

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金
上市交易公告书

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一一年三月二十三日

目录

一、重要声明与提示..... 1

二、基金概览..... 2

三、基金的募集与上市交易 3

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 8

五、基金主要当事人简介 9

六、基金合同摘要..... 15

七、基金财务状况 16

八、基金投资组合 18

九、重大事件揭示..... 21

十、基金管理人承诺 22

十一、基金托管人承诺 24

十二、基金上市推荐人意见 25

十三、备查文件目录..... 26

附件：基金合同摘要.....27

一、重要声明与提示

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》），《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2010年12月17日刊登在《中国证券报》及华泰柏瑞基金管理有限公司网站(www.huatai-pb.com)上的《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

- 1、基金二级市场交易简称：中小ETF。
- 2、二级市场交易代码：510220。
- 3、基金申购、赎回简称：中小申赎。
- 4、申购、赎回代码：510221。
- 5、2011年3月21日基金份额总额：95,229,161份。
- 6、2011年3月21日基金份额净值：3.625元。
- 7、本次上市交易份额：95,229,161份。
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 9、上市交易日期：2011年3月28日。
- 10、基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司。
- 11、基金托管人：中国银行股份有限公司。
- 12、上市推荐人：西南证券股份有限公司。

13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司和中航证券有限公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1535 号文。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：本基金自 2010 年 12 月 20 日起至 2011 年 1 月 18 日止通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售期间为 2010 年 12 月 20 日起至 2011 年 1 月 18 日，网上现金发售日期为 2011 年 1 月 14 日至 2011 年 1 月 18 日，网下股票认购的发售期间为 2011 年 1 月 14 日至 2011 年 1 月 18 日。

5、发售价格：1.00 元人民币。

6、发售期限：网下现金发售 22 个工作日，网上现金发售 3 个工作日，网下股票认购 3 个工作日。

7、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

8、发售机构

（1）直销机构

网下现金发售直销机构：华泰柏瑞基金管理有限公司。

（2）代销机构

本基金的网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构为爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、第一创业有限责任公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国

信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司和中原证券股份有限公司等。

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银

证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、天风证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万和证券经纪有限责任公司、万联证券有限责任公司、五矿证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司和中邮证券有限责任公司等。

（二）基金合同生效

截至2011年1月18日本基金募集工作顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集确认的募集金额总额为348,418,327.00元人民币（含所募集股票市值），折合基金份额348,418,327.00份；经基金注册登记机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计9,120.00元人民币，折合基金份额9,120.00份。该资金已于2011年1月24日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户；所募集股票已于2011年1月24日由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理过户。

本次募集有效认购总户数为4,932户，按照每份基金份额初始面值人民币1.00元计算，本次募集期间有效认购份额（含所募集股票市值）和利息结转的基金份额合计348,427,447.00份，已全部计入相应基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。本基金管理人及本公司的基金从业人员没有认购本基金。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2011年1月26日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）基金份额折算

根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定2011年3月11日为本基金的基金份额折算日，折算后的基金份额净值与基金份额折算日标的指数收盘值的千分之一基本一致。2011年3月11日，上证中小盘指数收盘值为3683.60点，基金资产净值为350,787,014.18元，折算前基金份额总额为348,427,447.00份，折算前基金份额净值为1.007元。

根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.27331199，折算后基金份额总额为95,229,161.00份，折算后基金份额净值为3.684元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2011年3月14日进行了变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法计算保留到整数位。投资者可以自2011年3月15日起在其上海证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（四）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所 上证债字[2011]55号。

2、上市交易日期：2011年3月28日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：中小ETF。

5、二级市场交易代码：510220。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：中小申赎。

7、申购、赎回代码：510221。

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。目前本基金的一级交易商包括：长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限

公司、华泰联合证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司和中航证券有限公司。

8、本次上市交易份额：95,229,161.00份。

9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2011年3月21日，本基金份额持有人户数为4,932户，平均每户持有的基金份额为 19,308 份。

