代溢价比例)。 ②抽料公鸡奶心理母时

順回的替代金額。替代迪莽發量×该证券调整后下日升盘参考价×(1 - 现金替代盗价比例)。 3替代金额的处理程序 对退补观金替代而言,申购时收取观金替代溢价的原因是,对于使用现金替代的证券,基金管理人将买人该证券,实际买人价格加上相关交易费用后与该证券调整后下日开盘参考价可能有所差异。为便于操作。基金管理人在申 數赎回海律中现法确定现金替代溢价化则,并提出收取替任德加。如果预先收取负金额而于基金购人该部分证券的 实际成本,则基金管理人将退还多处取的差额;如果预先收取的金额低于基金购人该部分证券的实际成本,则基金管理 14. 约束归状态,此程加大价处置。 等原成本、則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人该部分证券的实际成本,則基金管理人将的投资人收取欠缺的差额。 对退补现金替代而言,既即时对赊现金替代溢价的原因是,对于使用现金替代的证券,基金管理人将进供验证券得实际成本,则基金管理人在申 原账回清单中预先确定现金替代溢价比例,并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入,则基金管理人在申 规账回清单中预先确定现金替代溢价比例,并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入,则基金管理人将退还少支付的差额。 其中,调整后下日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的资格工盘参考的规定 基金管理人将自己或证到申赖交易确认后按照"时间优先"实却申报"的原则依次实人申购被替代的部分证券,在收到赎回交易确定后按照"时间优先"实时申报"的原则依次实人申购被替代的部分证券,在收到赎回交易所定后按照"时间优先"实时申报"的原则依次实上顺向被替代的部分证券,在收到帐回交易所定后按照"时间优先"实时申报"的原则依次实上顺回被替代的部分证券,下日未完成的交易,基金管理人在T日后被替代成的设计等有正常交易的个个多目内完成上述交易,时间优先的原则分,申则顺回方向相同的,先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上海证券多易所确让申顺服的时间确定。

T+2日后第1个工作日(若在特例情况下,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相关申购赎回代理券商和基金托管人,相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。 4. 加凸现金部分相長內容 預任現金部分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,预估现金部分由申 助赎回代理券商预先冻结。 其计算公式为: T日预估现金部分 = 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现金替代的固定替代金 1到的心脏部分 = 1 = 1 日取7中界哪些甲址的验证及1 = FIE = 1 中界%如出日平于22%处证日本1 以初出之目 1 > 2 数赎回汽油中起补现金替代放份证券的数量与该证并跟整日了 日开途参考的相梁之和,中取赎回清单中可替代成份证券的数量与该证券调整后T 日开盘参考的相梁之和+申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数

以與监督门风仍证券的数量与该证券问题后1 日 1 日本温多等的种理之相 1 中,以此或者以此,实的数量与该证券调整后1 日开盘参考价种理之和) 其中,该证券调整后1 日开盘参考价种理之和) 其中,该证券调整后1 日开盘参考价。 确定。另外,若1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。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。 5.现金差额相关内容 7日和金差级在7末日日总时服除回涂值由八头。其计管公式 3 九。 5.%或左颌衍环/196 班金差额在7-11日的申睒则回清单中公告,其计算公式为: T日现金差额 = T日最小申郸眺回单位的基金资产净值 - (申睒眺回清单中必须现金替代的固定替代金额 +

申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和 + 申购赎回清单中基止现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和 ) T日投资人申购。赎回基金份额时,需按T+1日公告的T日现金差额为于资金的清算交收。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。在现金多额为负数,则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金。在基金份额持有人赎回时,如现金差额为正数,则基金份额持有人赎回时,如现金差额为正数,则基金份额的有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举例如下:基本信息;

基金名称	国泰中证军工交易型	国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金				
基金管理公司名称	国泰基金管理有限公	国泰基金管理有限公司				
一级市场基金代码	512661	512661				
2016-6-13日内容信息	J:					
现金差额(单位:元)		¥2,029.00	¥2,029.00			
最小申购、赎回单位净值(单位:元)		¥1,018,109.0	¥1,018,109.00			
基金份额净值(单位:元)		¥1.0181	¥1.0181			
2016-06-14日内容信	息:					
最小申购、赎回单位的预估现	金部分(单位:元)		¥-9,155.00			
现金替代比例上限			50%			
申购上限			无			
赎回上限			500,000,000			
是否需要公布IOPV			是			

