

# 华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2012年6月8日

公告日期：2012年6月5日

# 目 录

一、 重要声明与提示.....	3
二、 基金概览.....	3
三、 基金的募集与上市交易.....	4
四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、 基金主要当事人介绍.....	7
六、 基金合同的内容摘要.....	10
七、 基金财务状况.....	11
八、 基金投资组合.....	12
九、 重大事件揭示.....	15
十、 基金管理人承诺.....	15
十一、 基金托管人承诺.....	16
十二、 备查文件目录.....	16

## 一、重要声明与提示

《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》（以下简称“本公告”）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〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）管理人华宝兴业基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公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。

中国证监会、深圳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。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2011年8月31日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及华宝兴业基金管理有限公司网站([www.fsfund.com](http://www.fsfund.com))上的《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）招募说明书》。

## 二、基金概览

### （一）基金名称

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)(基金简称:华宝油气(LOF); 基金场内简称:华宝油气; 基金代码:162411)

### （二）基金份额总额

截至2012年6月1日,本基金份额总额:71,398,219.09份

### （三）基金份额净值

截至2012年5月31日,本基金份额净值:0.857元

### （四）本次上市交易份额

截至2012年6月1日,本次上市交易份额:5,241,405份

### （五）上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

### （六）上市交易日期:2012年6月8日

(七) 基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

(八) 基金托管人：中国建设银行股份有限公司

(九) 境外托管人：纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)

(十) 登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

### 三、 基金的募集与上市交易

(一) 本基金募集情况

- 1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2011】1301号
- 2、基金合同生效日：2011年9月29日
- 3、基金运作方式：契约型、上市开放式（LOF）
- 4、基金合同期限：不定期
- 5、发售日期：2011年9月5日起至2011年9月23日
- 6、发售价格：人民币1.00元
- 7、发售方式：场内、场外认购
- 8、发售机构：

(1) 场内代销机构

场内代销机构是指具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单可在深圳证券交易所网站查询。

(2) 场外销售机构

①直销机构

本公司直销中心以及网上直销系统（[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)）。

②代销机构

中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、信达证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、华宝证券有限责任公

司、国都证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国元证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、江海证券有限公司、中航证券有限公司、恒泰证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司。

9、验资机构名称：安永华明会计师事务所

10、募集资金总额及入账情况

本次募集有效认购总户数为 3,087 户，募集总金额为 373,243,682.43 元人民币，其中，认购资金在募集期间产生的利息共计 88,340.58 元人民币。经安永华明会计师事务所验资，募集资金已于 2011 年 9 月 29 日划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11、本基金募集备案情况

本基金于 2011 年 9 月 29 日验资完毕，并于当日向中国证监会办理基金备案手续，基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2011 年 9 月 29 日

13、基金合同生效日的基金份额总额：373,243,682.43 份

（二）本基金日常申购、赎回情况

本基金已于 2011 年 10 月 25 日开放日常申购、赎回业务，详细信息请投资者查阅刊登在 2011 年 10 月 21 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站(www.fsfund.com) 上的《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回业务的公告》。

（三）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所、深证上【2012】153 号

2、上市交易日期：2012 年 6 月 8 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金场内简称：华宝油气

5、基金代码：162411

6、本次上市交易份额：5,241,405 份

7、基金净值的披露：基金管理人每个估值日对基金资产估值。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，基金托管人复核。本基金上市交易后，基金管理人于每个工作日估值结束后将经过基金托管人复核的前一个工作日的基金份额净值传送给深圳证券交易所，深圳证券交易所于下个工作日通过行情系统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：持有人通过场外代销机构持有的基金份额，需转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

## 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 2012 年 6 月 1 日，本基金场内份额持有人户数为 324 户，平均每户持有的场内基金份额为 16,177 份。

### （二）持有人机构

截至 2012 年 6 月 1 日，本基金场内投资者持有基金份额 5,241,405 份。其中，场内机构投资者持有的基金份额为 4,559,381 份，占基金场内总份额的 86.99%；场内个人投资者持有的基金份额为 682,024 份，占基金场内总份额的 13.01%。