（二）持有人结构

截至2011年3月21日，本基金份额持有人结构如下：机构投资者持有的基金份额为45,790,210份，占基金总份额的48.08%；

个人投资者持有的基金份额为49,438,951份，占基金总份额的 51.92%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2011年3月21日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例
1	太平人寿保险有限公司	5,466,622	5.74%
2	中国人民财产保险股份有限公司—传统—普通	5,466,622	5.74%
3	东兴证券—光大—东兴1号 优选基金集合资产	4,919,616	5.17%
4	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险	2,733,175	2.87%
5	华泰证券—招行—华泰紫金 2号集合资产管理	2,733,120	2.87%
6	国金证券股份有限公司	2,186,496	2.30%
7	兴业证券股份有限公司	2,186,496	2.30%
8	中航证券有限公司	2,186,496	2.30%
9	中国银河证券股份有限公司	2,186,496	2.30%
10	国信—招行—国信金理财收 益互换(多策略)	2,186,496	2.30%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
- 2、注册地址：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层
- 3、法定代表人：齐亮
- 4、总经理：陈国杰
- 5、成立日期：2004 年 11 月 18 日
- 6、批准设立机关：中国证券监督管理委员会
- 7、批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号
- 8、工商登记注册的法人营业执照文号：310000400404609
- 9、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
- 10、组织形式：有限责任公司
- 11、注册资本：贰亿元人民币
- 12、存续期间：持续经营
- 13、信息披露负责人：陈晖

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

14、股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

15、内部组织结构及职能：

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

目前，公司下设 23 个部门，并在北京、深圳分别设立了分公司。

投资部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票投资。

专户投资部：负责专户的投资管理。

海外投资部：负责公司 QDII 的投资管理。

指数投资部：负责指数研究、设计和开发工作，以及进行指数产品的投资管理。

研究部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行行业和上市公司研究。

交易部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行交易指令执行与监督。

北京分公司、深圳分公司、第一营销中心、第二营销中心、第三营销中心：负责基金销售。

机构理财部：负责机构客户的业务拓展。

营销管理总部：负责对外开拓维护渠道总部，对内管理服务渠道销售人员。

市场部：负责公司品牌、基金产品的市场推广服务。

客户服务部：负责公司的客户服务。

业务发展部：负责基金产品研发等新业务拓展。

基金事务部：负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

信息技术部：负责公司信息系统的日常运行与开发。

法律监察部：负责内部法律事务咨询，处理外部法律事务，检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况，负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。

风险管理部：负责投资、交易环节风险提示及控制，研究公司风险管理政策与方针，协调各部门处理公司层面风险事项。

人力资源部：负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。

行政管理部：负责公司后勤服务、公文档案管理。

公司财务部：负责公司财务事项。

16、人员情况：

截止 2010 年 12 月 31 日，公司员工人数为 142 人。员工受教育程度分布：大专学历人员占 7%，本科学历人员占 37%，硕士学历人员占 53%，博士以及博士后学历人员占 3%。

17、基金管理业务情况简介：

截止 2010 年 12 月 31 日，公司共管理 9 只开放式基金，其中 5 只股票型基金，分别是华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金和华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金；1 只混合型基金，华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、1 只债券型基金，华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金、1 只货币型基金，华泰柏瑞货币市场证券投资基金和 1 只 QDII 基金，华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金。截至 2010 年 12 月 31 日，公司管理的基金资产规模为人民币 195.31 亿元，总份额规模为 215.07 亿份。

18、本基金基金经理

张娅女士：7 年证券（基金）从业经验，美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA，具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI 公司、SunGard Energy 和联合证券工作，2004 年加入本公司，从事投资研究和金融工程工作。2006 年 11 月开始至今担任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利 ETF 基金的基金经理。2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部总监。

