## (上接B19版)

经营范围:办理人民币存款、贷款、同业拆借业务;国内外结算;办理票据承兑、贴 现、转贴现、各类汇兑业务;代理资金清算,提供信用证服务及担保;代理销售业务;代理发行、代理承销、代理兑付政府债券;代收代付业务;代理证券投资基金清算业务 (银证转账);保险代理业务;代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务;保管箱服务;发行金融债券;买卖政府债券、金融债券;证券投资基金、企业年金托管 业务:企业年金受托管理服务:年金账户管理服务:开放式基金的注册登记、认购、申 购和赎回业务;资信调查、咨询、见证业务;贷款承诺;企业、个人财务顾问服务;组织 或参加银闭贷款:外汇存款:外汇贷款:外币兑换:出口托收及进口代收:外汇票据承 兑和贴现;外汇借款;外汇担保;发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有 价证券;自营、代客外汇买卖;外汇金融衍生业务;银行卡业务;电话银行、网上银行 手机银行业务;办理结汇、售汇业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。 基金杆管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,对下述基金投资 范围、投资对象进行监督。 本基金将投资于以下金融工具:

本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会 核准发行的股票),衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券 等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产,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,基金管理人在履行活当程

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工

2、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融 资比例进行监督: (1)按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为:

基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日 终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券 投资比例不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的,基金管理人应 在合理的期限内调整基金的投资组合,以符合上述比例限定。法律法规另有规定时, 从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当 程序后,可以将其纳人投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资

(2)根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资 1)股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资干标的指数成分股及其备

选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%; 2)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%

3) 本基会持有一家公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的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

5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金金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

6)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140% 7) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合。

A、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

B、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95%,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 买人返售全融资产(不会质押式回购)等。

C、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本基金持有的 股票总市值的20%: D、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)

占基金资产的比例范围为90%-95%; E、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%; F、基金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

不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券; 《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.

(3)法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券、期货市场被动、证券发行人上市公司合并或、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金原因导致投资比例的投资组合不符合上述规定投资比例约 定的比例,不在限制之内,但基金管理人应当在10个交易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求。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公司应对措施,便于基金托管人实施 ——除投资资产配置外,基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之

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

禁止行为进行监督:

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金禁止从事下列行为: (1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或提供担保; (3)从事承担无限责任的投资;

(4)向基金管理人、基金托管人出资。

(上接B17版)

(5)預留(印鉴卡)一式三份; (6)经法定代表人签字并加盖公章的《基金业务授权委托书》; (7)经办人有效身份证件原件及复印件(加盖公章); (8)企业法定代表人有效身份证件复印件(加盖公童):

3. 和松投资者办理认购申请时须提交填妥的《开放式基金交易类业务申请表》, 并加盖预算交易印鉴。同时提供经办人有效身份证件原件及经过签字复印件。 注:机构投资者办理基金认购业务前,需请投资者仔细阅读《投资人权益须知》 并进行风险承受力能力的测评。

机构投资者办理认购前应将足额认购资金通过银行转账汇人本公司在在中国建 设银行、招商银行、中信银行开立的直销账户:

本公司指定的直销账户信息如下:

账户名称:中金基金管理有限公司

账号:11001028100053014774 银行:中国建设银行北京长安支行

(2)招商银行

账户名称:中金基金管理有限公司

账户名称:中金基金管理有限公司

账户:7110210187000011823

参加收取书面表决意见的,不影响表决效力

开户银行,中信银行北京京城大厦支行 二) 机构投资者在其他销售机构开立基金账户及认购手续以各销售机构的规

## 中金中证500指数增强型发起式证券投资基金招募说明书

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 因此所遭受的损失

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公司应对措施,便于托管人实施交易

4、基金托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。 (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算 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,名单中增加或减少 银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人,基金托管人于2个工作日内回函 确认收到后,对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后,被确认调整

立按照协议进行结算。 加果基金杆管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交 易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资 损失的,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,托管人有权报告中国证监会。

的名单开始生效,新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,

(2)基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制 基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约 定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人 没有按照事先约定的交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交 易对手重新确定交易方式,经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的,基金托管人不

(3)基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银 行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,基金管理人在通知基金托管人后,可以 根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资 信风险,在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起 的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督

责任仅限于根据已提供的名单, 审核交易对手是否在名单内列明。 5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。 本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支 付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银 中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行、本基金投资除核心存款银行

