(上接B15版)

(Lf.gc15)成) ,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。基金特有资产 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 月内予以全部零出;

月內下以全部突出; ,本基金管理人管理,且由本协议项下杆管人托管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%; k.若本基金等与国债期货和股捐期货交易的,需遵守下列投资比例限制; i.本基金金任任何交易日食。持有的买入股捐期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;持有的买人国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%; ii.本基金任任何交易日日终,持有的实出股捐财资合约价值不得超过基金持有的 股票总市值的20%;持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

股票总市值的20%; 持有的突出国债期货合约价值不得超过基金符有的侦券总市值的30%;
iii. 本基金在任何交易日內交易(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%; 在任何交易日內交易(不包括平仓)的国债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30%。
iv. 本基金在任何交易日日失。持有的买人国债期货和股指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。买人返售金融资产(不含质押式回购)等。v. 本基金所持有的股票市值和买人。卖出股指财货合约价值。合计(私差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定; 基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买人、卖出围墙期货合约价值,合计(私差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定。v. 本基金每个交易日日终在扣除国债期货和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。
I. 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%; m. 开仓类出认油股票期权的。应持有经济行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物; n. 未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上选限制。
(3)法规允许的基金投资比例调整期限
由于证券/期货市场波动。证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成分股调整、标的指数成分股调整、标的指数成分股调整、基金管理人心产的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例。不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。
基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下,至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和基金管理人应对措施,便于基金托管人实施交易皆够。

易监督。 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。上述期间内,本基金的投资范围应当符合基金合同的约定。基金托管人对

基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。 3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止

工选规定的限制。 4.基金柱管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

行时间房市功远行监督。 (1)基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险 控制措施进行监督。 基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的

名单,并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结婚方式。 基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单,基金管理人应定期或不定 期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新,名单中增加成成少银行间市场交

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.认购手续:
投资者直接通过发售代理机构办理认购。
(1) 开立上海证券交易所A.股账户或证券投资基金账户。
(2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
(3) 投资者可通过填写认购委托单。电话委托、密卡委托、网上委托等方式申报认委托、可多次申报、申报一经确认、认购资金即被冻结。
(二) 阿下现金认购
A.直销制机图
1.认购时间;2016年7月11日至2016年7月22日9;00—17;00(周六、周日及节假日不理)。

。 、以购限额;网下现金认购以基金份额申请。投资者通过基金管理人办理网下现金 5,每笔认购份额须在5万份以上(含5万份)。投资者可以多次认购,累计认购份额不

受理 1。

2.认购限额: 网下现金认购以基金份额申申。12,以当 3.44
认购的: 每笔认购份额须在5万份以上(含5万份)。投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限。
3.认购手续:投资者可以到基金管理人直销中心提供下列资料办理基金的认购手续。
(1)个人投资者需提供的证明文件包括:
1)有效身份证许原件及正页面互印件;
2)银行借记卡或存折原件及复印件;
3)上海证券账户(A股账户或证券投资基金账户)原件及复印件。
(2)机构投资者需提供的证明文件包括:
1)加盛机构公章的(机构投资者风险疾受能力评估问卷);
2)加盛机构公章的(机构投资者风险疾受能力评估问卷);
2)加盛机构公章的(大量业从服。组织机构代码证及税务登记证复印件;
3)加盛机构公章的(预留印鉴卡);
4)加盛公章的经营代表人私章的《基金授权委托书》;
4)加盛公章的经营代表人私章的《基金授权委托书》;
5)加盛公章的选定代表人和章的《基金授权委托书》;
6)加盛公章的经定代表人和章的《基金授权委托书》;
6)加盛公章的经定代表人和章的《基金报》(作真交易协议书》;
6)加盛公章的经定代表人和章的《基金报》(扩展印件:7)加盛公章的部级经办人有效身份证件正反面复印件;
8)加盛公章的规格分人有效身份证件正反面复印件;
8)加盛公章的预留银行账户的开立证明文件复印件。
1. 在512 幸运的预留银行账户的开立证明文件复印件。
1. 在512 幸运产业品的条金银行认可的付意

式,划人本公司指定的直销资金专户:

开户银行:浦发银行卢湾支行银行账号:98990153850000015人行支付系统行号:310290000290

账户名称:汇添富基金管理股份有限公司直销专户

账户二: 账户名称:汇添富基金管理股份有限公司直销专户 开户银行:招商银行上海徐家汇支行 银行账号:121902331810623 人行支付系统行号:308290003100

账户三: 账户名称:江添富基金管理股份有限公司直销专户 开户银行;中国工商银行上海分行营业部 银行账号;1001202929025807250 人行支付系统行号;102290020294 5.注意事项;

3.认网宇统: 投资者直接通过发售代理机构办理认购。(1)开立上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户。(2)在认购前向资金账户中存人足够的认购资金。