### （三）截至 2012 年 6 月 1 日，前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	海通证券股份有限公司	2,284,787.00	43.59%
2	招商证券股份有限公司	1,136,738.00	21.69%
3	中国银河证券股份有限公司	1,136,738.00	21.69%
4	罗树恩	50,002.00	0.95%
5	谢维芬	40,012.00	0.76%
6	王汉良	30,002.00	0.57%
7	付华	30,001.00	0.57%
8	马秀清	29,648.00	0.57%
9	马美玉	20,000.00	0.38%
10	邓敏	19,000.00	0.36%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

## 五、基金主要当事人介绍

### (一) 基金管理人

#### 1、公司概况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

法定代表人：郑安国

总经理：裴长江

注册资本：人民币 1.5 亿元

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2003]19 号

工商登记注册的法人营业执照文号：310000400334472

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

股东名称及其出资比例：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51% 的股份，外方股东法国领先资产管理有限公司持有 49% 的股份。

#### 2、内部组织结构及职能

公司下设 22 个部门，包括：国内投资部、固定收益部、机构投资部、研究部、量化投资部、海外投资管理部、策略部、监察稽核部、风险管理部、北京分公司、深圳分公司（中西部、北方、华北、华南、华东等投资服务中心）、机构及海外销售部、产品开发部、专户营销部、营销策划部、市场支持部、电子商务部、交易部、清算登记部、信息技术部、财务部、人事行政部。

各部门主要职责概述如下：

国内投资部：主要负责国内主动权益基金的投资管理。

固定收益部：主要负责固定收益产品的投资研究工作。

机构投资部：主要负责非公募产品的投资管理和投资咨询工作。

研究部：主要负责宏观经济、行业及上市公司研究。

量化投资部：主要负责管理主动和被动量化基金产品、开展数量化投资策略研究的部门。

海外投资管理部：主要负责 QDII 基金的投资研究工作。

策略部：主要负责宏观经济和投资策略研究。

监察稽核部：主要负责公司内控的评估及相应制度完善。

风险管理部：主要负责公司投资组合的风险评估并提供风险管理建议。

北京分公司：主要负责维护公司在北方地区销售渠道。

深圳分公司：主要负责维护公司在南方地区销售渠道。

机构及海外销售部：主要负责向机构客户销售公募产品和提供相关服务。

产品开发部：主要负责公司产品战略，开发各种基金品种。

专户营销部：主要负责向机构客户、高端个人客户和渠道销售特定资产管理产品（即专户产品）。

营销策划部：主要负责公司市场营销、品牌建设、营销宣传、公关维护、渠道规划、渠道开发与维护等业务。

市场支持部：主要负责 Call Center 的管理和客户服务工作，还负责公司市场人员的 KPI 考核、费用管理、市场部内部事务支持等工作。

电子商务部：主要负责公司基金电子直销业务。

交易部：主要负责所有投资组合的交易管理。

清算登记部：主要负责基金交易的资金调拨、交易清算；组织基金会计核算。

信息技术部：主要负责公司信息系统的系统开发和日常维护。

财务部：主要负责公司财务管理、会计核算和资金管理。

人事行政部：主要负责公司人力资源管理和行政管理。

3、主要人员情况截止 2012 年 3 月 31 日，公司共有员工 178 人，其中博士及博士以上有 11 人，硕士 91 人，本科 67 人，专科及以下 9 人。

4、信息披露负责人：刘月华

电话：021-38505888

5、基金管理业务情况

截至 2012 年 3 月 31 日，华宝兴业基金管理有限公司旗下共管理 22 只开放式基金，资产管理规模为 332 亿元。旗下管理的基金有华宝兴业宝康消费品证券投资基金、华宝兴业宝康灵活配置证券投资基金、华宝兴业宝康债券投资基金、华宝兴业动力组合股票型证券投资基金、华宝兴业多策略增长开放式证券投资基金、华宝兴业现金宝货币市场基金、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金、华宝兴业先进成长股票型证券投资基金、华宝兴业行业精选股票型证券投资基金、华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金、华宝兴业增强收益债券型证券



投资基金、华宝兴业中证 100 指数证券投资基金、华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金、上证 180 价值交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业新兴产业股票型证券投资基金、华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、上证 180 成长交易型开放式证券投资基金、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式证券投资基金联接基金、华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）、华宝兴业医药生物优选股票型证券投资基金。

