(上接B114版)

②）其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构的公告。

二、登记机构

名称：安信基金管理有限责任公司

住所：广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层

办公地址：广东省深圳市福田区莲花街道益田路6009号新世界商务中心36层

法定代表人：刘入领

电话：0755-82509865

传真：0755-82560289

联系人：宋发根

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：（010）58153000、0755）25028288

传真：（010）85188298、0755）25026188

签章注册会计师：昌华、高鹤

联系人：李妍明

第六部分　基金的募集

本基金由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集申请于2018年2月2日经中国证监会（2018）247号文注册。

一、基金运作方式与类型

1、基金的运作方式

契约型开放式

2、基金的类型

股票型证券投资基金

二、基金存续期限

不定期

三、发售时间

自基金份额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。

四、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

五、募集场所

本基金通过基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及销售机构的销售网点，具体名单见基金份额发售公告）公开发售。

投资者还可登录基金管理人公司网站（www.essencefund.com），在与基金管理人达成网上交易的相关协议、接受基金管理人有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后，通过基金管理人网上交易系统办理开户、认购等业务。（目前基金管理人仅对个人投资者开通网上交易服务）。

具体销售机构及联系方式以本基金基金份额发售公告为准，请投资者就募集和认购的具体事宜仔细阅读基金份额发售公告。如果本基金后续增加其他销售机构的，基金管理人将会刊登关于本基金增加销售机构的公告。

六、募集规模上限

本基金不设最高募集规模。本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币，并且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规的规定可以决定停止基金发售。

七、基金份额的发售面值与认购价格

本基金基金份额的发售面值为人民币1.00元，基金份额的认购价格为1.00元/份。

八、基金份额类别

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时/收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

在不违反法律法规、基金合同规定的前提下，根据基金运作情况，基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后停止现有基金份额类别的销售、或者调整现有基金份额类别的费率水平（基金管理费和基金托管费除外），或者增加新的基金份额类别等，调整实施前基金管理人需依照《信息披露办法》的规定及时公告并报中国证监会备案。

九、认购费用与认购份额的计算

1、认购费用

本基金的A类基金份额认购费用在认购时收取，具体认购费率如下，认购C类基金份额不支付认购费用：

认购金额M（含认购费用）	认购费率（%）
M<100万元	1.00%
100万元≤M<500万元	0.60%
M≥500万元	1000元/笔

募集期内投资者多次认购的，认购费用须按每笔认购金额对应的费率档次分别计算。

A类基金份额的认购费用不列入基金资产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

2、认购份额的计算

本基金认购采用“金额认购”的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。

①）若投资者选择认购A类基金份额，则认购份额的计算公式为：

认购费用适用比例费率时，计算公式为：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额发售面值

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资20万元认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在募集期间产生的利息为15元，其对应的认购费率为1.00%，则其可得到的A类基金份额为：

净认购金额=200,000/（1+1.00%）=198,019.80元

认购费用=200,000-198,019.80=1,980.20元

认购份额=（198,019.80+15）/1.00=198,034.80份

即投资人投资20万元认购本基金A类基金份额，假设其认购资金在募集期间产生的利息为15元，则其可得到A类基金份额198,034.80份。

②）若投资者选择认购C类基金份额，则认购份额的计算公式为：

认购份额=（认购金额+认购利息）/基金份额发售面值

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资100,000元认购C类基金份额，假设其认购资金在募集期间产生的利息为15元，则其可得到C类基金份额100,015.00份。

十、投资人对基金份额的认购

1、本基金的认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

2、认购的方式及确认

①）本基金认购采取金额认购的方式；

②）投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款；

③）基金募集期内，投资人可多次认购基金份额，已受理的认购申请不得撤销；

④）销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记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。

⑤）若投资人的认购申请被确认为无效，基金管理人应当将投资人已支付的认购金额本金退还投资人。

3、认购的限额

①）通过本基金除基金管理人外的其他销售机构进行认购，首次认购最低金额为人民币10元（含认购费），追加认购的最低金额为人民币10元（含认购费）；各销售机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