柳军先生：11 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士。2000 年至 2001 年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作，2001 年至 2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009 年 6 月起任华泰柏瑞（原友邦华泰）上证红利 ETF 基金的基金经理。2010 年 10 月 1 日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。

（二）基金托管人

- 1、名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
 - 2、住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号
 - 3、首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日
 - 4、变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日
 - 5、注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
 - 6、存续期间：持续经营
 - 7、法定代表人：肖 钢
 - 8、基金托管业务资格批准机关：中国证监会
 - 9、基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
 - 10、托管及投资者服务部总经理：董杰
 - 11、托管部门联系人：王圣明
- 电话：（010）66594911
- 传真：（010）66594791

12、基金托管部人员情况

截至 2010 年 12 月末，中国银行资产托管部共有员工 130 多人。

13、业务经营情况：

截止 2010 年 12 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、工银全球股票(QDII)、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球

景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)等 95 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）上市推荐人

名称：西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

办公地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

法定代表人：王珠林

联系人：陈诚

电话：（023）63786464

传真：（023）63810422

客服电话：400-809-6096

公司网址：www.swsc.com.cn

（四）一级交易商

一级交易商	客户服务电话	公司客服网址
长江证券股份有限公司	95579 或 4008-888-999	www.95579.com
德邦证券有限责任公司	400-888-8128	www.tebon.com.cn
东兴证券股份有限公司	400-888-8993	www.dxzq.net
广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
国信证券股份有限公司	95536	www.guosen.com.cn
华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
华泰联合证券有限责任公司	95513	www.lhzq.com
宏源证券股份有限公司	400-800-0562	www.hysec.com
山西证券股份有限公司	400-666-1618	www.i618.com.cn
西南证券股份有限公司	400-809-6096	www.swsc.com.cn
中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinastock.com.cn
中国建银投资证券有限责任公司	400-600-8008	www.cjis.cn
中航证券有限公司	400-886-6567	www.avicsec.com

（五）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：薛竞、单峰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至2011年3月21日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资 产：		负债：	
银行存款	5,054,475.08	短期借款	-
结算备付金	9,773,058.30	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	329,959,067.56	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	329,959,067.56	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	101,001.14
基金投资	-	应付托管费	20,200.21
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	288,950.39
应收证券清算款	876,663.85	应付税费	-
应收利息	454.01	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	70,820.57
其他资产	-	负债合计	480,972.31
		所有者权益：	
		实收基金	348,427,447.00
		未分配利润	-3,244,700.51
		所有者权益合计	345,182,746.49

资产合计:	345,663,718.80	负债与持有人权益总计:	345,663,718.80

注:1、截至2011年3月21日,基金份额净值**3.625**元,基金份额总额95,229,161.00份。

2、本报告期自**2011年1月26**日起至2011年3月21日止。本基金合同于**2011年1月26**日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2011年3月21日，本基金的投资组合情况如下：

(一) 基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
权益投资	329,959,067.56	95.46
其中：股票	329,959,067.56	95.46
固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-
资产支持证券	-	-
金融衍生品投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	14,827,533.38	4.29
其他各项资产	877,117.86	0.25
合计	345,663,718.80	100.00

(二) 按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,062,749.00	1.47
B	采掘业	17,802,016.00	5.16
C	制造业	170,378,255.88	49.36
C0	食品、饮料	17,896,299.96	5.18
C1	纺织、服装、皮毛	8,144,079.00	2.36
C2	木材、家具	921,638.00	0.27
C3	造纸、印刷	3,263,876.00	0.95
C4	石油、化学、塑胶、塑料	19,009,251.43	5.51
C5	电子	10,234,807.10	2.97
C6	金属、非金属	25,187,878.12	7.30
C7	机械、设备、仪表	56,956,225.18	16.50
C8	医药、生物制品	24,952,040.49	7.23
C9	其他制造业	3,812,160.60	1.10

