

上证 50 交易型开放式指数证券投资基金 基金合同

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行

二〇〇四年十一月

目录

一、前言.....	1
二、释义.....	1
三、基金的基本情况.....	4
四、基金份额的发售.....	5
五、基金备案.....	6
六、基金份额折算与变更登记.....	6
七、基金份额的交易.....	7
八、基金份额的申购与赎回.....	8
九、基金的非交易过户等其他业务.....	10
十、基金认购、申购和赎回等业务的代理.....	10
十一、基金合同的当事人及其权利与义务.....	10
十二、基金份额持有人大会.....	15
十三、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序.....	19
十四、基金的托管.....	21
十五、基金份额的登记.....	21
十六、基金的投资.....	22
十七、基金的财产.....	26
十八、基金资产的估值.....	26
十九、基金的费用与税收.....	27
二十、基金的收益与分配.....	29
二十一、基金的会计与审计.....	30
二十二、基金的信息披露.....	30
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	33
二十四、违约责任.....	34
二十五、争议的处理.....	35
二十六、基金合同的效力.....	35
二十七、基金管理人和基金托管人签章.....	35
附件：基金合同摘要.....	38

一、前言

为保护基金投资者合法权益、明确基金合同当事人的权利与义务、规范上证 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）运作，依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）及其他有关规定，遵循平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益的原则，订立《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）。

本基金合同是规定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

本基金由基金管理人按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定募集，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指上证 50 交易型开放式指数证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指本《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及基金合同当事人对其不时作出的修订；
招募说明书：	指《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及基金管理人对其定期作出的更新；
托管协议：	指《上证 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及基金管理人、基金托管人对其不时作出的修订；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；

中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；

《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时作出的修订；

《销售办法》：指 2004 年 6 月 25 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及不时作出的修订；

《运作办法》：指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》及不时作出的修订；

交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”；

基金合同当事人：指受基金合同约束，根据本基金合同享有权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；

基金管理人：指华夏基金管理有限公司；

基金托管人：指中国工商银行；

合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的规定，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构；

登记结算机构：指中国证券登记结算有限责任公司；

登记结算业务：指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务；

募集期：指自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月的期间；

发售代理机构：指基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构；

申购赎回代理券商：指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司；

销售代理机构：指发售代理机构和申购赎回代理券商；

认购：指在本基金募集期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为，投资者可以现金或股票方式申请认购；

基金合同生效日：指本基金达到法定的基金备案条件，基金管理人向中国证监会办理备案手续并获得中国证监会书面确认之日；

申购：指在本基金合同生效后，投资者申请购买本基金基金份额的行为；

赎回：	指基金份额持有人按本基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
申购、赎回清单：	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件；
申购对价：	指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
赎回对价：	指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
组合证券：	指本基金标的指数所包含的全部或部分证券；
标的指数：	指上海证券交易所编制并发布的上证 50 指数及其未来可能发生的变更；
现金替代：	指申购、赎回过程中，投资者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数量的现金；
现金差额：	指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算；
最小申购、赎回单位：	指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍；
基金份额参考净值：	指上海证券交易所交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV；
预估现金部分：	指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额；
指定交易：	指《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中定义的“全面指定交易”；
基金份额折算：	指本基金建仓结束后，基金管理人根据本基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
收益评价日：	指基金管理人计算本基金累计报酬率与标的指数累计报酬率差额之日；
基金累计报酬率：	指收益评价日基金份额净值与基金份额折算日基金份额净值之比减去

	100%；
标的指数同期累计报酬率：	指收益评价日标的指数收盘值与基金份额折算日标的指数收盘值之比减去 100%；
基金资产总值：	指基金购买的各类证券、银行存款本息等的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程；
基金份额净值：	指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；
存续期：	指基金合同生效并存续的期限，本基金为永久存续；
工作日：	指上海证券交易所的正常交易日；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
日/月：	指公历日/月；
T 日：	指本基金在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
元：	指人民币元。