以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责 赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后,可以根 根据已提供的名单, 审核核心存款银行是否在名单内列明。 (二)基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资

配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核 (三)基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金 合同》、基金托管协议有关规定时,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金

产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益

管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回 函,进行解释或举证。 在限期内,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内纠正的,基金托管人应报告中 国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令,基 金托管人发现该投资指令违反关法律法规规定或者违反《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。

对于必须于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,应当立 通知基金管理人,并报告中国证监会。 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答

复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规 要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资 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

基金管理人限期纠正。 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督,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。

、基金管理人对基金托管人的业务核查 基金管理人对基金指管人限行行管职责情况进行核查,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和证券账户等投资所需账 、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算 交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金 法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书面形式通 知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基 金管理人发出问函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金 纠正的,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赔偿基金

在基金募集行为结束前,投资人的认购款项只能存入专门账户,任何人不得动

用。有效认例就可在聚集期间产生的银行存款利息归投资人所有,在本基金认购结束后,折算为基金份额计人投资人的账户,具体份额以登记机构的记录为准。 本基金权益登记由登记机构在基金募集结束后完成。

六、基金的验资与基金合同生效 1、基金募集期限届满,或基金管理人决定提前结束募集的,具备下列条件的,基 金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续;发起资金提供方认购本基金的总

金额不少于1000万元(含认购费)且发起资金的提供方承诺持有期限自基金合同生

资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专项说明。基金管理人在收到验资报

2、基金管理人将自募集期限届满之日起10日内聘请法定验资机构进行验资,验

3、自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。基金

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会和银行业 监督管理机构,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杳行为,包括但不限干,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,在规定时间内答复基金管理人并改正。 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 民政拖延、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

警告仍不改正的,基金管理人应报告中国证监会。 四、基金财产的保管 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州产。未经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。如果因基金托管人未按约定履行托管职责,导致基金 产(包括实物证券)损坏、灭失的,基金托管人应承担赔偿责

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户 3.基金工16 / 公安派/%起力12金金亚州 10.0金%以 1741112.37%以 174112.37%以 174112.3

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 贵与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人,到账日基金财产没有到达基金托 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催收。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

6、除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管 基金

业监督管理机构的其他规定。

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定,将认购资金划入基金管理人 在具有社管房格的商业银行开设的中金基金管理有限公司基金以购专户。该帐户由基金管理人开立并管理。基金募集期满,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份 翻持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后:由基金管理人制请具有从 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有效。验资完成,基金管理人应将募集 的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中,基金 托管人在收到资金当日出具确认文件

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

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

了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

(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本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上 及一次公司(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

川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

的任何账户进行本基金业务以外的活动。 (五)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 (六)其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后,本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》 为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 (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 引上海分公司/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。 (八)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。 五、基金资产净值计算和会计核算

中金中证500指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告

七、本次份额发售当事人及中介机构

住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室

办公地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支

(一)基金管理人

名称:中金基金管理有限公司

成立时间:2014年2月10日

批准设立机关:中国证监会

组织形式:有限责任公司

注册资本:2亿元人民币

成立时间:1984年1月1日

组织形式,股份有限公司

存续期间:持续经营

联系人:张显

比准设立文号:证监许可[2014]97号

(一)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位四舍五人,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 以基金工行(水平上方)目718人大(巴达)中、区水田)水(尼达)月、基金国市总及新印金金、贝伊值和基金份额净值由基金管理人负责计算。基金长任管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值、基金份额净值并以双方认可的方式发 送给基金托管人。基金托管人对停值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

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。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。

(二)基金资产估值方法 1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证、股指期货合约、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 本基金的估值方法为:

融资券、同业存单等固定收益品种。

(1)证券交易所上市的非固定收益类有价证券的估值

①交易所上市的非固定收益类有价证券(包括股票,权证等),以其估值日在证交易所挂牌的市价(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 介(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交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券,采用估值技术确定公

(2) 固定收益品种的估值 ①基金合同所称的固定收益品种,是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深 圳证券交易所及中国证监全认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债 全融 债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期

②本基金在对银行间和交易所市场的固定收益品种估值时,主要依据由第三方 估值机构提供的价格数据:

3第三方估值机构应根据以下原则确定估值品种公允价值:对于存在活跃市场 的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量目的公允价值;对于活跃市场报 未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认计量日的公允 价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则应采用估值技术确定其公允

(3) 外于未上市期间的非固定收益类有价证券应区分加下情况外理。 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。

