

嘉实泰和混合型证券投资基金 基金合同

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二零二零年十月

目 录

一、前言	2
二、释义	3
三、基金的基本情况	8
四、基金的历史沿革	8
五、基金的存续	9
六、基金份额的申购与赎回	9
七、基金合同当事人及权利义务	16
八、基金份额持有人大会	21
九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	28
十、基金的托管	30
十一、基金份额的登记	30
十二、基金的投资	31
十三、基金的财产	37
十四、基金资产的估值	37
十五、基金的费用与税收	42
十六、基金的收益与分配	43
十七、基金的会计和审计	45
十八、基金的信息披露	45
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	50
二十、违约责任	54
二十一、争议的处理	54
二十二、基金合同的效力	55
二十三、其他事项	55

一、前言

（一）订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益。

（二）基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

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基金合同的承认和接受。

（三）嘉实泰和混合型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并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做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、谨慎勤勉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。

（四）基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

（五）本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

（六）本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

二、释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指嘉实泰和混合型证券投资基金，本基金由泰和证券投资基金转型而成。

2、泰和基金：指泰和证券投资基金，运作方式为封闭式。

3、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司。

4、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司。

5、基金合同或本基金合同或《基金合同》：指《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充，本基金合同由《泰和证券投资基金基金合同》修订而成。

6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实泰和混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充，本托管协议由《泰和证券投资基金托管协议》修订而成。

7、招募说明书：指《嘉实泰和混合型证券投资基金招募说明书》及其更新。

8、基金份额发售公告：指《嘉实泰和混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》。

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等。

10、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订。

11、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

12、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

13、《运作办法》：指《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订。

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订。

- 15、 中国证监会：指中国证券监督管理委员会。
- 16、 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会。
- 17、 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。
- 18、 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人。
- 19、 机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。
- 20、 合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者。
- 21、 投资者：指个人投资者、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者的合称。
- 22、 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者。
- 23、 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务。
- 24、 销售机构：指直销机构和代销机构。
- 25、 直销机构：指嘉实基金管理有限公司。
- 26、 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构。
- 27、 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点。
- 28、 登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。
- 29、 登记机构：指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构。
- 30、 《业务规则》：指《嘉实基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守。
- 31、 基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理

的基金份额余额及其变动情况的账户

32、 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务导致基金的基金份额变动及结余情况的账户

33、 基金转型：指对包括泰和证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“嘉实泰和混合型证券投资基金”等一系列事项的统称。

34、 基金合同生效日：指本《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效起始日，本基金合同自泰和证券投资基金终止上市之日起生效，原《泰和证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

35、 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期。

36、 集中申购期：指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间，最长不得超过3个月。

37、 存续期：指自《泰和证券投资基金基金合同》生效之日起至本《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限。

38、 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

39、 T日：指销售机构在规定的开放时间受理投资者申购、赎回或其他业务有效申请的工作日。

40、 T+n日：指T日后第n个工作日（不包含T日）。

41、 开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日。

42、 开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段。

43、 申购：指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为。

44、 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为。

45、 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为。

46、 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基

金份额销售机构的操作。

47、定期定额投资计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。

48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（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）超过上一开放日基金总份额的 10%。

49、元：指人民币元。

50、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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

51、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款项以及其他投资所形成的价值总和。

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

53、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数。

54、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。

55、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和基金份额净值的过程。

56、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介。

57、不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

58、基金产品资料概要：指《嘉实泰和混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020

年 9 月 1 日起执行)

三、基金的基本情况

(一) 基金的名称

嘉实泰和混合型证券投资基金

(二) 基金的类别

混合型证券投资基金

(三) 基金的运作方式

契约型开放式

(四) 基金的投资目标

分享中国改革与发展成果，密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。

(五) 基金的最低募集份额总额和金额

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。

(六) 基金份额面值

基金份额的初始面值为人民币 1.00 元。

(七) 基金存续期限

不定期

四、基金的历史沿革

嘉实泰和混合型证券投资基金由泰和证券投资基金转型而来。

泰和证券投资基金成立于 1999 年 4 月 8 日，基金总份额为 20 亿份，存续期 15 年，于 1999 年 4 月 20 日在上海证券交易所上市交易。基金发起人为广发证券有限责任公司、北京证券有限责任公司、吉林省信托投资公司、中煤信托投资有限责任公司、嘉实基金管理有限公司，基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。