三、基金的基本情况

（一）基金的名称：上证50交易型开放式指数证券投资基金。

（二）基金的类别：股票基金。

（三）基金的运作方式：交易型开放式。

（四）基金的投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（五）最低募集份额总额：2亿份。

（六）基金份额面值：1.00元。

（七）认购费用：不超过认购份额的1%。

（八）标的指数：上证 50 指数，但如果上海证券交易所变更或停止上证 50 指数的编制及发布、或上证 50 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致上证 50 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。

（九）存续期限：永久存续。

四、基金份额的发售

（一）基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1. 发售时间

自本基金发售之日起最长不得超过3个月。

2. 发售方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者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；网下股票认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行的认购。

3. 发售对象

中华人民共和国境内的自然人、法人及其他组织（法律法规禁止购买证券投资基金者除外），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者。

（二）基金份额的认购和持有限额

1. 认购限额

（1）网上现金认购：单一账户每笔认购份额需为1000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。

（2）网下现金认购：投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1000份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

（3）网下股票认购：单只股票最低认购申报股数为1万股，超过1万股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

2. 持有限额

本基金不设持有限额。

（三）募集期间的资金、股票与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集的股票由登记结算结构予以冻结。

本基金认购费用不超过认购份额的1%。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

五、基金备案

（一）基金备案条件

基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理基金验资和备案手续：

- 1.基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额（含募集股票市值）不少于2亿元；
- 2.基金份额持有人的人数不少于200人。

（二）基金的验资和备案

基金募集期限届满，本基金具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（三）基金合同生效

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。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

（四）基金募集失败

基金募集期限届满，未具备上述基金备案条件，则基金募集失败，基金合同不生效。

本基金募集失败时，基金管理人应承担全部募集费用，将已募集资金加计同期银行活期存款利息在募集期结束后30日内退还给认购人，并将已冻结的股票解冻。

（五）基金合同生效后的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，如连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金财产净值低于5000万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。

六、基金份额折算与变更登记

（一）基金份额折算的时间

基金合同生效后，基金管理人应逐步调整实际组合直至达到跟踪指数要求，此过程为基金建仓。基金建仓期不超过3个月。

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并提前公告。

（二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。折算后的基金份额净值与折算日标的指数收盘值的千分之一基本一致。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调

整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

（三）基金份额折算的方法

对基金份额折算后的基金份额持有人持有的基金份额采取四舍五入的方法保留到整数位，由此产生的误差归入基金资产。基金份额折算的具体方法由招募说明书规定。

七、基金份额的交易

（一）基金上市

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》，向上海证券交易所申请上市：

- 1.基金募集金额（含募集股票市值）不低于 2 亿元；
- 2.基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3.《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，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，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

（二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海、深圳证券交易所交易规则》、《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式指数基金业务实施细则》等有关规定。

（三）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1.不再具备本条第（一）款规定的上市条件；
- 2.基金合同终止；
- 3.基金份额持有人大会决定提前终止上市；
- 4.上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起 2 个工作日内发布基金终止上市公告。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务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的申购和赎回。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1. 申购、赎回的开始时间

本基金在基金份额折算日之后、基金上市交易之前可开始办理申购。但在基金申请上市期间，基金可暂停办理申购。

本基金自基金合同生效后不超过 3 个月的时间起开始办理赎回。

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

2. 开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00。

若上海证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。

（三）申购和赎回的原则

1. 本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。
2. 本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、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《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。
5. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（四）申购和赎回的程序

1. 申购和赎回申请的提出

投资者须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资者申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。

2. 申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持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，则赎回申请失败。

3. 申购和赎回的清算交收与登记

投资者T日申购、赎回成功后，登记结算机构在T日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记结算机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（五）申购和赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整。

（六）申购、赎回的对价、费用及其用途

1. 申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2. 投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

3. T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。T日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（七）暂停申购、赎回的情形

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的申购、赎回申请：

1. 不可抗力导致基金无法接受申购、赎回；
2. 上海证券交易所决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3. 上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购、赎回；
4. 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日报中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购、赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。