D	电力、煤气及水的生产和供应业	17,109,702.07	4.96
E	建筑业	11,280,045.72	3.27
F	交通运输、仓储业	22,905,139.80	6.64
G	信息技术业	17,515,290.75	5.07
H	批发和零售贸易	19,705,442.75	5.71
I	金融、保险业	5,669,381.40	1.64
J	房地产业	14,289,768.00	4.14
K	社会服务业	6,993,219.83	2.03
L	传播与文化产业	3,014,545.00	0.87
M	综合类	18,233,511.36	5.28
	合计	329,959,067.56	95.59

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	142,724	5,160,899.84	1.50
2	601989	中国重工	294,300	3,881,817.00	1.12
3	601766	中国南车	426,800	3,286,360.00	0.95
4	600887	伊利股份	86,916	3,188,948.04	0.92
5	600795	国电电力	1,011,540	3,044,735.40	0.88
6	600739	辽宁成大	97,300	2,987,110.00	0.87
7	600068	葛洲坝	224,400	2,937,396.00	0.85
8	600256	广汇股份	80,510	2,933,784.40	0.85
9	601299	中国北车	355,300	2,746,469.00	0.80
10	600690	青岛海尔	86,060	2,481,109.80	0.72

（四）按债券品种分类的债券投资组合

截止2011年3月21日，本基金未持有债券。

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截止2011年3月21日，本基金未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1 自本基金合同生效日至2011年3月21日,本基金前十名证券的发行主体中无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3 其他资产构成如下:

序号	名称	金额(元)
1	应收证券清算款	876,663.85
2	应收利息	454.01
	合计	877,117.86

4 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细截止2011年3月21日,本基金未持有资产支持证券。

5 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细

截止2011年3月21日,本基金未持有权证。自基金合同生效日至2011年3月21日,本基金未投资任何权证。

6 本报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

截止2011年3月21日,本基金未持有可转换债券。

7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差

九、重大事件揭示

以 2011 年 3 月 11 日为基金份额折算日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三章的“（三）基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

基金管理人就本基金上市交易后履行管理人职责做出如下承诺：

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。本基金管理人承诺真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- （1）越权或违规经营；
- （2）违反基金合同或托管协议；
- （3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- （5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- （6）玩忽职守、滥用职权；

（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

- （8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰

乱市场秩序；

- (9) 贬损同行，以抬高自己；
- (10) 以不正当手段谋求业务发展；
- (11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为西南证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

- （一） 中国证监会批准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- （二） 《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三） 《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四） 注册登记协议
- （五） 基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六） 基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七） 华泰柏瑞基金管理有限公司募集设立上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一一年三月二十三日

基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

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或卖出其持有的基金份额；
- (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、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购对价及基金合同规定的费用；
- (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、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；

- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

3、基金管理人的权利：

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- (8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督

和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 以基金管理人的名义，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；

(16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(17) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

4、基金管理人的义务：

(1) 依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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基金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) 按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基金收益；

(7) 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；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；

(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以保密，不得向他人泄露；

(15) 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对价；

(16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

(17) 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；

（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的合法权益，应承担赔偿责任，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、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

5、基金托管人的权利：

（1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

（5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

（6）法律法规、基金合同规定的其它权利。

6、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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产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) 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和独立；

(6) 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；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

(9) 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以保密，不得向他人泄露；

(10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，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；

(12) 建立、保存基金份额持有人名册；

(13) 复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值；

(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除组合证券以外的赎回对价；

(16) 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；

（17）按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

（18）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

（19）因基金管理人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，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

（20）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金的联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

本基金的联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（二）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；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、本基金与其他基金合并；
- 9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 10、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）有以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改本基金合同，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、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

- 4、对基金合同的修改不涉及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、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式：

1、除法律法规或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。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，基金托管人认为有必要召开的，应当自行召集。

3、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。

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。

5、代表基金份额 10%的基金份额持有人就同一事项书面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，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