2014 年 2 月 27 日，泰和证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了《关于泰和证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括泰和证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。基金管理人已就上述基金份额持有人大会决议提请中国证监会备案，基金份额持有人大会决议于 2014 年 3 月 14 日生效。依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向上海证券交易

所申请基金终止上市，原《泰和证券投资基金基金合同》失效，《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

五、基金的存续

（一）基金份额的变更登记

泰和证券投资基金终止上市后，基金管理人将向中国证券登记结算有限责任公司申请办理基金份额的变更登记。基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司上海分公司取得终止上市权益登记日的基金份额持有人名册之后，将投资人权益数据转登记到嘉实基金管理有限公司的注册登记系统，进行投资人持有基金份额的初始登记，并进行基金份额更名以及必要的信息变更。

（二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

六、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

（二）申购和赎回对象

符合法律法规规定可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、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。

（三）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资者可办理基金份额的申购、赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、

赎回等业务时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自基金份额变更登记完成后将开始办理集中申购，暂不开放赎回，集中申购期不超过3个月。集中申购期结束后，本基金可暂停办理申购和赎回。暂停期间结束后，本基金将开放申购、赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接收的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（四）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立，登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券交易所或交易市场

数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后及时(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。若申购不成功或无效，则申购款项退还给投资人。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

(六) 申购和赎回的数额限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

4、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，具体规定请参见相关公告。

5、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。

(七) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日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。

2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基

金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。

4、申购费用由投资者承担，可在投资者申购基金份额和/或在投资者赎回基金份额时收取。在申购时收取的申购费称为前端申购费，在赎回时收取的申购费称为后端申购费。申购费不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产，未纳入基金财产的赎回费用用于支付登记费、销售手续费等各项费用。

6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书或相关公告中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并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》的有关规定在指定媒介上公告。

7、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，针对投资者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、赎回费率。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 4、基金管理人认为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、根据市场情况，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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券即将上市或进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害已有基金份额持有人利益的。
- 7、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。

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、6、8、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）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者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金无法支付赎回款项。
- 2、证券交易场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。
- 3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5、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延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

6、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赎回或延缓支付款项时，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 3 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）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接受全额赎回或部分延期赎回。

(1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，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者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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，投资者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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，如出现单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 30% 的赎回申请（“大额赎回申请人”）的，基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）赎回申请的原则，对当日的赎回申请按照以下原则办理：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例（单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量）确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认，则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例，确认其当日受理的赎回申请量，对当日全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理；同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。

(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，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒

介上刊登公告。

（十一）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，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，基金管理人应于重新开放日公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，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；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

（十二）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本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本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。

（十三）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；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给公益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。

（十四）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。

（十五）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。

（十六）基金的冻结和解冻与其他业务

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。

如相关法律法规允许基金管理人办理其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

七、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元

法定代表人：经雷

成立日期：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】5 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币 1.5 亿元

存续期限：持续经营

联系电话：010-65215588

（二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 9 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

（三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者

自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

（四）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- 1、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产。
- 2、依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他收入。
- 3、销售基金份额。
- 4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利。
- 5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整《业务规则》，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式。
- 6、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益。
- 7、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请。
- 8、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券。
- 9、选择、更换登记机构，获取基金份额持有人名册，并对登记机构的代理行为进行必要的监督和检查。
- 10、选择、更换基金销售机构，并依据基金销售服务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。
- 11、选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构，并确定相关服务费率、费用。
- 12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人。
- 13、依法召集基金份额持有人大会。
- 14、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。

（五）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的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、计算并公告基金净值信息，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、足额支付赎回款项。
- 11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。
- 12、编制季度报告、中期报告和年度报告。
- 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、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料。
- 23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人。