（八）集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

九、基金的非交易过户等其他业务

登记结算机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

十、基金认购、申购和赎回等业务的代理

本基金的认购、申购、赎回等业务可由基金管理人及基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金网下认购、申购、赎回等业务的，应与其签订书面委托代理协议，以明确双方的权利和义务。

基金管理人和销售代理机构应严格按照法律法规和本基金合同的规定办理本基金的认购、申购和赎回等业务。

十一、基金合同的当事人及其权利与义务

（一）基金管理人

1. 基本情况

名称：华夏基金管理有限公司

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 A 座 15 层

法定代表人：凌新源

总经理：范勇宏

设立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：13800 万元

存续期间：100 年

2. 基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 运用基金财产；
- (2) 获得管理人报酬；
- (3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (4) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整基金业务规则；
- (5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会、中国银监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- (6) 在基金托管人更换时，提名新任基金托管人；
- (7) 选择、更换销售代理机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (8) 选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册；
- (9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；
- (10) 在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资，并以相应基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；
- (11) 依法召集基金份额持有人大会；
- (12) 法律法规规定的其他权利。

3. 基金管理人的义务

- (1) 依法募集基金，办理或者委托其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之股票、现金替代金额及现金差额；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 法律法规规定的其他义务。

(二) 基金托管人

1. 基本情况

名称：中国工商银行

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

成立日期：1984 年 1 月 1 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]3 号文

组织形式：国有独资企业

注册资本：1710.24 亿元

存续期间：持续经营

2.基金托管人的权利

- (1) 获得基金托管费；
- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (3) 自本基金合同生效之日起，依法持有并保管基金资产；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 依法召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规规定的其他权利。

3.基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (10) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (11) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (12) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

- (14) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (15) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (16) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；
- (17) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 法律法规规定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。每份基金份额具有同等的合法权益。

1. 基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规规定的其他权利。

2. 基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 法律法规规定的其他义务。

十二、基金份额持有人大会

（一）召开事由

有下列情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

1. 变更基金类别；
2. 变更基金投资目标、范围或策略；
3. 变更基金份额持有人大会程序；
4. 提前终止基金合同；
5. 转换基金运作方式；
6. 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
7. 更换基金管理人、基金托管人；
8. 提前终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
9. 与其他基金合并；
10. 中国证监会规定的其他情形。

以下情形不需召开基金份额持有人大会：

1. 调低基金管理费率、基金托管费率；
2. 暂停办理基金申购、赎回业务；
3. 因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；
4. 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
5. 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
6. 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）召集人和召集方式

1. 在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2. 基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3. 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书

面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以自行召集基金份额持有人大会。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.通知时间和通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 日，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。

2.通知内容

基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；
- （4）代理投票授权委托书送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名、电话。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机构及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

召集人可选择以现场开会或通讯开会方式召开基金份额持有人大会，但更换基金管理人和基金托管人、提前终止基金合同、转换基金运作方式必须以现场方式召开。

1.现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在权利登记日基金总份额的 50%以上。

2.通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 大会召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 大会召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同地称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

(3) 大会召集人在公证机构的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

(4) 所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额占本基金在权利登记日基金总份额的 50%以上；

(5) 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、受托出席会议者出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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

（五）议事内容与程序

1.议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如变更基金类别，变更基金投资目标、范围或策略，变更基金份额持有人大会程序，提前终止基金合同，转换基金运作方式，提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，更换基金管理人、基金托管人，提前终止基金上市，与其他基金合并以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会不得对未经公告的事项进行表决。

2.议事程序

（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（六）款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。基金份额持有人大会由基金管理人召集的，大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金托管人召集的，大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表；基金份额持有人大会由基金份额持有

人召集的，大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上（不含 50%）多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人至少提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机构监督下形成的决议有效。

（六）决议形成的条件、表决方式、程序

1. 决议形成的条件

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（不含 50%）多数通过方为有效；除下列（2）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）特别决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过。

2. 表决方式

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。每一基金份额具有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

3. 表决程序

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。计票程序如下：

（1）现场开会

如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人。如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人担任监票人。

监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果大会主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