## 6、本基金基金经理

尤柏年先生，华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理、华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理，经济学博士，证券从业经历 9 年。曾在澳洲 APEX Consulting Pty Ltd 从事金融工程电脑模型设计工作。2007 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司任基金经理助理，2011 年 3 月起任华宝兴业成熟市场 QDII 基金经理，2011 年 9 月兼任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理。

### （二）基金托管人

#### 1、基金托管人概况

名称：中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

成立时间：2004 年 9 月 17 日

法定代表人：王洪章

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

联系电话：(010) 6759 5003

联系人：尹东

#### 2、专门基金托管部门及人员情况

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

#### （三）验资机构

名称：安永华明会计师事务所

法定代表人：葛明

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

邮政编码：100738

公司电话：(010) 58153000

公司传真：(010) 85188298

签章会计师：严盛炜，边卓群

业务联系人：边卓群

## 六、基金合同的内容摘要

详见本公告书附件。

## 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，不从基金资产中支付，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

### (二) 基金上市前重要财务事项

本基金募集结束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 2012 年 5 月 31 日的资产负债表如下：

资 产：	
银行存款	9,214,814.00
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	55,851,793.27
其中：股票投资	51,509,447.91
债券投资	
资产支持证券投资	
基金投资	4,342,345.36
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	5,813.29
应收股利	59,724.32
应收申购款	187,448.16
其他资产	1,488,847.82
<b>资产合计：</b>	<b>66,808,440.86</b>
负 债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	3,814,109.24
应付赎回款	70,593.38

应付管理人报酬	50,437.68
应付托管费	14,122.57
应付销售服务费	
应付交易费用	
应付税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	1,650,556.38
<b>负债合计</b>	<b>5,599,819.25</b>
所有者权益：	
实收基金	71,398,219.09
未分配利润	-10,189,597.48
<b>所有者权益合计</b>	<b>61,208,621.61</b>
<b>负债与所有者权益总计：</b>	<b>66,808,440.86</b>

注：报告截止日 2012 年 5 月 31 日，基金份额净值 0.857 元，基金份额总额 71,398,219.09 份。

## 八、 基金投资组合

截至 2012 年 5 月 31 日，本基金的投资组合如下：

(一) 期末（2012 年 5 月 31 日）基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	51,509,447.91	77.10
	其中：普通股	51,509,447.91	77.10
	优先股	-	
	存托凭证	-	
	房地产信托凭证	-	
2	基金投资	4,342,345.36	6.50
3	固定收益投资	-	
	其中：债券	-	
	资产支持证券	-	
4	金融衍生品投资	-	

	其中：远期	-	
	期货	-	
	期权	-	
	权证	-	
5	买入返售金融资产	-	
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	
6	货币市场工具	-	
7	银行存款和结算备付金合计	9,214,814.00	13.79
8	其他资产	1,741,833.59	2.61
9	合计	66,808,440.86	100.00

(二) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 在各个国家 (地区) 证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家 (地区)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
美国	51,509,447.91	84.15
合计	51,509,447.91	84.15

(三) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
能源	51,509,447.91	84.15
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	51,509,447.91	84.15

(四) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
----	-----------	-----------	------	--------	-----------	--------	-------------	---------------

1	SUNOCO INC	太阳石油	SUN US	纽约	美国	3,618	1,064,719.42	1.74
2	GEORESOURCES INC	GeoResources Inc	GEOI US	纳斯达克	美国	4,280	968,039.06	1.58
3	EXCO RESOURCES INC	EXCO 资源公司	XCO US	纽约	美国	20,846	950,902.80	1.55
4	COMSTOCK RESOURCES INC	Comstock Resources Inc	CRK US	纽约	美国	9,500	899,799.39	1.47
5	WESTERN REFINING INC	Western Refining Inc	WNR US	纽约	美国	7,321	897,031.66	1.47
6	REX ENERGY CORP	Rex Energy Corp	REXX US	纳斯达克	美国	13,528	862,208.84	1.41
7	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	XOM US	纽约	美国	1,719	856,337.67	1.4
8	CABOT OIL & GAS CORP	卡伯特石油天然气公司	COG US	纽约	美国	4,150	855,552.26	1.4
9	CVR ENERGY INC	CVR Energy Inc	CVI US	纽约	美国	5,255	846,975.26	1.38
10	RANGE RESOURCES CORP	Range 资源公司	RRC US	纽约	美国	2,281	830,081.26	1.36