24、执行生效的基金份额持有人大会决议。

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动。

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理。

27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（六）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1、依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入。

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、根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益。

6、依法召集基金份额持有人大会。

7、按规定取得基金份额持有人名册资料。

8、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。

（七）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1、安全保管基金财产。

2、设立专门的基金托管部门，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及其他相关账户。

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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。
- 10、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。
- 11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项。
- 12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、和基金份额申购、赎回价格。
- 13、按照规定监督基金管理人的投资运作。
- 14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对。
- 15、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款项。
- 16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会。
- 17、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。
- 18、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。
- 19、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、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人。
- 21、执行生效的基金份额持有人大会决议。
- 22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动。
- 23、建立并保存基金份额持有人名册。
- 24、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（八）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- 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或召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼。
- 9、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

（九）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- 1、遵守法律法规、基金合同、业务规则及其他有关规定。
- 2、了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险。
- 3、关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务。
- 4、交纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用。
- 5、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。
- 6、不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动。
- 7、执行生效的基金份额持有人大会决议。
- 8、返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人及基金服务机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利。
- 9、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（十）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

八、基金份额持有人大会

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有平等的投票权。

（二）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同（法律法规，或中国证监会，或本基金合同另有约定的除外）。
- （2）转换基金运作方式（法律法规，或中国证监会，或基金合同另有规定的除外）。

(3) 变更基金类别（法律法规，或中国证监会，或基金合同另有规定的除外）。

(4) 本基金与其他基金的合并（法律法规，或中国证监会，或基金合同另有规定的除外）。

(5) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规，或中国证监会，或基金合同另有规定的除外）。

(6) 变更基金份额持有人大会程序。

(7) 更换基金管理人、基金托管人。

(8) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规或中国证监会或基金合同另有规定的除外。

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项。

(10) 法律法规，或基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、尽管有前述约定，但如属于以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 基金管理人或基金托管人主动要求调低基金管理费、基金托管费。

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取。

(3) 在不违背法律法规的规定和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式。

(4) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务。

(5) 在不违背法律法规的规定和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置。

(6) 基金管理人、登记机构在法律法规规定的范围内调整《业务规则》，该业务规则包括但不限于有关基金申购、赎回、转换、转托管、收益分配、非交易过户等。

(7) 在未来条件允许的情况下，安排本基金的上市交易事宜。

(8) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改。

(9) 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。

(10) 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。

(11) 法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的情况。

(12) 按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会情形以外的其他情形。

(三) 召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。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。

2、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。

4、代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（四）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、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前至少 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和出席方式。

（2）会议拟审议的事项。

（3）会议形式。

（4）议事程序。

（5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日。

（6）代理投票的授权委托书证明的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点。

（7）表决方式。

（8）会务常设联系人姓名、电话。

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续。

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用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、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、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。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

(五) 基金份额持有人出席会议的方式

1、会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式开会，会议的召开方式由会议召集人确定。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托证明委派其代理人出席，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，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用纸面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

(5) 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用纸面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

2、召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%）。

②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金

合同及会议通知的规定。

（2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知并按规定进行公告。

②召集人按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召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力。

④本人直接出具书面意见和授权他人代表出具有效书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上（含 50%）。

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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书证明等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

（3）参加基金份额持有人大会的基金份额持有人持有的基金份额低于上述第（1）款之①或上述第（2）款之④约定的权益登记日基金总份额 50% 的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

（六）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

（3）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

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数（不含 50%）选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

（2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人至少提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

- 1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。
- 2、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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50% 以上（含 50%）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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；除本基金合同另有约定外，涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。

- 3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

4、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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

- 5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、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。

（八）计票

1、现场开会

- （1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名人士共同担任计票人；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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名人士共同担任计票人；但如果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代表担任计票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或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。重新清点仅限一次。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名计票人在监督人派出的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；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 名计票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九) 基金份额持有人大会决议的生效、公告、备案

1、基金份额持有人大会决议自通过之日起生效。召集人应当按照中国证监会的规定将基金份额持有人大会决议报中国证监会备案。

2、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、基金托管人均有约束力。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。