(2) 通讯方式开会

采取通讯方式进行表决时,除非有充分相反证据证明,否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

计票方式为:由大会召集人授权的 2 名监督员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票,并由公证机构对其计票过程予以公证;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票,并由公证机构对其计票过程予以公证。

(七) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

基金份额持有人大会表决通过的事项,召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

(八) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

十三、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序

(一) 基金管理人的更换

1.基金管理人职责终止的条件

有下列情形之一的,基金管理人职责终止:

- (1) 被依法取消基金管理资格;
- (2) 被基金份额持有人大会解任;
- (3) 依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产;
- (4) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

2.基金管理人的退任程序

(1) 基金管理人退任时，需按照有关规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(2) 基金管理人退任时，应妥善保管基金管理业务资料，并及时与临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续。

3. 基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的新任基金管理人形成决议。

(3) 批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任。

(4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后5个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体公告。新任基金管理人与原基金管理人或临时基金管理人进行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任基金管理人和新任基金托管人在中国证监会和中国银监会批准后5个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体联合公告。

(二) 基金托管人的更换

1. 基金托管人职责终止的条件

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- (1) 被依法取消基金托管资格；
- (2) 被基金份额持有人大会解任；
- (3) 依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- (4) 法律法规规定或经中国证监会、中国银监会批准的其他情形。

2. 基金托管人的退任程序

(1) 基金托管人退任时，需按照有关规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(2) 基金托管人退任时，应妥善保管基金财产和基金托管业务资料，并及时与临时基金托管人或新任基金托管人办理基金财产和基金托管业务的移交手续。

3. 基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

- (1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名。
- (2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的新任基金托管人形成决议。
- (3) 批准：新任基金托管人经中国证监会、中国银监会审查批准方可继任。

(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会、中国银监会批准后5个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体公告。新任基金托管人与原基金托管人或临时基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任基金管理人和新任基金托管人在中国证监会和中国银监会批准后5个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体联合公告。

十四、基金的托管

本基金资产由基金托管人持有并保管。基金托管人与基金管理人必须按照《基金法》、基金合同及其他有关规定订立托管协议。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十五、基金份额的登记

本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。登记结算业务是指《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、托管和结算业务。基金管理人应与登记结算机构签订委托代理协议，以明确双方的权利和义务，保护投资者和基金份额持有人的合法权益。

（一）登记结算机构的权利

- 1.取得登记结算费；
- 2.保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 3.法律法规规定的其他权利。

（二）登记结算机构的义务

- 1.配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务；
- 2.严格按照法律法规、《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》和本基金合同规定办理登记结算业务；
- 3.按本基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户等业务，并提供基金收益分配等其他服务；

- 4.对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查等情形除外；
- 5.法律法规规定的其他义务。

十六、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最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

（三）投资理念

中国经济和资本市场将长期快速增长，指数化投资可以以最低的成本和较低的风险获得市场平均水平的长期回报。标的指数具有良好的市场代表性、流动性与蓝筹特征，通过完全复制法实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化，可以满足投资者多种投资需求。

（四）投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的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股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

1.决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2.投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制决策。

3.投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：金融工程小组依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策：投资决策委员会依据金融工程小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制指数成份股权重方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低买入成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：中央交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估：金融工程小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

(6) 组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

(五) 投资组合管理

1. 投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 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：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：基金经理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，基金经理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指数要求。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%。本基金将在基金合同生效之日起 3 个月的时间内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在合理期限内进行调整。

2. 每日投资组合管理

(1) 成份股公司行为信息的跟踪与分析：跟踪标的指数成份股公司行为（如：股本变化、分红、停牌、复牌等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

(2) 标的指数的跟踪与分析：跟踪标的指数编制方法的变化，确定指数变化是否与预期一

致，分析是否存在差异及差异产生的原因，为投资决策提供依据。

(3) 每日申购赎回情况的跟踪与分析：跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

(4) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析：基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因，并进行成份股调整的流动性分析。

(5) 组合调整：①利用数量化分析模型，找出将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合交易计划。②如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项，应提请投资决策委员会召开会议，决定基金的操作策略。③调整组合，达到目标组合的持仓结构。