金认购的委托申请书。申报一经确认,认购资金即被冻结。

8 加盡公童的獨留银行账户的开立证明文件复印件。 9)上海证券账户(A股账户或证券投资基金账户)复印件(加盖公章)。 4 认购缴款:投资者申请认购本基金,应首先将足额认购资金以银行认可的付款方

之。 投资者在认购时不能使用汇添富基金管理股份有限公司开放式基金账户,而需 7投资有住1/1969年/1968

专户,则当日报交的申请无效。 专户,则当日报交的申请无效。 3)投资者若未按上述规定划付款项、造成认购无效的、汇添富基金管理股份有限公司及直销网点清算账户的开户银行不承担任何责任。 3.友告代理机构 1、认购时间:2016年7月11日至2016年7月22日(周六、周日及节假日不受理),具体 2.认购限额; 网下现金认购以基金价额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的, 每笔认购的额须为1000份或其整数倍, 具体请遵循各发售代理机构的规定。

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

(3)基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理

流過聚則证券。

(3)基金管理人店在基金首次投资流過受限证券前。向基金托管人提供经基金管理人董单条批准的有关基金投资流過受限证券的投资決策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票、基金管理人还边提供基金管理人革免税性的流动性风险处置预案。上述资料的应括日本限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资的投资额度和投资人民经营预察。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料于面发至基金长管人反应证券任基金投资流通经限进行审核。基金任管人应在收到上述资料、一个人工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认做到上述资料。

(4)基金投资流通受限证券前,基金管理人应由基金托管人是在收到上该资料、约定期,基金投资流通受限证券的基金管业人应应量上等人提供符合法律法规要求的有关书而信息。包括但不限于和发行证券主体的中国证监会批准文件、步行证券增量发行的格、锁定期,基金担认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通变限证券市值占资产净值的比例、资金划价时间等。基金管理人应保证上述信息的资实、完整,并应至少于和技行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人及使用人无资率完全地不仅有发票等流通受限证券有关问题的通知规定,对基金管理人是依如有任务主告的有复。 法是任管人人以上还资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券出售的风险评估批告等各查资理人提供的有关书面信息。基金任管人以为上该资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券出售的风险评估报告等各查资料的权利。否则人风险管理部订算基金投资流通受限证券出售的风险评估报告等各查资料的权利。否则人或经管理证的技法全限企业等现代的企业,是在任何方位,其有权报告中国证监会。如果基金任管人及实现行监管职责,则实现全经营,应及利益各种发生,但未是全任管人及发展行监管职责,则实现全经营,应及利益各种产,应收费全部发表金费用开支及收入确定,基金统管,如果基金任管人发明起金管理人的投资运作及其他运作适应,对基金资产净值计算,基金分额净值计算,应收资金等则、基金费用开支及收入确定,基金价值,基金价值,其金经营,从收到通知后还在下一个工作日及时核效,并以书面形式通知基金管理人收到通知后还在下一个工作日及时核效,并以书面形式通知基金管理人收到通知后还在下一个工作日及时核效,并以书面形式通知是金管理人收到通知后还在下一个工作日及时核效,并以书面形式通知发金管理人收到通知后还在下一个工作日及时核效,并以书面形式通知发金管理人收到通知后还在下一个工作日及时核效,并以书面形式通知,是金径的人发出的证据,是一个工作,以是全位,是金径的人发出的证据,是一个工作,是一种工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一种工作,是一

在限期內、基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期內纠正的、基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义多要求基金管理人股偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。对于依据交易程序结成变的且基金任管人在交易能够能够监控的投资格。基金任管人发现该投资指令违反关注律注规规定或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。
对于必须计估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的,应当证即通见基金管理人,并报告中国证监会。基金管理人原报报告和表现基金长管人的监督和核查、必须在规定时间内答复基金任管人并改正、就基金托管人的联及进行解释或举证、对基金托管人按照法规定来简中国证监会报送基金监管程告的,基金管理人原根据全线报资料和制度等。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会同时通知基金管理人同时通知基金管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会同时通知基金管理人限明认证。

基金管理人无正当理由, 拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取 拖延,欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监管,情节严重或经基金托管人提出警告仍不 改正的,基金托管人应报告中国证监会。 二.基金管理人对基金托管人的业务核查 基金管理人对基金托管人则有计管取请信还进行核查, 核查事项包括但不限于基金 托管人安全保管基金财产,开设基金财产的资金账户,证券账户和期货账户等投资污需的 账户,复核基金管理人计算的基金资产净值和基金财产的营金账户,证券账户实行分账管理,无故 共行或大流还过的方基金管理人等创资处定作等行为。 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产,未对基金财产实行分账管理,无故 共行或大流还过的方基金管理人资金财资协会。泄露基金财产实行分账管理,无故 大行或大流还过的方基金管理人资金财资协会。泄露基金投资信息等证反《基金法》、 (基金合同》,本行管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书而形式询互集会全 管人限期知正,基金任管人投到通知后应及时核对确认,并以节而形式向基金管理人 同函、在职期内,基金管理人有权酬时对通知率项进行复查,管促基金杆管人改正,并予协 助配合。基金任管人对基金管理人通知的违规率项末能在职期内公正的,基金管理人应 报告中国证监会。基金管理人有义务要求基金托管人份偿基金因此价遭受的损失。 基金管理人更基金柱管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会各种银行业监督