3、基金份额持有人大会决议应按照法律法规及中国证监会规定的信息披露规则在指定媒介公告。

(十) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。上述（一）至（九）中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修改导致相关内容被取消或变更的，经与基金托管人协商一致后，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，无需召开基金份额持有人大会审议。

九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

（一）基金管理人的更换

1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- （1）基金管理人被依法取消基金管理资格。
- （2）基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产。
- （3）基金管理人被基金份额持有人大会解任。
- （4）法律法规、基金合同规定或中国证监会规定的其他情形。

2、基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行：

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件。

（3）备案：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应报中国证监会备案。

（4）交接：原基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收，并与基金托管人核对基金资产总值和净值。

（5）审计：原基金管理人职责终止的，应当按照法律法规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，审计费用在基金财产中列支。

（6）公告：基金管理人更换后，由基金托管人按照法律法规及中国证监会规定的信息披露规则在指定媒介上公告。

（7）基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关的名称字样。

（二）基金托管人的更换

1、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- （1）基金托管人被依法取消基金托管资格。

- (2) 基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产。
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任。
- (4) 法律法规、基金合同规定或中国证监会规定的其他情形。

2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件。

(3) 备案：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应报中国证监会备案。

(4) 交接：原基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和托管业务移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收，并与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(5) 审计：原基金托管人职责终止的，应当按照法律法规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，审计费用从基金财产中列支。

(6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人按照法律法规及中国证监会规定的信息披露规则在指定媒介上公告。

(三) 基金管理人与基金托管人同时更换

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人。

2、基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行。

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应按照法律法规及中国证监会规定的信息披露规则在指定媒介上公告。

(四) 新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。

(五) 本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

十、基金的托管

基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关法规订立《嘉实泰和混合型证券投资基金托管协议》。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、信息披露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。

十一、基金份额的登记

（一）基金的份额登记业务

本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。

（二）基金登记业务办理机构

本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

（三）基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、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；
- 4、在法律法规允许的范围内，制定或调整《业务规则》，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；
- 5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

（四）基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 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，但司法强制检查情形，或法律法规，或有权行政机关规定或《基金合同》约定的情形除外；
- 5、按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 6、接受基金管理人的监督；
- 7、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

十二、基金的投资

（一）投资目标

分享中国改革与发展成果，密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准发行的股票），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，股指期货、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；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，基金保留的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的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金主要参考公司投资决策委员会形成的大类资产配置建议，综合考虑宏观经济因素、资本市场因素、主要大类资产的相对估值等因素，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。

2、股票投资策略

本基金股票投资将重点关注中观因素带来的投资线索并防范组合风险，精选具有可持续增长潜力的优势个股。基于中观因素与个股因素相结合的个股精选是本基金的主要投资策略。本基金将从持续性、有效性和市场认知程度三个方面综合分析判断中观因素转化为投资机会的可能性，并在此基础上深入挖掘个股投资价值。

(1) 中观因素主要可以归纳为以下四个方面的线索：

a、宏观经济结果：宏观经济变化会对中观层面产生深远影响，在不同的宏观环境下，各个行业的生命特征和表现不同。本基金将结合宏观经济数据（如通胀水平、经济增长速度等），政策导向和市场投资情绪对宏观经济周期进行前瞻性判断，进而根据不同经济周期进行行业配置与调整。

b、产业变迁：产业转移和技术发展是导致产业变迁的两大动力，本基金通过深入研究国际国内产业转移路径以及技术发展升级带来的行业和区域性投资机会，优选处于上升周期的产业。

c、行业格局：长期来看，行业的系统性周期变化将会对行业格局变化产生系统性影响，而短期来看，行业格局利益的重新分配将会对行业产生结构性影响和机会，本基金通过紧密跟踪影响行业格局利益分配调整的驱动因素和事件，提前捕捉行业格局变化带来的投资机会。

d、主题驱动：本基金同时关注影响行业/区域的主题性投资机会，通过综合考量主题驱动的上中下游行业机会，以及行业/区域与主题的相关程度和反应速度，提前布局主题受益行业/区域。