(6) 以 T-1 日指数成份股构成及其权重为基础，考虑 T 日将会发生的上市公司变动等情况，设计 T 日申购、赎回清单并公告。

3.定期投资组合管理

(1) 每月

每月末，根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行支付现金的准备。

每月末，在基金经理会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况，找出未能有效控制较大偏离的原因。

每月末，公司投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。

(2) 每半年（标的指数调整周期）

根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理依据投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

4.投资绩效评估

(1) 每日，基金经理分析基金的跟踪偏离度。

(2) 每月末，金融工程小组对本基金的运行情况进行量化评估。

(3) 每月末，基金经理根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况，重点分析基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证 50 指数。

如果上海证券交易所变更或停止上证 50 指数的编制及发布、或上证 50 指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致上证 50 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。

（七）风险收益特征

本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 50 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

（八）禁止行为

依照《基金法》，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1. 承销证券；
2. 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，但是国务院另有规定的除外；
5. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人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；
7. 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；
8. 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

（九）投资限制

依照《运作办法》，基金管理人运用基金财产进行证券投资，不得有下列情形：

1. 基金财产参与股票发行申购，单只基金所申报的金额超过基金总资产，单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
2. 违反基金合同关于投资范围和投资策略等约定；
3. 中国证监会规定禁止的其他情形。

（十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 不谋求对所投资公司的控股或者直接管理；
2. 所有参与行为均应在合法合规和维护基金份额持有人利益的前提下进行，并谋求基金资产的保值和增值。

十七、基金的财产

（一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金需按有关规定开立基金专用银行存款账户以及证券账户，上述账户与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户独立。

（四）基金财产的处分

本基金的资产独立于基金管理人及基金托管人的资产，并由基金托管人保管。基金投资或运作取得的财产和收益，归入基金资产。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，基金资产不属于其清算财产。基金资产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金资产的债权债务，不得相互抵销。非因基金资产本身承担的债务，不得对基金资产强制执行。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押和其他权利。除《基金法》等相关法律法规及基金合同另有规定，基金资产不得被处分。

十八、基金资产的估值

（一）估值日

本基金合同生效后，每开放日对基金资产进行估值。

（二）估值方法

1. 上市证券按估值日其所在证券交易所的收盘价计算；估值日无交易的，以最近 1 日的收盘价计算。

2. 未上市股票的计算：

（1）送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价计算；

（2）首次发行的股票，按成本价计算。

3. 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值；若收盘价低于配股价，则估值为零。

4. 在任何情况下，基金管理人如采用本款第 1、2、3 项规定的方法对基金资产进行估值，均

应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本款第 1、2、3 项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5. 国家有相关规定的，按其规定进行估值。

（三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券等有价值证券。

（四）估值程序与基金净值的确认

基金的日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果报送基金托管人，基金托管人按照基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后将复核结果返回给基金管理人；月末、半年和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金资产估值出现错误时，基金管理人应当立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到基金资产净值的 0.5% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

（六）暂停估值的情形

1. 基金投资涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因停市时；
2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 中国证监会认定的其他情形。

（七）特殊情形的处理

1. 基金按本条第（二）款第 4 项规定进行估值时，所造成的差异不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于证券市场及登记结算机构发送的数据错误，或由于不可抗力，基金管理人和基金托管人已经采取必要、适当、合理的措施进行检查仍未能发现的错误造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要措施消除由此造成的影响。

十九、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.基金上市费及年费；
- 4.证券交易费用；
- 5.基金收益分配中发生的费用；
- 6.基金份额持有人大会费用；
- 7.基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；
- 8.其他按照国家有关规定可以列入的费用。

（二）基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。

3.基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

4.本条第（一）款第3至第8项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付。

（三）不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

（四）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

二十、基金的收益与分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括：

- 1.基金投资所得红利、股息、债券利息收入；
- 2.买卖证券价差收入；
- 3.存款利息收入；
- 4.其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