机构,同时通知基金托管人限期纠正。 基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基 金管理人核查托管财产的完整性和真实性、在规定时间内容复基金管理人持改正。 基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,或采取 拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不

想述、姚F等于双列的接张直接入近17年以加督、前 17 里及左接张自译入按印音百四个设定的,基金财产保管 四、基金财产保管 11.基金财产保管的原则 1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。 2.基金托管人应安全保管基金财产。未签基金管理人的正当指令,不得自行运用、处 分分配基金的任何财产。

需的账户。

4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,与基金托管人的其他业务和 其他基金的托管业务实行严格的分账管理,独立核算,确保基金财产的完整与独立。 5、对于因基金认(申)购,基金投资过程中产生的应收财产,应由基金管理人负责 与有关当年、施定到账日期并通知基金托管人、到账日基金财产没有对达基金托管人处的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行健收。由此给基金造成损失的,基金 管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对此不承担责任。

(二)募集资金的验证 基金募集財繭或基金停止募集时,募集的基金份额总额,基金募集金额(含网下股票 从购所募集的股票按基金合同约定的估值方法计算的价值),基金份额持有人数符合 (基金法)、(运作功法)等有关规定后,基金管理人对将募集的属于本基金制产的全部资 愈划人基金并管人为基金开边的资产任管专户中、登记机构应将阿下股票以购所募集到 的股票划人以基金并管人和基金联名方式开立的证券帐户下,基金并管人在收到资金和 股票当日出展确认文件,同时由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所 进行验资、出具验资报告,出具的验资报告应由参加验资的2名以上(含2名)中国注册会 计师签字名称。 高等有效。 若基金募集期限届满,未能达到《基金合同》生效的条件,由基金管理人按规定办理

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性管务户进行。 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 管理人不得根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 进行本基金处义以的许元

6 理人ハヤがは日本のおというが正式の 送行本基金がより以外的活动。 茂戸托管や戸的管理処符合 (人民币銀行結算帐户管理办法)、(現金管理暂行条例)、(人民币報行指算水)、(支付結算办法)以及银行业监督 管理和松的技能規定。

例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。
(四)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基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司深到外公司开设班券账户。基金托管人的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计方本基金业务以外的活动。
(五)债券托管账户的开立和管理人负责以基金的名义申请并取得进人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 管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合匹配及资金的清算。
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间购主协议,正本由基金托管人保管、基金管理人保存副本。(六)其他账户的开设和管理在本托管协议订立日之后,本基金被介外从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的生使投资品种的投资业务时,如果涉及用实账户的开设和使用。由基金管理人协助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计管理。

用并管理。 (七)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、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于 基金民产人保管库。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果群营业中心的代偿管库、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 组工的对物证券市性专任等人保管服务的根据。基本由业产的需求企业由,其本任务 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。

门15年以上。 五、基金资产净值计算和会计核算

五、基並則,呼值以界中区川夜界 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 资产净值限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位四舍五人,由此产生的误差计人基金财产。。

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,读与本基金有关的会计问题,仍必相关多方产平等基础上考入计论后。仍无法达成一级的意见,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。如有新增率项,按国家成前规定价值。 大基金份额持有人名册的设计与保管的基金份额持有人名册、包括《基金合同》生效日、基金管理人和基金托管人项分别妥等保管的基金份额持有人名册、包括《基金合同》生日、基金份额持有人人会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人人是对益登记的。每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人人会对益登记的。每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人人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

有的基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管,基金份额持有人名册由基金的基金登记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。基金份额登记机构的保存期限自基金账户销户之日起不得少

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益登记日、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接交;《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。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 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。

有不达地的处态目外处性处的对比。 七、争议解决方式 相关名为当事人同意。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、仲裁的地点在北京市,仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力,仲裁费用由贩 诉方证担。

第2次里期间,相关各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理

本协议受中国法律管辖。
第二十二部分 对基金份额持有人的合法权益。
第二十二部分 对基金份额持有人的股务
对于基金份额持有人,基金管理人将根据具体情况提供,系列的服务,并将根据基金份额持有人的高级和市场的变化,增加或变更服务项目。上要服务内容如下:
一、客户服务中心电话服务
基金管理人客中服务中心推供24 小时自动语音查询服务,基金份额持有人可查询基金净值、基金产品与服务等相关信息。
客户服务中心在每二二件日提供不少于12小时的人工咨询服务。基金份额持有人可查询进金管理人全国提、客服烧线。400~888~918(免长途话费)享受业务咨询、信息查询信息定制,通讯资料修改,投诉建议等多项服务。