6、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。

7、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点、方式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）代理投票授权委托书送达时间和地点；
- （4）会务常设联系人姓名、电话；
- （5）权益登记日；

2、如采用通讯表决方式，会议通知还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人作为监督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作为监督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作为监督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。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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，基金管理人或托管人拒不派代表列席的，不影响表决效力；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、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益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人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；

3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

4、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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

（七）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。

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提出临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 日前提交召集人，并由召集人公告。

（3）对于基金管理人、基金托管人或基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）代表基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 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

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

(八) 表决

1、基金份额持有人所持每份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) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

(2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上通过。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

4、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。

（九）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，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推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推举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

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

（3）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；如果出席大会的基金份额持有人或其代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，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；重新清点后，大会持有人应当当场公布重新清点结果。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：

由大会召集人指定的两名计票员在监督人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

（十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》等有关法律法规规定表决通过的事项，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。

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、基金托管人均有法律约束力。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的决定。

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（十一）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、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

- 1、基金收益分配采用现金方式；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，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，可进行收益分配；
- 4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值；
- 5、基金收益分配比例为收益评价日符合上述基金分红条件的基金超额收益的 100%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多 4 次；
- 6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

（二）基金收益分配数额的确定原则

- 1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率为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 1 乘以 100%；标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘价与基金份额折算日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金超过标的指数的收益率=基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率

截至收益评价日基金超过标的指数的超额收益=（基金累计报酬率-标的指数同期累计报酬率）×收益评价日发行在外的基金份额总额×基金份额折算日基金份额净值。

2、每基金份额的应分配收益为上述确定的基金超额收益数额除以收益评价日发行在外的基金份额总额，保留小数点后3位，第4位舍去。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金超额收益、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。

（四）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（五）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时需要向本基金的注册登记机构支付一定的收益分配费用，该部分费用在基金财产中列支。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、因基金的证券交易或结算而产生的费用（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、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；

4、基金合同生效以后的信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

- 6、基金合同生效以后的会计师费和律师费和诉讼费；
- 7、基金资产的资金汇划费用及开户费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金收益分配中发生的费用；
- 10、指数使用费；
- 11、按照国家有关法律法规规定和基金合同约定，可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.50%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.10%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。计算

方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、指数使用费：

本基金的指数使用费即指数许可使用基点费，为 ETF 年度基金资产净值的 0.03%（3bp），许可使用基点费的收取下限为每季人民币伍万（50,000）元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的 ETF 基金资产净值的 0.03%（3 个基点）的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的 ETF 基金资产净值。

4、本条第（一）款第 3 至第 11 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、

信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（二）投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，如因标的指数成份股调整导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券、非成份股、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，股指期货以套期保值为目的，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

（三）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（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、行政法规有关法律法规规定, 由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

(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) 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%; 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 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; 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的 20%; 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%; 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, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金;

(3) 违反基金合同关于投资范围和投资比例等约定;

(4) 中国证监会规定禁止的其他情形。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

由于证券期货市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回对价应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

(二) 估值日

本基金合同生效后，每个工作日对基金财产进行估值。

(三) 估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

(四) 估值方法

1、股票估值方法

(1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

（3）有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值办法

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）证券交易所市场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（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）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，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

（4）在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。

（5）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

（6）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。

3、权证估值：

(1) 配股权证的估值:

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值:

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值。

4、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

7、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-6 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

(五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，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。

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所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财产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

（七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额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份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 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。

（八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、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财产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理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；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 7 项条款进行估值时，

所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，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，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（十）基金资产净值、基金份额净值公告

《基金合同》生效后，在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。

在办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，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款规定的市场交易日的次日，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媒体和基金管理人网站上。

七、《基金合同》解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、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、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、

《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（二）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算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。

3、清算程序

（1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行评估和变现；

（5）制作清算报告；

（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对基金财产进行分配；

(9) 清算期限为 6 个月。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

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）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易单元保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做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公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。