- 1.每份基金份额享有同等分配权。
- 2.基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。
- 3.如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。
- 4.基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。
- 5.在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，最多分配 2 次，若自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配。基金收益分配比例为符合上述基金分红条件的可分配部分的 100%。
- 6.本基金收益分配采取现金方式。
- 7.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，并在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。基金收益分配方案须载明基金可分配收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

二十一、基金的会计与审计

（一）基金会计年度、记账本位币、会计核算制度

- 1.基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2.基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3.会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4.本基金独立建账、独立核算。
- 5.本基金会计责任人为基金管理人。
- 6.基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。

（二）基金审计

- 1.基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。
- 2.基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所须在备案后 5 个工作日内公告。
- 3.会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。

二十二、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其实 施准则、本基金合同及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项须在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（一）基金合同、托管协议、招募说明书、基金份额发售公告

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

（二）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（三）基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金建仓期结束后，基金管理人确定基金份额折算日，并至少提前3个工作日将基金份额折算日公告登载于指定报刊及网站上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人将在3个工作日内将基金份额折算结果公告登载于指定报刊及网站上。

（四）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前至少3个工作日在指定报刊及网站上公告。

（五）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的至少3个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（六）基金资产净值、基金份额净值与申购、赎回清单

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

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

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（七）定期报告

本基金定期报告包括季度报告、半年度报告和年度报告，由基金管理人按照相关规定进行编制，经基金托管人复核后公告，同时报中国证监会备案。

1. 季度报告：基金季度报告在每季度结束后的15个工作日内公告。
2. 半年度报告：基金半年度报告在基金会计年度前6个月结束后的60日内公告。
3. 年度报告：基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后的90日内公告。
4. 法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（八）临时公告

基金在运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益产生重大影响的事项时，基金管理人

须按照法律法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告：

- 1.基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2.提前终止基金合同；
- 3.转换基金的运作方式；
- 4.基金管理人、基金托管人变更；
- 5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6.基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7.基金募集期限延长；
- 8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9.基金管理人的董事在一年内变更超过50%；
- 10.基金管理人或基金托管人托管部门主要业务人员一年内变更达30%以上；
- 11.涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14.重大关联交易事项；
- 15.基金收益分配事项；
- 16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17.基金份额净值计价错误达基金份额净值的0.5%；
- 18.基金改聘会计师事务所；
- 19.变更销售代理机构或登记结算机构；
- 20.开始或暂停办理基金的申购和赎回；
- 21.暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 22.基金其他业务的推出；
- 23.其他重大事项。

（九）信息披露文件的存放与查阅

本基金基金合同、托管协议、招募说明书、基金份额发售公告、基金合同生效公告、基金份额上市交易公告书、定期报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

修改基金合同应经基金份额持有人大会决议通过,并报中国证监会批准,自批准之日起生效。但如因相应的法律、法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形,或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的,可不经基金份额持有人大会决议,而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告,并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的,基金合同应当终止:

- 1.基金份额持有人大会决定终止的;
- 2.基金管理人、基金托管人职责终止,在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
- 3.法律法规规定或经中国证监会批准的其他情况。

基金合同终止情形发生时,基金管理人应当按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果批准并予以公告之日起,本基金合同终止。

（三）基金财产的清算

1.基金财产清算小组

在基金财产清算小组接管基金财产之前,基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

(1) 基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事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。清算小组可以聘用必要的工作人员。

(2) 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。

2.基金财产清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后,由基金财产清算小组统一接管基金财产;
- (2) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认;
- (3) 对基金财产进行评估和变现;
- (4) 将基金财产清算结果报告中国证监会;

(5) 公布基金财产清算公告；

(6) 对基金财产进行分配。

基金财产清算的期限为自基金合同终止情形发生之日起不超过 1 年。

3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。

4. 基金财产清算剩余财产的分配

依据基金财产清算的分配方案，基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5. 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。基金财产清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案，并在 5 个工作日内公告。

6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十四、违约责任

(一) 由于基金合同一方当事人违反基金合同，造成基金合同不能履行或者不能完全履行的，由违约方承担违约责任；如属基金合同双方或多方当事人违反基金合同，根据实际情况，由双方或多方当事人分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1. 不可抗力；