(4)本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结 算价的,是近交易日结旁份自己的。 最近交易日结等价估值。 (5)同一股票同时在两个或两个以上市场交易的,按股票所处的市场分别估值。

一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所外的市场分别估值; (6)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

(7)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。 (三)估值差错处理

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

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

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

基金托管资格批文及文号:中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室

办公地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

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。 基金管理人或基金托管人按估值方法的第(6)项进行估值时,所造成的误差不 

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,相关各 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。

(四)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,应按照相关各方约定的同一记 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,对相关名 5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

经对账发现相关各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,保证相关各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

(五)基金定期报告的编制和复核

每月终了后5个工作日内完成。

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介上。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 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

基金管理人在5个工作目内完成月度报告,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

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 表对外发布公告,基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

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

办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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。

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。登记机构的保管期限自基金账户销户之日起不 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

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

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引 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。 基全杆管人以由子版形式妥美保管基金份额持有人 名册 并完期刻成业费条份

呆存期限为20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 条以外的其他用涂,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,

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,

争议处理期间,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 2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况,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;

(4)发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

名称:中金基金管理有限公司

法定代表人:林寿康 电话:010-63211122

联系人:白娜

名称:北京市海问律师事务所 住所:北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心20层 办公地址:北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心20层

负责人:张继平 电话:(+86 10) 8560 6888

联系人:魏双娟 (六)审计基金财产的会计师事务所

住所:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层 办公地址:中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

执行事务合伙人:邹俊 由注,010-85087916

传真:010-85185111

签章注册会计师:程海良、李砾

联系人:程海良

2016年7月13日

(上接B17版) (2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基 金管理人)到指定地点对于面表决意的目光。如本本业证目为2018年,从2018年,从2018年,在基金托管(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知块 定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不

(3)本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人

所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之 人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后,6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人 大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人 人云。 里新日来的基本好碗好付入人云应当有\\农二分之一以上基本好碗的好有人直接出具书面意见或授权他人代表也具书面意见的 (4)上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具

书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出 月间感光的[5]是大门。中的是人的对于各类的人的形式加入大口的人的形式的分类人们 具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、 《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符; 3、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金亦可采用网络、电话等其他非现 场方式或者识非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,授权方式可以采用书面、网

1、议事内容及提案权 议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,加《基金合同》的重大修改。

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 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 在基金份额持有人大会召开前及时公告

络、电话、短信或其他方式,具体方式在会议通知中列明

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 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,然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出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况 下,由基金托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 人授权代表的大能与并大会。则由由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作为该次基金份额持

不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。 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

有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,

在诵讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所诵知的表决截止日 期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下

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: 一般决议,一般决议观经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权 大之一以上(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 5三分之二以上(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 权的三分之二以上(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 运作方式、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 公成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

(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 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

## ₩系申活:010-63211122 管理人将在收到中国证监会书面确认文件的次日对基金合同生效事官予以公告 4、基金募集期限届满,未达到基金备案条件的,则本基金募集失败,基金管理人 称:中国工商银行股份有限公司 (1)以甘因有财产承扣因草集行为而产生的债务和费田 住所:北京市西城区复兴门内大街55号 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

(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 5、基金合同生效之前发生的与基金募集活动有关的费用,包括信息披露费、会计

中金中证500指数增强型发起式证券投资基金基金合同内容摘要

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

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 (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 (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过即对的投票数要求进行重新清点。监察人应当进行重新清点。据《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 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。

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 基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。 鉴金订例时有人人云的决以自农庆园过之口吃生效。 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

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

(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 序规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规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,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定

三、基金收益分配原则、执行方式 - )基金收益分配原则 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利 环现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准目的基金 系基並收益力配出基並仍納明值不能成了面值,所基並收 随戶值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值; 4、每一基金份额享有同等分配权;

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。 二)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目的可供分配利润、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。

(三)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介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(即可供分配利润计算截止日)的时间不 )基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资

者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照 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;

、《基金合同》生效后与基金相关标的指数许可使用费; 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 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、基金份额持有人大会费用;

2、基金托管人的托管费;

7. 基金的证券, 期货交易费用: 9、基金相关账户的开户及维护费用: 10.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1.00%年费率计提。管理费的计算方法

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

H=E×0.15% ÷ 当年天数

(三)不列入基金费用的项目

绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过8.0%

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与基金 管理人核对一致的财务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核 寸,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休假等,支