(2) 个股因素主要可以归纳为以下几个方面的指标：

a、盈利模式：通过综合考量企业利润来源、核心竞争力、渠道影响力、客户忠诚度、创新能力等分析判断企业是否具备稳健或领先的盈利模式。

b、管理层能力：通过综合考量企业管理团队的稳定性、专业程度以及所倡导的企业文化等分析判断企业管理层是否具备带领企业积极健康发展的能力。

c、公司战略：通过综合考量企业战略定位、发展规划、经营策略和执行力等分析判断企业是否具备清晰的发展目标和明确的实现手段。

d、财务报表健康程度：通过综合考量企业资产负债情况、利润结构分解和现金流情况等分析判断企业财务状况是否与其战略发展相匹配。

e、体外或有资产：通过综合考量企业的行业地位、兼并收购能力等分析判断企业扩大产能实现跳跃式发展的可能性。

（3）中观因素与个股因素相结合

本基金遵循“宏观推导中观，中观指导微观”的动态投资逻辑，通过结合中观因素与个股因素确定优势个股，并根据组合风险特征、资产配置策略的变化等进行股票投资组合的构建与调整。

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。

3、债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

4、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

5、风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如 Barra 多因子模型、风险预算模型等，并结合公司现有的风险管理流程，在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。

具体而言，在大类资产配置策略的风险控制上，由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控；在行业配置策略的风险控制上，风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外，也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大中小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上，本基金将严格遵守公司的内部规章制度，控制单一个股投资风险。

未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%。
- (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 10%。
- (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%。
- (6) 本基金股票投资占基金资产的比例范围为 30%~95%。
- (7) 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%。
- (8) 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%。
- (9) 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%。
- (10) 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%。
- (11) 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。
- (12) 基金资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。
- (13) 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%。
- (14) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。
- (15) 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%。
- (16) 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、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。
- (17) 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基金持有的股票总市值

值的 20%。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

(18) 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）不得超过基金资产的 95%。

(19) 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%。

(20) 本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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(21) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(22) 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(23) 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；

(24) 若本基金投资于法律法规或中国证监会允许基金投资的新品种的，相关比例参照基金合同及监管机构的有关规定执行；

(25) 本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

(26) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

本基金在进行股指期货投资之前，应与基金托管人就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本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。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。除第(11)、(20)、(22)、(23) 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中

支付对价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。

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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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其他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，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，本基金按照调整后的规定执行。

(五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×70% + 上证国债指数×30%。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深 300 指数或上证国债指数的编制及发布、或沪深 300 指数或上证国债指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深 300 指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数，或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，变更本基金的业绩比较基准。

(六) 风险收益特征

本基金为混合型基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

(七) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十三、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款项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）基金财产的处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金服务机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金服务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金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十四、基金资产的估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（二）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，以最近交易日的市价（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，确定公允价值。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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，按最近交易日的收盘价估值。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行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（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。交易所上市的资产支持证券，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的情况下，按成本估值。

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票的市价（收盘价）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市价（收盘价）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。

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，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、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，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、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、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

8、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，基金管理人负责基金资产净值计算和基金会计核算，并担任本基金的会计责任方。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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货、其他投资等资产及负债。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中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将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或代销机构、或投资者自身原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现差错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任

方。

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估。

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失。

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正。

4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人及基金托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时。

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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的。

4、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，基金管理人应当暂停基金估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

(八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按本基金合同约定的估值方法进行估值，所造成的误差不作

为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十五、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、基金财产划拨支付的银行费用。
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用。
- 5、基金份额持有人大会费用。
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费。
- 7、基金的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资融券费及其他类似性质的费用等）。
- 8、基金的开户费用、账户维护费用。
- 9、基金上市初费及年费（如有）。
- 10、法律法规规定或经中国证监会认定可以在基金财产中列支的其他费用。