基金管理人客户服务中心负责受理投诉,并承诺在收到投诉后24 小时(工作日)之 内做出回应。

内做出回应。四、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容,可通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前、您·贵机构已经全面理解了本招募说明书。 第二十二部分 其他应披露事项 本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露,并在指定媒介上公告。第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式 本基金招募说明书存放于基金管理人、基金杆管人根金销售机构的任所,供公众查阅、复制。基金投资者在支付工本贵后,可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件、基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

内容完全一致。 投资者还可以直接登录基金管理人的网站 (www.99fund.com) 查阅和下载招募说明

第二十五部分 备查文件
- 本基金备查文件包括下列文件:
1.中国证监会准予中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金注册的文件;
2.《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同);
3.《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同);
4.法律意见书;
其金等型上级工程和

+、伝庠思见力; 5、基金管理人业务资格批件、营业执照; 6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、注册登记协议; 8、中国证监会要求的其他文件。

二、备查文件的存放地点和投资者查阅方式: 以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间可供免费查

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

2.认购于班: (1) 开立上海证券交易所A 股账户办理指定交易或转指定交易。 (2) 在上海A股账户中具备足够的符合要求的中证上海国企指数成份股和已公告的

成份股。 (3)投资者填写认购委托单。申报一经确认,认购股票即被冻结。 4、特別提示、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 行因股票认购导致的股份减特所涉及的信息披露等义务。

可關行位股票认购导致的配价與付所必及均同总级确守不少。 **六.清等与交割** 通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息,将折 算为基金份额归投资者所有,其中利息转份额以宽记机构的记录为准。网上现金认购的 超过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构商党交收后至划人基 金托管专户前产生的利息,计人基金财产,不折算为投资者基金份额。网下股票认购所 募集的股票在网下股票认购日至登记机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归

分额的权益登记由本基金注册登记机构在募集结束后完成注册登记。

七、專集费用

木次基金募集过程中所发生的与基金有关的法定信息披露费、会计师费和律师费等募集费用从基金认购费用中列支,不从基金财产中立付。 若在募集期结束时,基金仍不能满足法定备案条件,则募集费用由基金管理人承担。

八、基金的验资与备案

发售期截止后,由基金管理人委托具有资格的会计师事务所对认购资金和股票进行验资并出具验资报告,基金注册营证机构出具认购户数证明。
若基金符合法定备案条件,基金管理人承担全都募集费用,并将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集则及重基金备条手续后,发布基金合同生效公告。
若基金符合法定备案条件,基金管理人承担全都募集费用,并将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内划出,退还基金认购人,发售代理机构将已冻结的股票解冻。

九、本次募集当事人或中介机构 (一)基金管理人 名称: 汇添富基金管理股份有限公司 注册地址: 上海市賣浦区大沽路288号6幢538室 办公地址: 上海市南坡路99号震且国际大楼22楼 注定代表人,李文 电话: ((21) 28932888

专真:(021)28932998 図址:www.99fund.con

B子邮件:service@99fund.com 二)基金托管人 名称:中国工商银行股份有限公司 主册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日 法定代表人:易会满

方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层 法定代表人:潘鑫军 联系人:胡月茹 封详...

乐路989号45层(邮编:200031)

申万宏源证券有限公司 中文名称: 申万宏源证券有限公司 英文名称: \$henwan Hongyuan Securities Co., Ltd. 注册资本:人民币390亿元 注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层 (邮编:2

电话委托:021-962505 国际互联网网址: www.swhysc.com

电话:(021)28932823 传真:(021)50199035 联系人:陈卓膺 客户服务电话:400-888-9918(免长途话费)

网址:www.99fund.com 3、网下现金和网下股票发售代理机构 1)东方证券股份有限公司 注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层 法定代表人:潘鑫军 联系人:胡月茹

联系人:胡月茹 电话:021-6332588 传真:021-63326729 客户服务热线:95503 宋方证券假始:www.dfcq.com.cn 2)光大证券股份有限公司 注册地址:上海市静安区新闸路1508号 法定代表人:薛峰 联系人:刘晨,李芳芳 电话:021-22169134 安户服务电过:95555.4008888788 10108

5周自山か成が自成な日 | 佐川地址|| 深圳市罗湖区虹岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 | 水公地址|| 深圳市罗湖区虹岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层 | 法人代表人。何如 基金业务联系人:齐晓燕

传真:0755-82133952 全国统一客户服务电话:95536 公司网址:www.guosen.com.cn 4)华泰证券股份有限公司

各版代点:3737/ 例址:www.htsc.com.cn 5)平安证券有限责任公司 注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层; 办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层; 法定代表人:谢永林