②）通过基金管理人的直销柜台进行认购，单个基金账户单笔首次认购最低金额为人民币50,000元（含认购费），追加认购最低金额为单笔人民币10,000元（含认购费）。

3、通过基金管理人网上直销进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为人民币10元（含申购费），追加申购最低金额为单笔人民币10元（含申购费），网上直销单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销说明。

4、投资人将持有的基金份额当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

5、基金份额持有人在销售机构赎回基金份额时，每笔赎回申请不得低于5份基金份额。若基金份额持有人某笔交易类业务（如赎回、基金转换、转托管等）导致在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额少于5份时，余额部分基金份额必须全部一同赎回。

6、本基金对单个投资人的累计申购金额不设上限，但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外）。

7、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。

8、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购与赎回的登记

投资人T日申购基金成功后，本基金登记机构在T+1日为投资人增加权益并办理登记结算手续，投资人自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

投资人T日赎回基金成功后，本基金登记机构在T+1日为投资人扣除权益并办理相应的登记结算手续。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可对上述登记结算办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照《信息披露办法》有关规定，在指定媒介公告。

七、申购费率、赎回费率

1、申购费率

本基金A类基金份额在投资人申购时收取申购费，C类基金份额不收取申购费。

本基金A类基金份额对申购设置级差费率，申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

A类基金份额的申购费率结构表

申购金额M（含申购费用）	申购费率（%）
M<100万元	1.20%
100万元≤M<500万元	0.80%
M≥500万元	1000元/笔

A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资者承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、登记和销售。

2、赎回费率

基金的赎回费率表

份额类别	持有基金份额期限（T）	赎回费率（%）
A类赎回费率	T<7天	1.50%
	7天≤T<30天	0.30%
	30天≤T<180天	0.10%
	T≥180天	0
C类赎回费	T<7天	1.50%
	7天≤T<30天	0.10%
	T≥30天	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，对A、C类份额，对持续持有期少于7天的投资人收取的赎回费，100%归入基金资产；对持续持有期超过7天（含7天）的投资人收取的赎回费，不低于赎回费总额的25%归入基金资产，其余部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以按照《基金合同》的相关规定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定的媒介上公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的自律规则，具体见基金管理人届时的相关公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率，并进行公告。

八、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：

①）若投资者选择申购A类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购费用适用比例费率：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额的基金份额净值

申购费用适用固定金额：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日A类基金份额的基金份额净值

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后2位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假定T日A类基金份额的基金份额净值为1.0520元，某投资人本次申购本基金A类基金份额25万元，对应的本次申购费率为1.20%，该投资人可得到的A类基金份额为：

净申购金额=250,000/（1+1.20%）=247,035.57元

申购费用=250,000-247,035.57=2,964.43元

申购份额=247,035.57/1.0520=234,824.69份

即：投资人投资25万元申购A类基金份额，假定申购当日A类基金份额的基金份额净值为1.0520元，可得到234,824.69份A类基金份额。

②）若投资者选择申购C类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额=申购金额/申购当日C类基金份额的基金份额净值

上述计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后2位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人投资100,000元申购C类基金份额，假设申购当日本基金C类基金份额的基金份额净值为1.0000元，则其可得到本基金C类基金份额为：

申购份额=100,000/1.0000=100,000.00份

即：投资人投资100,000元申购C类基金份额，假设申购当日本基金C类基金份额的基金份额净值为1.0000元，则其可得到本基金C类基金份额100,000.00份。

2、赎回金额的计算方式：

赎回总金额=赎回份额?T日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额?赎回费率

净赎回金额=赎回总金额?赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回本基金A类基金份额2万份，持有时间为120天，对应的赎回费率为0.10%，假设赎回当日A类基金份额净值是1.2100元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=20,000×1.210=24,200.00元