(五) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 按券种分类的债券投资组合

无。

(六) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

无。

(七) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

(八) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

(九) 期末 (2012 年 5 月 31 日) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	ETF 基金	开放式	SSGA Funds Management Inc	4,342,345.36	7.09

#### (十) 投资组合报告附注

1、本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

2、本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	59,724.32
4	应收利息	5,813.29
5	应收申购款	187,448.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,488,847.82
9	合计	1,741,833.59

4、期末（2012年5月31日）持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5、期末（2012年5月31日）前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 九、 重大事件揭示

华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金合同已于2011年9月29日正式生效，基金管理人已于2011年9月30日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金合同生效公告。

## 十、 基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 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、证券交易所的监督管理。

(三) 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。

## 十一、 基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二) 根据《证券投资基金法》、《证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《证券投资基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、 备查文件目录

(一) 本基金备查文件包括下列文件：

1、中国证监会核准华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

(二) 备查文件的存放地点和投资者查阅方式：



以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

## 附件：基金合同摘要

### （一）基金合同当事人的权利及义务

#### 1. 基金管理人

##### （1）基金管理人基本情况

名称：华宝兴业基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 48 楼

法定代表人：郑安国

成立日期：2003 年 3 月 7 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]19 号

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

##### （2）基金管理人的权利

- 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监管部门批准的其他收入；
- 3) 发售基金份额；
- 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，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，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) 根据有关规定，选择、更换或撤消证券经纪代理商以及证券登记机构，并对其行为进行必要的监督；
- 7) 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；

8) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

9) 在法律法规或监管机构允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

10) 自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；

11) 选择、更换代销机构，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；

12) 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；

13) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

14) 依法召集基金份额持有人大会；

15) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### (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，基于谨慎的原则，控制基金资产的流动性风险，保证基金资产正常运作；

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) 确保管理人或其委托的境外投资顾问发送的交易数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据真实、准确、完整，因数据原因造成基金资产或其他当事人的财产损失，由基金管理人承担赔偿责任；

6) 委托境外投资顾问进行境外证券投资的，境外投资顾问应符合《试行办法》规定的有关条件；

7) 承担受信责任，在挑选、委托投资顾问过程中，履行尽职调查义务；

8) 严格遵守境内有关法律法规、基金合同的规定，始终将基金持有人的利益置于首位，以合理的依据提出投资建议，寻求基金的最佳交易执行，公平客观对待所有客户，始终按照基金的投资目标、策略、政策、指引和限制实施投资决定，充分披露一切涉及利益冲突的重要事实，尊重客户信息的机密性；

9) 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;

10) 确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具;严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法規有关投资范围和比例限制的规定,确定清晰、可执行的投资范围和投资比例,并在规定时间内,对超范围、超比例的投资进行调整,并承担相应的责任;

11) 确保基金管理人向基金托管人发送的基金认购、申购和赎回数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定,并保证该数据的真实、准确和完整,因数据原因造成基金财产或其他当事人损失的,由基金管理人负责赔偿;

12) 委托境外证券服务机构代理买卖证券的,应当严格履行受信责任,并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理。

13) 与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排,应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行;

14) 进行境外证券投资,应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法規规定。

15) 如需在托管人选择的机构之外保管、登记基金财产,应严格审查,保证基金财产的安全,以及相关资产收益准确、按时归入基金财产;

16) 严格按照全球投资表现标准(GIPS)选取投资业绩标准;

17) 除依据《基金法》、《试行办法》、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;

18) 依法接受基金托管人的监督;

19) 计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

20) 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;

21) 按规定受理申购和赎回申请,严格控制基金投资产品的流动性风险,确保及时、足额支付赎回款项;

22) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

23) 编制季度、半年度和年度基金报告;

24) 及时复核基金托管人提供的公司行为信息;

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

26) 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》、《试行办法》和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；

27) 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；

28) 依据《基金法》、《运作办法》、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；

29) 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；

30) 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；

31) 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；

31) 授权投资顾问负责投资决策的，应当在协议中明确投资顾问由于本身差错、疏忽、未履行职责等原因而导致财产受损时应当承担相应责任；

33) 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；

34) 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；

35) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

36) 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；

37) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

38) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

39) 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；

40) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 2. 基金托管人

### (1) 基金托管人基本情况

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：王洪章

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

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

## （2）基金托管人的权利

- 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) 选择、更换负责境外资产托管业务的境外托管人；
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 4) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- 5) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- 6) 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；
- 7) 依法召集基金份额持有人大会；
- 8) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
- 9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## （3）基金托管人的义务