000561	烽火电子	500	深市退补	10%	5150.00
000733	振华科技	600	深市退补	10%	12066.00
000738	中航动控	800	深市退补	10%	20456.00
000748	长城信息	1100	深市退补	10%	18678.00
000748	中航飞机	1900	深市退补	10%	32528.00
	四川九洲	400	深市退补		
000801				10%	9132.00
000901	航天科技	400	深市退补	10%	14412.00
002013	中航机电	700	深市退补	10%	12460.00
002023	海特高新	900	深市退补	10%	13023.00
002025	航天电器	400	深市退补	10%	8244.00
002046	轴研科技	400	深市必须	-	4132.00
002049	同方国芯	600	深市退补	10%	23172.00
002111	威海广泰	200	深市退补	10%	5060.00
002151	北斗星诵	300	深市退补	10%	9597.00
002179	中航光电	500	深市退补	10%	20475.00
002214	大立科技	500	深市退补	10%	5675.00
002224	三力士	800	深市退补	10%	15784.00
002253	川大智胜	300	深市退补	10%	10314.00
002260	德奥通航	400	深市退补	10%	9640.00
002268	卫士通	400	深市退补	10%	12672.00
002297	博云新材	600	深市退补	10%	6966.00
002338	奥普光电	100	深市退补	10%	4915.00
002368	太极股份	400	深市退补	10%	12172.00
002413	雷科防务	700	深市退补	10%	8897.00
002414	高徳红外	400	深市退补	10%	9172.00
002414	海格通信	2500	深市必須		31100.00
				-	
002519	银河电子	300	深市退补	10%	6591.00
002544	杰赛科技	500	深市退补	10%	13915.00
300008	天海防务	300	深市退补	10%	8190.00
300034	钢研高纳	400	深市退补	10%	7880.00
300045	华力创通	500	深市退补	10%	9100.00
300053	欧比特	700	深市退补	10%	10773.00
300065	海兰信	300	深市退补	10%	10065.00
300101	振芯科技	700	深市退补	10%	17962.00
300114	中航电测	200	深市退补	10%	4668.00
300123	太阳鸟	300	深市退补	10%	3879.00
300123	新研股份	1300	深市退补	10%	19968.00
300177	中海达	400	深市退补	10%	5480.00
300252	金信诺	300	深市退补	10%	8571.00
300324	旋极信息	800	深市退补	10%	16880.00
300354	东华测试	100	深市退补	10%	2219.00
300447	全信股份	100	深市退补	10%	8110.00
600038	中直股份	400	允许	10%	-
600118	中国卫星	1000	允许	10%	-
600150	中国船舶	1200	允许	10%	-
600151	航天机电	1500	允许	10%	-
600184	光电股份	300	允许	10%	_
600271	航天信息	1900	允许	10%	_
600316	洪都航空	700	允许	10%	
600343	航天动力	600	允许	10%	
600343	中航电子	900	允许	10%	
				10%	
600391	成发科技	400	允许	-	
600435	北方导航	600	允许	10%	
600456	宝钛股份	400	允许	10%	
600480	凌云股份	500	允许	10%	
600482	中国动力	700	允许	10%	
600501	航天晨光	400	允许	10%	
600523	贵航股份	200	允许	10%	
600562	国客科技	400	允许	10%	_
600677	航天通信	600	允许	10%	_
600685	中船防务	400	允许	10%	_
600765	中航重机	800	允许	10%	
600765	度工股份	1000	允许	10%	-
600815		400		10%	
	航天长峰		允许		-
600879	航天电子	1400	允许	10%	-
600893	中航动力	1300	允许	10%	-
600967	北方创业	1100	允许	10%	-
600990	四创电子	200	允许	10%	-

下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

人。在把政党评评则证明形 发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请; 1.因不可抗力导致基金无法正常运作。 2.发生基金合同规定的管序基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 3.证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易。 4.接受某意或某些申购申请会验制或指示现有基金份额持有人制造的。 5.基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或证券市场价格发生大幅波动,或其他可能对基金业劳产生负而影响。或此具性他指实现是金分额的特别人国的特况。 6.基金管理人开市前因异常情况未能公布申歇姆回清单或开市后发现基金份额参考净值计算错误。 7.当日申购申请达到基金管理人是企场中的联份额上限的情况。 8.相关证券交易所,申购额回代理券商、基金管理人、基金托管人或注册登记机构的异常情况托基金管理人是还有 指数编制单位、相关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 法规则并不可控制的情形。包括但不限于系统故障。网络故障、通讯故障、电力故障、数据情况等。 9.法律法规矩定,中国证监会或上海证券交易所认定的其他情形。 发生除上选择47项以外的暂停申购情形。且金金管理人及定暂停申购时,基金管理人应到根据有关规定在指定媒 介上刊密暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除 月金管理人应及时恢复甲胂业多的办理。 九、暂停赎回或延缓之付赎回对价的情形 发生下处于经济工程。