主册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼

吹水人:子巍 7)申万宏源证券有限公司 中文名称:申万宏源证券有限公司 英文名称:ShenwanHongyuanSecurit 注册资本:人民币330亿元 注册员举:八民市330亿元 注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层 办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层(邮编:200031) 法定代表人:李梅 专真:021-33388224 客服电话:95523或4008895523 电话委托:021-962505 国际互联网网址:www.swhysc.com 联系人:黄莹 8)中国银河证券股份有限公司

7.) — 1847 14 79 X 20 14 79 X 20 1 注册地址: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

办公地班::北京田中国城区亚融人自35节国小正业 法定代表人。除有安 开放式基金咨询电话: 4008-888-888 开放式基金必身传真:1010-6568890 联系人、田被 联系电话: 1010-6568430 网址: www.chinastock.com.cn 9招商证券股份有限公司 法进册地址: 澳圳市福田区益田路江苏大厦A座38-位表上、官少林电话:0755-82943666 传真。0755-82943666 联系人。林生迎 客户服务电话: 95565,400888111 公司网址: www.newone.com.cn 4,周上现金发售代理机构 投资者可量按通过具有基金代销业务资格及上

公司刚址:www.newone.com.cn
4、网上现金类量代理机构
投资者可复集代理机构
投资者可复集的工作工程。在1。实信证券股份有限公司、北京高年证券有限责任公司、教验证券有限责任公司、实信证券股份有限公司、北京高年证券有限责任公司、实信证券股份有限公司、北京高年证券有限责任公司、实信证券股份有限公司、长证证券股份有限公司、以前证券股份有限公司、以前证券股份有限公司、大项国端证券股份有限公司、大项国端证券股份有限公司、大项正券股份有限公司、大项证券股份有限公司、大项证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、东河证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、国营证券股份有限公司、国营证券有限责任公司、国参证券股份有限公司、华海证券股份有限公司、华海证券股份有限公司、华海证券股份有限公司、华岛证券有限责任公司、华海证券股份有限公司、华岛证券有限责任公司、华岛证券和联责任公司、军司、北海证券股份有限公司、华岛证券有限责任公司、年龄证券股份有限公司、非公证券股份有限公司、非公证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券有限公司、市营证券有限公司、市营证券的有限公司、市营证券的有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券股份有限公司、市营证券有限员任公司、东口证券有限责任公司、中国国国际金融股营任公司、中国国国际金融股营任公司、中国国国际金融股营任公司、中国国国际金融股营任公司、中国国国国金融股营任公司、中国国国国营证券的有限公司、中国国国际金融股营任公司、中国国国际金融股营任公司、中国国国际金融股营任公司、中国国国际金融货任公司、中国国国际金融货公司、中国国国际金融货任公司、中国国国际金融货公司、中国国市货公司、中目证

有限公司(排名不分先后,以上交所发布为准)。 (四)登记结算机构 名称:中国证券登记结算有限责任公司 住所:北京市西城区太平桥大街17号 办公地址:北京市西城区太平桥大街17号 法定代表人,周明 联系由述:010~58598319

办公地址:北京市产城区太平桥大街17号 注定代表人,周明 联系电话:010—S8598839 传真:010—S8598890 联系人:朱立元 (五)律师事务所和经办律师 名称:上海市镇城中路68号时代金融中心19楼 负责人:南卫锋 电话:(021)31358666 传真:(021)31358666 传真:(021)31358660 经对理师:黎明,陈颢华 联系人,陈夔华 (六)会计师事务所和经办注册会计师 名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 盲席台伙、吴港平 住所:北京市东城区东长安街:号东方广场东方经贸城安永大楼16层 即公编码:100738

引电话:(010)58153000 公司传真:(010)85188298 签章会计师:徐艳、汤骏 -、网下股票认购清单

十、网下股票认购清单 本基金聚集期间,网下股票认购名单如下表所示,但是聚集期结束前已公告的将被 调出中证上海国企指教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 购目前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 个工作日公告限制从购规模的个股名单。通过基金 管理人进行例下股票认购期间价格被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。募集结束前,如标的指数成份股出现调整, 则调入名单中的股票将也换入认购商库也

放張刊的	放売间析	胶壳飞的	放売间析	放汞代码	胶景间粉
600104	上汽集团	600278	东方创业	600119	长江投资
600170	上海建工	600629	华建集团	600626	申达股份
601727	上海电气	600827	百联股份	600612	老凤祥
600018	上港集团	600748	上实发展	600841	上柴股份
600606	绿地控股	600637	东方明珠	600825	新华传媒
600649	城投控股	600848	上海临港	600773	西藏城投
600623	华谊集团	600618	氯碱化工	600616	金枫酒业
600820	隧道股份	600835	上海机电	600822	上海物贸
600754	锦江股份	600895	张江高科	600636	三爱富
600000	浦发银行	600662	强生控股	600284	浦东建设
600597	光明乳业	600648	外高桥	600621	华鑫股份
600009	上海机场	600630	龙头股份	600833	第一医药
601607	上海医药	600834	申通地铁	600628	新世界
600741	华域汽车	600073	上海梅林	600819	耀皮玻璃
600663	陆家嘴	600708	光明地产	600824	益民集团
601211	国泰君安	600651	飞乐音响	600097	开创国际
600837	海通证券	600639	浦东金桥	600622	嘉宝集团
600642	申能股份	600650	锦江投资	600838	上海九百
601601	中国太保	600675	*ST中企	600692	亚通股份
600676	交运股份	600619	海立股份	600843	上工申贝
600826	兰生股份	600602	仪电电子	600679	上海凤凰
600958	东方证券	600604	市北高新	600272	开开实业