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方

E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。基金托管人根据与基金管理 5歳71百寅毎日1日姫・2日系り土毎月7月不15月入り。密並れ自ハ1223年3日本 4枚7一数的財务数据,自动在月初2个工作日内按照指定的账户路径进行资金支 け,基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对, 发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等,支付日

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定 的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中,基金合同生效前的许可使用 指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明

基金管理人可根据指数许可使用合同和基金份额持有人的利益,对上述计提方 式进行合理变更并公告。 如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等 现代引起战化时,可加速步起引起敌时。 发生调整,本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募 说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。比述"一、基金费用的种类中第4—10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

、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 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;

(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、基金财产的投资方向和投资限制 本基金为股票指数增强型发起式证券投资基金,在力求对中证500指数进行有效

、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。

目标,本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会 松准发行的股票)。衍生工具、权证、股指期货等),债券资产(国债、金融债、企业债 公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资务 等)、债券回购、银行存款等固定收益类资产,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

基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%-95%,投资于标

(2)网上直销 交易系统:中金基金网上直销系统 直销系统网址:https://trade.ciccfund.com/etrade 投资人可以通过本公司网上直销系统办理基金的认购等业务,具体业务办理流

公司网站;www.ciccfund.com 发售期间,客户可以通过本公司客户服务中心电话400-868-1166(免长途话费)

(四)份额登记机构

联系人:洪渊

1、直销机构

(1)直销柜台

三)销售机构

电话:010-63211122

传真:010-66159121

联系电话:010-66105799

名称:中金基金管理有限公司

客户服务电话:400-868-1166

·募集相关事官的问询、开放式基金的

的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日 终在扣除股指期货保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券 投资比例不低于基金资产净值的5%。 (三)投资限制

基金的投资组合应遵循以下限制: (1) 股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资于标的指数成分股及其备 选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%; (2) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 ; (4)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%; (5)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%;

(6)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 (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 争值的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

1)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

4)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)

2)本基金在任何交易日日终,持有的买人期货合约价值与有价证券市值之和不 2. 7年基金任任间交别占日安、7年间交入7期以日307加量7年加量2年17年 得超过基金资产单值的95%,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、买人返售金融资产(不含质押式回购)等; 3)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本基金持有的

(8)本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(9)本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合

5)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上一交易日基金资产净值的20%; 6)基金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 不低于基金资产净值%的现金或到期日在一年以内的政府债券; (10)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、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因

素致使基金投资比例不符合上途规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,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。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同 的定。基金托管人对基金的投资的监管与检查自本基金合同生效之日起开始。 法律法规或监管部门取消或变更上述限制,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或以变更后的规定为准。如本基金增加投

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:

资品种,投资限制以法律法规和中国证监会的规定为准。

(6)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动

占基金资产的比例范围为90%-95%:

(4)向其基金管理人、基金托管人出资; (5)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;

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 跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的 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司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事 其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利 益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合 理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并履行信息披露义务。重大 长联交易将提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金 六、基金资产净值的计算方法和公告方式 (一)基金资产总值 基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

(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、争议的处理和适用的法律

《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。

方法存在分歧,应以基金管理人的处理方法为准。

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, 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

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,在李度报告完成当日,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。

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 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

六、基金份额持有人名册的登记与保管 基金管理人和基金托管人领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益登记日、每年6月30日、12

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

应按有关法规规定各自承担相应的责任。 相关各方当事人同意,因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议,除经友好 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

本协议受中国法律管辖。 八、托管协议的变更与终止

(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;

住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室 办公地址:北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

传真:010-66155573 (五)出具法律意见书的律师事务所

传真:(+86 10) 8560 6999 经办律师:魏双娟、高巍

名称·毕马威华振会计师事务所(特殊普诵合伙)

中余基余管理有限公司

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。 三)基金资产净值、基金份额净值 《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

古、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 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、基金份 额争值和基金份额累计争值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基

4、《基金合同》约定的其他情形;

少每周公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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介上。 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会 央议通过的事项的,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

、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,并自决

、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

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目的次日,通

议生效后两日内在指定媒介公告 (二)《基金合同》的终止事由 下列情形之一的,《基金合同》应当终止: 1、基金份额持有人大会决定终止的:

5.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

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:

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

(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;

(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;

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 (在)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

(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 作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 (1847位在中间) 不是人事必须及的人员,签定例。 (1847位日本会计师等分别申 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允告。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

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议、基金合同 当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的、任何一

会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方 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。

方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委

(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 5、基金财产清算的期限为6个月 (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,