价。
3.证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理赎回业务。
4.继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益时。
5.基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单或开市后发现基金份额参考净值计算错误。
6.当日赎回申请达到基金管理人及吃晚回份额上限的情况。
4.报关证券交易所,申购赎回代理券商、基金管理人、基金托管人或注册登记机构的异常情况无法办理赎回,或者
指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回销率;注金制或收编制不当。上选异常情况指基金管理人无 法预见并不可控制的情形。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。
8.法律法规规定,中国证监会或上海证券交易所几定的其使情形。
发生上还常见现外的情形已基金管理人决定暂停赎回或造缓支付赎回对价时,基金管理人应报中国证监会备 案、已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应报中国证监会备

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及注册机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基 金基金份额的投资人。 继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有 的基金份额捐额给福利胜质的基金会政社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人 持有的基金份额强制划转给其他自然人,法人或其他组织,办理非交易过户必须提供基金注册委记机构聚求提供的 相关资料,对于符合条件的非交易过户申请校基金注册登记机构的规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收

持有人将持有的基金份额在证券登记系统内不同会员单位之间进行转指定的行为 ,注册登记机构可依据相关法律法规及其业务规则,办理基金份额质押业务,并可

工一。基本时间59名和FFI的 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。 基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构

1919左规则。 2.在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人可以根据市场情况对上 购和赎回的安排进行补充和调整,也可采取其他合理的申购赎回方式,并在实施日前依照《信息披露办法》的有

二、投资范围 本基金主要投资于标的指数成份股、各选成份股、为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份 股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据 短期脑资券、超 短期脑资券。可转换债券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款等固定收益类品种、权证以及法律法规或中国证监 会允许基金投资的其他金融工具(但源符合中国证监会相关规定)。 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,本基金可将其纳人投资范 围,其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。 基金的投资组合比例为、本基金投资于标的指数成份股和各选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80% 且不低于基金资产净值的90%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

1.股票投资策略 本基金主要采用完全复制法。即按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份 填权重的变动而进行相应的调整。但即转探情况(加成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流 投生变化、成份股公司行为。市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整 基金管理人将对投资组合进行优化。尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下。本基金的风险控制目标是追求日均 编阁度的绝对值不超过。2%,年限赊误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致限综偏离度和 视差超过上达范围、基金管理人应采取合理措施服务服综偏离度,现误是进一步扩大。 2. 债券投资策略

2. 值券投资策略 基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券,央行票据和金融债等固定收益类品种,其目的是帐证基金资产流处性并揭高基金资产的投资收益。 3.资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素。坚持价值投资理念. 把握市场交易机会。在严格遵守法律法规的基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资。以期获得长期稳定收益。 4. 权证投资策略 本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究、结合权证定价模型寻求是全理估值水平,并积极利用正股机证汇之间的不同组合来塞取定风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征、通过资产配置。品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。 见 投资限制

四、投资限制 1、组合限制 1-34-176mm 基金的投资组合应遵循以下限制: (1)基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值

%; (2)本基金特有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%; (3)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过法权证的10%; (4)本基金在任何交易日买人权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%; (5)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%; (6)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%; (7)本基金持有的一、指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过速资产支持证券,和模的10%; (8)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,排偿的10%;

合计規模的10%; (9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(合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。应在评级担告发布之日起3个月内予以全部卖出; (10)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报发行股票公司本次发行股票的总量、 (11)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;

限为1年,债券回购到期后不得展期; (12)本基金资产总值不超过基金资产净值的140%; (13)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资; (14)本基金参与融资的,每个交易日日终,本基金持有的融资买人股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;

资产净值的95%;
(15)本基金参与转融通证券出借交易的、每个交易日日终、本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%。证券出借的平均剩余期限不得超过多大。平均剩余期报按照市值加权平均计算。
(16)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。
因证券市场成功、证券发行人合并、基金规模变动、筛价情数成份股调整、筛价销数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素效使基金投资比例不符合上达规定投资比例的。基金管理人应当在10个交易日均进行调整,但中国证监会规定的特殊情形缘外。法律法规项有提定时,从其规定基金管理人应当自基金合同中效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的分分定。期间、进入资产服务的投资组合比例符合基金合同的分型。基金经营人对基金投资的监督与检查自基金合同生效之日起不始。
投资范围及资源路应当符合基金合同的效定。基金任管人对基金投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。
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:

7所尹帝培之成以日本575次, )向其基金管理人、基金托管人出资; )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; 6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 法律、行政法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人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重大利害关系的公