以事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》,更换基金管理人、更换基金行管人、与其他基金合并,法律法规及《基金合同》,规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(三) 岡下股票认购 (二) 岡町也2016年7月11日至2016年7月22日上午9:30—11:30 和下午1:00—3:00 (周六,周日及竹飯日不受理),具体业务办理时间以各发售代理机构的规定为准。

3)投资者投资人填写认购委托单同时填写委托该发售代理机构代为办理网下现

(19中项。 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在 份额持有人大会召开前及时公告。 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。 2.议事程序

14年八人云下山的铁区的双刀。 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

(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2个工作日内在公证机关监督下由召集人绕计全部有效表决。在公证机关监督下形成

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

(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特有人和代理人中选举两名基金份额特有 代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额特有 日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

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 (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,重新清点后,重新清点后,大会主持人应当场公布重新清点结果。 (4)计算过程应由公证的优美宁以公证基金管理人或基金管包入担不出席大会的,

1891,深进1加昌时3·748-754 公1980年 (八)、生效与公告 基金份额持有人大会的决议日录决通过之日起生效。 基金份额持有人大会的决议日录决通过之日起生效。 基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。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 "公然"写从生

7月237773。 7月10. 太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

(一)基金收益分配原则 1、每一基金份额享有同等分配权; 2、本基金收益分配采用现金方式;

3、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到196以上时,可进行收益分配。在收益评价日,基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算,计算方法参见《招募说明书》; 4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为

(1)现场开会 在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人 禁后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议,大会主持人为 基金管理人授权阻局会议的代表,在基金管理人授权代表亦能主持大会的情况下,由基 基代管人授权其出席会议的代表主持,如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代 表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一 以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之 持人,基金管理人和基金托管人担不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额 持名,基金等理人和基金托管人担不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额

審並問報付刊《刊行专印整並的創門》,表校於 基金份翻特有人大会決议分か一般決议和特别決议: 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 分之一以上(含二分之一)通过方为有效。除下列第2项所规定的须以特别决议通过 规以价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 5分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除《基金合同》另有约定外、转换基金运 7式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以 ⊪读设通过方有效。

作万元、更换基金管理人或看套或几目八公生出40%口下90%了中国30% 特别决议通过方有效。 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。 来取通时方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会 议通知中规定的确儿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, 但应当计人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、 该项语表让。

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把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。

44 问公日。 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 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

等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如此中、以中性广、农快软件等规定,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经对负数,规监管机关并提前效相关内各被取消或更好,基金理人经与基金托管人协商一致,规监管机关并提前公告后,可直接对本部分内各进行能次和周围、无需召开基金份额持有人人会审议。 三、基金份额收益原则、执行方式

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。 (四)基金收益分配中发生的费用 收益分配均发生的费用

基金的指数许可使用费; 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

H=E×0.45%÷当年天数

11、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

日为绿口巡灯使的基金官建筑 E为前一日的基金资产单值 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,经基金托管人复核后于次月盲日起2个工作日内从基金财 产中一次性支付给基金管理。。若遇法定节假日,休息日或不可抗力致使无法按时支付 的,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 下作口中支行

-1-173 [7]。 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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法

H=E×0.10%-当年天数 H为每日应计据的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费目计算。逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管 这基金托管费切款指令,基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金附产 次性支取,若遇法定节假日,株自由城下可抗力鼓使无法被时支付的,顺延至法定 程日,休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力鼓使无法被时支付的,顺延至法定 度日,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.基金的指数许可使用费数 基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署

基金合同生欢后的称的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署 諸數使用许可协议的约定从基金财产中支付。称的指数许可使用费按前一日的基金 等值的90.3%的年费举计提,计算方法如下; H=E × 0.03% - 当年天数 H 为每日应计提的标的指数许可使用费 E 为前一日的基金资产等值 标的指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算,逐日累计,按季支付。由基 逐期。目标的表面是是一个专家。

企业,1967年196日,1968年196日,1968年196日,1968年1969年20日,

具体计算方法及支付方式。 上述"一"基金费用的种类"中第4—11项费用、根据有关法规及相应协议规定、按 费用实际支担金额列人当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。 (三)不列人基金费用的项目