- 1) 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；
- 2) 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；
- 3) 除依据《基金法》、《试行办法》、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；
- 4) 保护持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、国家外汇局报告；
- 5) 安全保管存放于基金托管人处的基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

6) 按照规定监督基金管理人的投资运作, 确保基金按照有关法律法规和基金合同约定的投资目标和限制进行管理;

7) 按照有关法律法规和基金合同的约定执行基金管理人、境外投资顾问的指令, 及时办理清算、交割事宜;

8) 确保基金的份额净值按照有关法律法规和基金合同规定的方法进行计算;

9) 确保基金按照有关法律法规和基金合同的规定进行申购、认购、赎回等日常交易;

10) 确保基金根据有关法律法规和基金合同确定并实施收益分配方案;

11) 按照有关法律法规和基金合同的规定, 基金托管人对由基金托管人或其委托的境外托管人实际有效控制的证券承担安全保管责任;

12) 每月结束后 7 个工作日内, 向中国证监会和国家外汇局报告基金境外投资情况, 并按相关规定进行国际收支申报;

13) 安全保管可以承担保管责任的基金资产, 开设或委托开设资金账户和证券账户;

14) 办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务;

15) 保存基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料, 其保存的时间应当不少于 20 年;

16) 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;

17) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他法律法规另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不得向他人泄露;

18) 对基金财务会计报告、季度、半年度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;

19) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

20) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

21) 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;

22) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

23) 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;

24) 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;

25) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应对直接损失承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

26) 选择的境外托管人, 应符合《试行办法》第十九条的规定;

27) 对基金的境外财产, 可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中, 因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的, 托管人应当承担相应责任;

28) 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;

29) 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;

30) 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;

31) 执行生效的基金份额持有人大会决议;

32) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

33) 保存与基金托管人职责相关的基金份额持有人名册;

34) 法律法规、中国证监会和国家外汇局根据审慎监管原则规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

因基金管理人原因造成基金托管人无法正常履行上述义务, 由基金管理人承担责任, 并对造成的基金财产损失承担相关赔偿责任。

如适用的法律法规和规章制度不再要求托管人履行上述职责的, 托管人按照变更后的相关规定履行职责。

### 3. 基金份额持有人

#### (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。

## (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) 遵守基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构关于开放式基金业务的相关规则及规定；
- 3) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 4) 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；
- 5) 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；
- 6) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 7) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 8) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会

1. 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共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

### 2. 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、基金托管人提议或代表或持有基金份额 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) 就同一事项提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1)提前终止基金合同；
- 2)转换基金运作方式；
- 3)变更基金类别；
- 4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 5)变更基金份额持有人大会程序；
- 6)更换基金管理人、基金托管人；
- 7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但基金合同及法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- 8)本基金与其他基金的合并；
- 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、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，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)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- 4)经中国证监会允许，基金管理人、登记结算机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 5)在不违反法律法规规定的情况下，接受其它币种的申购、赎回；
- 6)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 7)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重大变化；
- 8)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；
- 9)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。

### 3.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。

#### 4.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 30 天在指定媒体公告。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)会议拟审议的主要事项;
- 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,不影响计票和表决结果。

#### 5.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和通讯方式开会。
- 2)会议的召开方式由会议召集人确定,但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

3)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,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。

4)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。

5)会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人更换、提前终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

## (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：

A. 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%，下同)；

B. 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，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 25 个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### 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：

A. 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；

B. 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；

C. 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；

D. 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；

E.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、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符。

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不变。

3) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用

网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## 6. 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) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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就召开事由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交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

3) 对于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：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人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。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的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) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 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，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 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

### (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，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，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；基金托管人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金管理人授权代表主持；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。

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。

(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。

## 7.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；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同等重大事项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核准或者备案，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。

## 8.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监督员共同担任监票人；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监票人。

2)监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。

4)计票过程应由公证机关予以公证。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监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 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9.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

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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。关于本章第(二)条所规定的第(1)-(8)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准后方可执行，关于本章第 2 条所规定的第 9)、10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