在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，不需召开基金份额持有人大会，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）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财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十六、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权。
- 2、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，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值转为基金份额。
- 3、本基金收益每年最多分配 12 次，每次每份基金份额基金收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%。
- 4、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。
- 5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值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配方式是现金分红。
- 6、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）的时间不得超过 15 个工作日。
- 7、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日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在遵守法律法规的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日可供分配利润、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。

（五）收益分配的时间和程序

- 1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介上公告。
- 2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十七、基金的会计和审计

（一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方。
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日。
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度。
- 5、本基金独立建账、独立核算。
- 6、基金管理人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。
- 7、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并书面确认。

（二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、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）同意后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

十八、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称

“指定网站”）等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
- 2、对证券投资业绩进行预测。
- 3、违规承诺收益或者承担损失。
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构。
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字。
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

（一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人应当在集中申购期开始3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

（二）基金合同、托管协议

基金管理人、基金托管人应按照规定将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

（三）基金产品资料概要

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

（四）集中申购期基金份额发售公告

基金管理人就集中申购期基金份额发售的具体事宜编制集中申购期基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

（五）基金净值信息

1、集中申购期开始之前，基金管理人将至少每周公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。

2、自集中申购期开始之日起，基金管理人将在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

3、基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

（六）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

（七）基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2、基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3、基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

5、基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

6、报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

7、法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（八）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网

站上：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议及决定的事项。
- 2、基金合同终止、基金清算。
- 3、转换基金运作方式、基金合并。
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所。
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项。
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更。
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更。
- 8、基金募集期延长。
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动。
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%；
- 11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%。
- 12、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚。
- 14、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事项，但中国证监会另有规定的除外。
- 15、基金收益分配事项。
- 16、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、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 0.5%。
- 18、本基金开始办理申购、赎回。
- 19、本基金发生巨额赎回并延期办理。
- 20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 21、本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请。
- 22、基金份额折算与变更登记。

23、基金推出新业务或服务。

24、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

25、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

（九）澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

（十）基金份额持有人大会决议

（十一）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（十二）中国证监会规定的其他信息

在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书更新等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

法律法规或监管机构另有规定时从其规定。

（十三）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

（十四）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

（十五）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合并

1、基金合并概述

本基金的存续期间，如发生下列情形之一的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以决定本基金与基金管理人管理的其他基金合并：

- （1）连续 3 个月平均基金份额持有人数量不满 100 人的；
- （2）连续 3 个月平均基金资产净值低于 5000 万元的。

基金合并的方式包括但不限于本基金吸收合并其他基金、本基金被其他基金吸收合并、本基金与其他基金合并为新的基金等方式。本基金吸收合并其他基金时，其他基金终止，本基金存续；本基金被其他基金吸收合并时，其他基金存续，本基金终止；本基金与其他基金合并为新的基金时，本基金与其他基金均终止。

2、基金合并的实施方案

（1）基金合并公告

①基金管理人应就本基金合并事宜，依照相关法律法规的规定进行公告，向投资人披露合并后基金的法律文件，明确实施安排，说明对现有持有人的影响，并报中国证监会备案或更新

基金申请材料。

②基金管理人应在合并实施前至少提前二十个工作日就基金合并相关事宜进行提示性公告。

③为了保障现有基金份额持有人的利益，基金管理人可在合并实施前的合理时间内暂停本基金的日常申购或转换转入业务。

(2) 基金合并业务的规则

①基金管理人应在有关基金合并的公告中，说明对现有基金份额的处理方式及基金合并操作的具体起止时间，并提示现有基金份额持有人在基金合并前的指定期限内（该期限不少于二十个工作日，具体期限在公告中列明，以下简称指定期限）可行使选择权。

②基金份额持有人在指定期限内可行使的选择权包括：

- a. 赎回其持有的本基金份额；
- b. 将其持有的本基金份额转换为基金管理人管理的、可接受转换转入的其他基金份额；
- c. 继续持有合并后的基金份额；
- d. 基金管理人届时公告的其他选择权。