2. 基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3. 基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则投资或不投资造成的损失或潜在损失等。

(二) 基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成直接损失的，应承担赔偿责任。

(三) 在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。未违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。

(四) 因第三方的过错而导致基金合同一方当事人违约，给其他当事人造成损失的，违约方并不免除其赔偿责任。

(五) 因基金合同一方当事人违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

二十五、争议的处理

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

基金合同当事人发生纠纷的，可以通过协商或者调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可以依据事后达成的书面仲裁协议，向仲裁机构申请仲裁。基金合同当事人事后没有达成书面仲裁协议的，可以向人民法院起诉。

二十六、基金合同的效力

（一）基金合同是基金当事人之间的法律文件。基金合同在基金募集结束，达到本基金备案条件后，报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

（二）本基金合同自生效之日起对本基金合同当事人具有同等法律约束力。

（三）本基金合同正本一式 8 份，除上报中国证监会和中国银监会一式 2 份外，基金管理人和基金托管人分别持有 2 份，每份具有同等的法律效力。

（四）本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

二十七、基金管理人和基金托管人签章

（见下页）

(本页无正文)

基金管理人：华夏基金管理有限公司（盖章）

法定代表人或被授权人（盖章）：

签订地：北京市

签订日：二〇〇四年 月 日

(本页无正文)

基金托管人：中国工商银行（盖章）

法定代表人或被授权人（签字）：

签订地：北京市

签订日：二〇〇四年 月 日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

（一）基金管理人

1.基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）运用基金财产；
- （2）获得管理人报酬；
- （3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （4）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整基金业务规则；
- （5）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反本基金合同或有关法律法规规定，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会、中国银监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- （6）在基金托管人更换时，提名新任基金托管人；
- （7）选择、更换销售代理机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- （8）选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；
- （10）在法律、法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资，并以相应基金资产履行偿还融资和支付利息的义务；
- （11）依法召集基金份额持有人大会；
- （12）法律法规规定的其他权利。

2.基金管理人的义务

- （1）依法募集基金，办理或者委托其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- （2）办理基金备案手续；
- （3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- （4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- （5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基

金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购之基金份额或赎回之股票、现金替代金额及现金差额；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制中期和年度基金报告；

(13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 法律法规规定的其他义务。

(二) 基金托管人

1. 基金托管人的权利

(1) 获得基金托管费；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法持有并保管基金资产；

- (4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- (5) 依法召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规规定的其他权利。

2. 基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (9) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (10) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (11) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (12) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (15) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (16) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；
- (17) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (19) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 法律法规规定的其他义务。

（三）基金份额持有人

基金投资者自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。每份基金份额具有同等的合法权益。

1. 基金份额持有人的权利

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- （9）法律法规规定的其他权利。

2. 基金份额持有人的义务

- （1）遵守基金合同；
- （2）交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- （3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；
- （5）法律法规规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

（一）召开事由

有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- 1. 变更基金类别；
- 2. 变更基金投资目标、范围或策略；
- 3. 变更基金份额持有人大会程序；
- 4. 提前终止基金合同；

- 5.转换基金运作方式；
- 6.提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 7.更换基金管理人、基金托管人；
- 8.提前终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- 9.与其他基金合并；
- 10.中国证监会规定的其他情形。

以下情形不需召开基金份额持有人大会：

- 1.调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2.暂停办理基金申购、赎回业务；
- 3.因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4.对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5.对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6.按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）召集人和召集方式

- 1.在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2.基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3.代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以自行召集基金份额持有人大会。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.通知时间和通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 日，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。

2.通知内容

基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机构及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

召集人可选择以现场开会或通讯开会方式召开基金份额持有人大会，但更换基金管理人和基金托管人、提前终止基金合同、转换基金运作方式必须以现场方式召开。

1.现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定；
- (2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额占本基金在权利登记日基金总份额的 50%以上。

2.通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- (1) 大会召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 大会召集人按本基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同地称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

(3) 大会召集人在公证机构的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;