/損失. 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

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

17。 标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元,若计费期间不足一季度 的,则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。 的工程数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式 等发生调整。本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。基金管理人 将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的标的指数许可使用费费率、

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.45%年费率计提。管理费的计算方法如

法定代表人:许建平 电话:010-88085858 客户服务电话:400-800-0562

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005 《(邮编:830002)

投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形

当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行

5.示证1.72
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有活动;
(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,但是中国证监会另有规定的除外;
(5) 向其基金管理人、基金任管人出资;
(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) 法律、行政法规和中国证监会规定攀让的其他活动。
基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金任管人及共控股股东、实际控制人、著与其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、或者从事他重大关策交易的。应当符合基金的投资目标东投资策略、遵循基金份额持有人利益、先的原则。防范利益冲突、建立隆全内部审批的制利评估机制、按照市场公平合理价执行。相关交易必须事先得到基金任管人可以计划的制和评估机制、按照市场公平合理价执行。相关交易必须事先得到基金任管人工以上的独立董事通过。基金管理人建会企至少每半年对关策交易事项进行审查。
如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定、基金管理人在履行适当程序后可不生上述规定的限制。

六、基金资产净值的计算方式和公告方式

(一)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)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 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 填,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 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 公公格。

(2)交易所上市实行净价交易的债券装估值电收盘价或第三方估值制水提供的相应品种当日的估值净价估值,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,表通近交易日的收益价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值,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代市价分重大变化因素,调整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代方价分重大。(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盈价或第三方估值机根提供的相应品种当日的估值全价被表估物或法债券收益价或估值分价。 相应品种当日的估值全价或法债券收益价或估值分价。所以第三方估值机根提供的分涉行估值,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,按最近交易日债券的成绩第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收益价或估值全价中所含的债券或收利息得到的净价进价值。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;

紅大変化的,可多方类以及如时中20元1月10日。全人公允价格:
(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 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 青况下,按放本估值。
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 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 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 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 关键定确定公允价值。

关规定确定公允价值。 3、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

4、交易所上市的股省明货合穷。以采店值日在交易所往陕即结果价值。 佔值日尤交易的以最近交易的的结算价。 如法律结婚物。一局有难吃的、从其附定。 5、本基金投资股票期权合约,一般以股票期权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。 6、国债期货合约以估值日的结算价值值。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、采用最近交易日估算价格值。 价值为成未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。 如法律法规今后另有规定的,

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 相关进律注照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。 本基金的基金会计预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计论后,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。

汇添富基金管理股份有限公司

(二)估值程序
1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四金五人。国家另有规定的,从其规定。基金管理人每个工作日计算基金资产单值及基金份额净值,并按规定公告。
2、基金管理人每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发基金任管,交基金任管人复核无误后,由基金管理人校规定对外公布。
(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单值,基金份额净值。
在开始办理基金份额申的或者赎回后,基金管理人应当在9个开放日的次已,通过网站,基金份额申的或者赎回后,基金管理人应当在9个开放日的次已,通过网站,基金份额申阅或者赎回后,基金管理人应当在9个开放日的次已,通过网站,基金份额单值。 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 這。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 基金份额累计净值含载在指定媒介上。

□、率业台问时)受更、终止与基金财产的清算 (一)(基金合同)的变更 1、变更基金合同涉及注律法规规定或本基金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。 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行,自决议生效 2、天子《基金台间》变更的基金份额符有人大会决议生效后方可执行,自决议生效 后2日内在指定媒介公告。 (二)《基金台同》的终止事由 有下列情形之一的、《基金台同》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 无缺的。

3、《基金合同》约定的其他情形;
4.相关注相法规和中国证监会规定的其他情况。
(三)基金财产的清算
1.基金财产消育小组;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或上海全财产清算小组或自由基金管理人基金特产着原。
2.基金粉产清算小组型成。基金财产清算小组成自由基金管理人基金特否人,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.基金财产清算和银币,基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现价配。基金财产清算和组可以依法进行必要的民事活动。
4.基金财产清算和评估。
(1)《基金台同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;
(1)《基金台同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;
(2)对基金财产进行估值和变现;
(4)制作清算报告;
(5)制度之计师事务所对清算报告,并行外如审计、随法律师事及经验。

(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 (5) 为时本公司 具法律意见书; (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告; (7) 对基金剩余财产进行分配。

(四) 消异效用 清草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)基金财产清算确余资产的分配。 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

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
并自律师事务所出县法库意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算权告报中国证监会备案后5个工作日内由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取出投行公告。
(七)基金财产清算取册及有关文件由基金托管人保存15年以上。
八,争议的处理和适用的法律
各方当事人同意、因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议可通过友好协商解决的、任何一方均有权将争议提安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中级、中被由被由支北京市。仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力,仲裁费用由敞诉方承担。
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》是中国法律管辖。
九.基金合同》是中国法律管辖。
九.基金合同》是为中国法律管辖。
九.基金合同》是为定基金合同,由于国际发生资本。
1、《基金合同》经验金管理人基金行置,及方法章代表人或授权代表签字并是金管理人的国际企业发生等,并终中国证监会为理基金备案手续,并终中国证监会书面确认后生效。
2、基金会同》的存效即自其生势之日至至基金财产高管理根由国证监会条案