③基金份额持有人可就其持有的本基金全部或部分基金份额选择行使上述任一项选择权。

④除以下⑤所述情形外，基金份额持有人在指定期限内因行使选择权而赎回或转换转出本基金份额的，基金管理人免除基金份额持有人赎回或转换时应支付的赎回费或转换费（包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差，下同）等交易费用。

⑤在指定期限内，本基金可以开放申购及/或转换转入业务，但对该等申购及/或转换转入的份额，如其在指定期限内再赎回或转换转出的，基金管理人有权不予免除相应的赎回费或转换费等交易费用。

⑥指定期限届满，基金份额持有人没有做出选择的，视为基金份额持有人选择继续持有基金合并后的基金份额。

3、基金合并导致本基金终止并清算时，由此产生的清算费用由本基金财产承担。

4、基金合并后的投资管理

本基金吸收合并其他基金的，本基金的投资管理将按本基金合同约定保持不变。

本基金被其他基金吸收合并的，本基金的投资管理将按照其他基金基金合同的约定执行。

本基金与其他基金合并为新基金的，本基金的投资管理按照基金管理人、基金托管人协商一致的投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等执行。

5、基金管理人与基金托管人应就基金合并事宜协商一致，并按照本基金合同的约定具体实施，且无需经基金份额持有人大会审议批准。

（二）基金合同的变更

本基金合同的约定，变更内容需召开基金份额持有人大会审议的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

按照本基金合同的约定，变更内容无需召开基金份额持有人大会审议的，基金合同变更的内容应经基金管理人、基金托管人协商一致，并按照规定进行公告。

（三）本基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的。
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务。
- 3、本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金的。
- 4、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务。
- 5、本基金合同约定的其他情形
- 6、中国证监会规定的其他情况。

（四）基金财产的清算

1、基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组负责基金财产清算。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人及相关的中介服务机构组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止情形出现时，发布相关公告。
- （2）基金财产清算组成立后，由基金财产清算组统一接管基金财产。
- （3）对基金财产进行清理和确认。

- (4) 参加与基金财产有关的民事诉讼。
- (5) 对基金财产进行估价和变现。
- (6) 制作清算报告。
- (7) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计。
- (8) 聘请律师事务所出具法律意见书。
- (9) 将基金财产清算报告报中国证监会备案。
- (10) 公布基金财产清算报告。
- (11) 对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

4、基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用。
- (2) 交纳所欠税款。
- (3) 清偿基金债务。
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算报告的公告

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，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

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。

（五）本基金被其他基金吸收合并或本基金与其他基金合并为新基金引起本基金基金合同终止的，本基金财产应清理、估价，但可根据届时有效的相关规定，基金财产不予变现和分配。本基金的债权债务由合并后的基金享有和承担。本基金清算的其他事项按照《基金合同》的相关约定执行。

二十、违约责任

(一) 基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中, 违反《基金法》规定或者本基金合同约定, 给基金财产或者基金份额持有人造成损害的, 应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任; 因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的, 应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况之一的, 当事人免责:

1、不可抗力。

2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规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基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

(二) 基金合同当事人违反本基金合同, 给其他当事人造成损失的, 应当对直接损失承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下, 本基金合同能继续履行的, 应当继续履行。

(三) 本基金合同一方当事人造成违约后, 其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大; 没有采取适当措施致使损失扩大的, 不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四) 因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。

(五) 由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错, 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, 但是未能发现错误的, 由此造成基金财产或投资者损失, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

二十一、争议的处理

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员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, 对各方当事人均有约束力, 仲裁费用由败诉方承担。

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。

本基金合同受中国法律管辖。

二十二、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

（一）本基金合同由《泰和证券投资基金基金合同》修订而成。本基金合同经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或其授权签字人签章，并报中国证监会，自泰和证券投资基金终止上市之日起生效，原《泰和证券投资基金基金合同》自同一日起失效。本基金合同的有效期限至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（二）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

（三）本基金合同正本一式六份，除上报监管机构两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

（四）本基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所。投资者可登录基金管理人和基金托管人网站查询。基金合同效力应以基金合同正本为准。

二十三、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。