赎回费用=24,200.00×0.10%=24.20元

净赎回金额=24,200.00-24.20=24,175.80元

即：投资者赎回本基金2万份A类基金份额，持有时间为120天，假设赎回当日A类基金份额净值是1.2100元，则其可得到的赎回金额为24,175.80元。

例：某投资者赎回本基金C类基金份额1万份，持有时间为5天，对应的赎回费率为1.50%，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0680元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0680=10,680.00元

赎回费用=10,680.00×1.50%=160.20元

净赎回金额=10,680.00-160.20=10,519.80元

即：投资者赎回本基金1万份C类基金份额，持有时间为5天，假设赎回当日C类基金份额净值是1.0680元，则其可得到的赎回金额为10,519.80元。

3、本基金A类基金份额和C类基金份额的份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日各类基金份额的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

九、拒绝或暂停申购的情形及处理

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暂停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、期货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。

4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。

7、某笔或者某些申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

8、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、8、9项情形之一且基金管理人决定暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券、期货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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请。

6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十一、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定金额赎回或部分延期赎回。

①）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

②）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

③）暂停赎回：连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

④）本基金发生巨额赎回时，对于在开放日内单个基金份额持有人超过基金总份额50%以上的赎回申请情形的，除未超过基金总份额50%以内的赎回申请按上述规定办理赎回申请外，基金管理人应当对单个基金份额持有人超过基金总份额50%以上部分的赎回申请延期办理。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，延期的赎回申请与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一个开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的各类基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，基金管理人最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、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；捐赠是指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；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登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

十六、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

十七、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十八、基金份额的冻结、解冻

基金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与支付。法律法规另有规定的除外。

第九部分　基金的投资

一、投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证复兴发展100主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证复兴发展100主题指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，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、债券回购、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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（但须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，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

三、投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采用完全复制的方法进行投资，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。

①）组合构建策略

本基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

1）确定目标组合：本基金管理人根据完全复制成份股权重的方法确定目标组合。

2）确定建仓策略：本基金管理人根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

3）逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，本基金管理人在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪标的指数的要求。

②）组合管理策略

1）定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。

2）不定期调整

①当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司的公告，进行相应调整；

②根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

③若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

2、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资。本基金投资股指期货将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

3、债券投资策略

本基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

4、国债期货投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

5、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价，在此基础上谨慎进行权证投资。本基金还可利用权证与标的股票之间可能存在形成的风险对冲机会，在充分论证和模型分析的基础上谨慎构建套利投资组合，获取相对稳定的投资收益。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

6、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

①）本基金投资于中证复兴发展100主题指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%；

②）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，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

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%；

④）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%；

⑤）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%；

⑥）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%；

⑦）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%；

⑧）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

⑨）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%；

⑩）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；

⑪）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；

⑫）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%；本基金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；

⑬）本基金参与股指期货或国债期货的，在任何交易日日终，持有的买入国债期货及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、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

⑭）本基金参与股指期货交易：

1）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%；

2）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20%；

3）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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

4）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%；

⑮）本基金参与国债期货交易：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

2）本基金在任何交易日日终，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%；

3）本基金所持有的债券（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；

4）本基金在任何交易日内交易（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%；

⑯）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

⑰）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

⑱）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

⑲）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。

除上述第（2）、（10）、（17）、（18）条外，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，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约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对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，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，但是中国证监会另有规定的除外；

⑤）向其基金管理人、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）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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，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，并按法律法规予以披露。重大关联交易应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。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，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。

五、标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数是中证复兴发展100主题指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

2、业绩比较基准

中证复兴发展100主题指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

由于本基金投资标的指数为中证复兴发展100主题指数，且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，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，因此，本基金将业绩比较基准定为中证复兴发展100主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，调整业绩比较基准应取得基金托管人同意并按照监管部门要求履行适当程序，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告，无需召开持有人大会。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

七、未来条件许可情况下的基金模式转型

若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会备案并提前公告。ETF联接基金是指其绝大部分基金资产投资于同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），以紧密跟踪标的指数为目的的指数化产品。

第十部分　基金的财产

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。

二、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。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基