(4) 所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额占本基金在权利登记日基金总份额的 50%以上;

(5) 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、受托出席会议者出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书符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

(五) 议事内容与程序

1. 议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如变更基金类别,变更基金投资目标、范围或策略,变更基金份额持有人大会程序,提前终止基金合同,转换基金运作方式,提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,更换基金管理人、基金托管人,提前终止基金上市,与其他基金合并以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会不得对未经公告的事项进行表决。

2. 议事程序

(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(六)款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。基金份额持有人大会由基金管理人召集的,大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表;基金份额持有人大会由基金托管人召集的,大会主持人为基金托管人授权出席会议的代表;基金份额持有人大会由基金份额持有人召集的,大会主持人为召集基金份额持有人大会的基金份额持有人自行选举的代表。如果大会主持人未能按前述规定确定,则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上(不含 50%)多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,由召集人至少提前 30 日公布提案,在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决,在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机构监督下形成的决议有效。

(六) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 决议形成的条件

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上（不含 50%）多数通过方为有效；除下列（2）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) 特别决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过。

2. 表决方式

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。每一基金份额具有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

3. 表决程序

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。计票程序如下：

(1) 现场开会

如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人。如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人担任监票人。

监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

(2) 通讯方式开会

采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

计票方式为：由大会召集人授权的 2 名监督员在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，

并由公证机构对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证。

（七）基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

（八）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金的收益与分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括：

1. 基金投资所得红利、股息、债券利息收入；
2. 买卖证券价差收入；
3. 存款利息收入；
4. 其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

1. 每份基金份额享有同等分配权。
2. 基金当年收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。
3. 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。
4. 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。

5.在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配 1 次，最多分配 2 次，若自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配。基金收益分配比例为符合上述基金分红条件的可分配部分的 100%。

6.本基金收益分配采取现金方式。

7.法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，并在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。基金收益分配方案须载明基金可分配收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

四、基金的费用

（一）基金费用的种类

基金运作过程中，从基金财产中支付的费用包括：

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.基金上市费及年费；
- 4.证券交易费用；
- 5.基金收益分配中发生的费用；
- 6.基金份额持有人大会费用；
- 7.基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；
- 8.其他按照国家有关规定可以列入的费用。

（二）基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金管理人。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性划付给基金托管人。

3. 基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。

4. 本条第（一）款第3至第8项费用由基金托管人根据有关法规及相关合同等的规定，按费用实际支出金额支付。

（三）不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

（二）禁止行为

依照《基金法》，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1. 承销证券；
2. 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，但是国务院另有规定的除外；
5. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人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；
7. 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；

8.依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

（三）投资限制

依照《运作办法》，基金管理人运用基金财产进行证券投资，不得有下列情形：

- 1.基金财产参与股票发行申购，单只基金所申报的金额超过基金总资产，单只基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 2.违反基金合同关于投资范围和投资策略等约定；
- 3.中国证监会规定禁止的其他情形。

六、基金资产净值的计算方法和公告公式

（一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金份额净值

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。

（四）基金资产净值、基金份额净值的公告

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

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

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

七、基金合同的终止与基金财产的清算

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
3. 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情况。

基金合同终止情形发生时，基金管理人应当按法律法规和本基金合同规定组织清算组对基金财产进行清算。自中国证监会对清算结果批准并予以公告之日起，本基金合同终止。

（二）基金财产的清算

1. 基金财产清算小组

在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（1）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事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。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）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。

2. 基金财产清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行评估和变现；
- （4）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （5）公布基金财产清算公告；
- （6）对基金财产进行分配。

基金财产清算的期限为自基金合同终止情形发生之日起不超过 1 年。

3. 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。

4. 基金财产清算剩余财产的分配

依据基金财产清算的分配方案，基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5. 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。基金财产清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案，并在 5 个工作日内公告。

6. 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

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

基金合同当事人发生纠纷的，可以通过协商或者调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可以依据事后达成的书面仲裁协议，向仲裁机构申请仲裁。基金合同当事人事后没有达成书面仲裁协议的，可以向人民法院起诉。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。