3、《基金台间》自生效乙日起河包括基金管理人、基金托管人利基金份额符有人任 内的《基金台间》各方当事人具有同等的法律约束力。 4、《基金台同》正本一式四份、除上报有关监管机构一份外、基金管理人持有两份, 基金托管人持有一份、每份具有同等的法律效力。 5、《基金台间》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。

中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要 原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为

原则进行权益分配。基于本基金的铲ഥ利将点。本基金收益分配小须以外补存动亏预为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值; 5. 若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配; 6. 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。 在不违定法律法规目对基金份额持有人利益于实质性不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,无需召开基金份额持有人大会 五、基金的投资 (一)投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份般。 为更好饱实现投资目标、本基金可少量投资于非成分股(包括中小板、创业板及其他中国驱荡会核准上市的股票)、债券(包括国债金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分赛交易可转债、中小企业私寨债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、行生工具(包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。 如法律法规或监管相从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,可以将其纳人投资范围。本经股份股份比例不低于基金资产净值的90%。且不低于非晚金基金资产的80%。因法律法规的规定而受限制的情形除外。 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。 "川及遊車以起刀甩馬吹即走打中國之人而自力,整並加爾時刊人人会 (二)收益分配打案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配 、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 (三)收益分配方案的确定。公告与实施 本基金收益分配方案的确定。公告与实施 本基金收益分配方案的确定。公告与实施

(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和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的60%; (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

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超讨该权证的10%

。 《约本基金成投资于信用级别评级分局BB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持 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 有资产支持此券期间,如米共自用号级「呼、小比り日以及四世级上) 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%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不

展期;
(12)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(13)本基金在任何交易日日终,持有的买人股指期货合约价值、不得超过基金资产净值的10%;持有的买人国债期货合约价值、不得超过基金资产净值的15%;
(14)如本基金参与国债期货金股指期货全约的。本基金在任何交易日日终,持有的买人国债期货金股指期货合约价值一有价证券市值之和,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(不会插押式间隙)等。
(15)本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的30%;持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的30%;

,应当保持不低于交易保证金一倍的现金; (19) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值

(21)未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按 (21) 本于它的股票期权管约即且不停砬过基金货厂停垣的20%。其中,音约即直接 照行权价乘以合约乘数计算。 (22) 基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等),投资目标和风险收益特征;

(22)基金投资股票期权价占基金合同约定的比例限制(如股票仓位、个股占比等)投资目标和风险收益转证;
(23)本基金参与脑资的,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%。
(24)本基金参与转融通证券出借交易,在任何交易日日终、参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产单值的90%。证券出借的平均剩余期限不得超过30天,平均剩余期限按照市值加权平均计算。
(25)基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;
(26)法律注规及中国证监会规定的和《基金合司》约定的其他投资限制。因证券,期货市场被动,证券发行人合并、基金规模变动,标的指数成分股调整、标的指数成分股调整、标的指数成分股调整、标的指数成分股调整。

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。

本基金按设了物的指数规则加速中国基础加速加速的 不低于非现金基金资产的形象。因法律法规的规定而受限制的情形除外。 如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程 序后,可以调整上述投资品种的投资比例。 (三)投资限制。

(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 相时10%; (6)本基金特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 (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,

(16) 木基金所持有的股票市值和买人、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算) 应当符合基金进行有的政策的通讯表示。这就有规则后约加值。百日,北至日异, 应当符合基金自民于股票投资比例的有关约定,基金所持有的债券、不会到期日在 年以内的政府债券,市值和买入,卖出国债期货合约价值。合计(轧差计算)应当符合基 金合同关于债券投资比例的有关约定; (17)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

(20)开仓卖出认购股票期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽股票期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价

探政任的的,基並首准人应当任10°(文) 可以近行网络。但中国证益云观定的外外将同形除为。法律法规与有规定的从其规定。 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。上述期间内,本基金的投资范围,投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管,大对基金的投资的监督与检查自本基金合同处之日起开始。 注律法规定监管部门取消商或变更上述限制,加适用于本基金、基金管理人在履行适当程序。 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:

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相

公允价值。(交易所上市的股指期货合约,以其估值日在交易所挂牌的结算价估值。估值日无

从其规定。 7、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值;选定的第三方估值机 构未提供估值价格的,按成本估值。 8、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杆管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。 9、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

用明LN口生xx。 2、《基金合同》 的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案 ョニロエ。 、、《基金合同》 自牛效之日起对包括基金管理人、基金杆管人和基金份额持有人在