(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自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10.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。

### (三) 基金的收益与分配

#### 1. 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基金费用后的余额；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。

#### 2. 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（即可供分配利润计算截止日）基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### 3. 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人自行承担。当投资人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，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 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) 基金收益分配后每一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。

#### 4. 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（即可供分配利润计算截止日）以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支

付方式等内容。

#### 5.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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

(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。

(3) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.分红方式的设置与变更

具体规则在招募说明书中列示。

#### (四) 基金的费用

##### 1. 基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费，含境外投资顾问收取的费用；
- (2) 基金托管人的托管费，含境外托管代理行收取的费用；
- (3) 标的指数许可使用费
- (4) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (5) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 基金上市费及年费；
- (10) 外汇兑换交易的相关费用；
- (11) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2.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。

##### 3.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 1.0%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

#### (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 0.28% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$$

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,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

#### (3) 基金的指数许可使用费

标的指数许可使用费按照基金管理人与指数许可方签署的指数许可使用合同的约定从基金财产中支付。

(4) 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规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

#### 4. 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。

5. 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 日前在指定媒体上刊登公告。

#### 6. 基金税收

基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定,履行纳税义务。

基金份额持有人根据中国法律法规规定,履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外,基金管理人和基金托管人不承担责任。

对于非代扣代缴的税收,基金管理人应聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管银行根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索

取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

## （五）基金的投资

### 1. 投资目标

通过严格的指数化投资策略，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%（以美元资产计价）。

本基金标的指数为标普石油天然气上游股票指数（S&P Oil & Gas Exploration & Production Select Industry Index），该指数是基于标普全市场指数（S&P Total Markets Index<sup>TM</sup>）的精选子行业指数之一，选择在美国主要交易所（纽约证券交易所、美国证券交易所、纳斯达克等）上市的石油天然气勘探、采掘和生产等上游行业的公司为标的，采用等市值加权的方法计算。

### 2. 投资范围

本基金主要投资于：（1）标普石油天然气上游股票指数成份股、备选成份股；（2）跟踪标普石油天然气上游股票指数的公募基金、上市交易型基金等；（3）固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金投资于标普石油天然气上游股票指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的 80%，投资于跟踪标普石油天然气上游股票指数的公募基金、上市交易型基金的比例不超过基金资产净值的 10%；投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

### 3. 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：标普石油天然气上游股票指数（全收益指数）

标普石油天然气上游股票指数（S&P Oil & Gas Exploration & Production Select Industry Index）是基于标普全市场指数（S&P Total Markets Index<sup>TM</sup>）的精选子行业指数之一，选择在美国主要交易所（纽约证券交易所、美国证券交易所、纳斯达克等）上市的石油天然气勘探、采掘和生产等上游行业的公司为标的，采用等市值加权的方法计算。

未来，如果标普石油天然气上游股票指数的提供商标准普尔公司终止对基金管理人继续使用该指数的授权，或者是标准普尔公司基于其独立判断停止继续发布该指数，或者有更权

威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金管理人在保护持有人合法利益的前提下，以不损害持有人利益为原则，可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无须召开基金份额持有人大会。

#### 4. 风险收益特征

本基金是一只美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。

#### 5. 投资限制

##### (1) 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

1) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%。银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款不受此限制。

2) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产（包括金融衍生产品）不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

3) 基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。

4) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

5) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。持有货币市场基金可以不受上述限制。

6) 基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

7) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

##### 8) 金融衍生品投资

为有效管理投资组合和规避风险，本基金可适当投资于衍生金融工具。金融衍生品投资应当符合法律法规及中国证监会的有关规定。

A. 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 20%。

B. 本基金投资衍生品支付的保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生

品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

C. 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

9) 相关法律法规、基金合同及中国证监会的其他规定。

基金管理人应当在基金合同生效后 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。若基金超过上述 1) -8) 项投资比例限制, 应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

若因将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更, 致使本基金投资限制中前述 1)至 8)项中的任何限制规定被修改或取消的, 基金管理人在履行适当程序后, 本基金可相应调整投资限制规定。

## (2) 禁止行为

除中国证监会另有规定外, 基金不得有下列行为:

- 1) 购买不动产。
- 2) 购买房地产抵押按揭。
- 3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证。
- 4) 购买实物商品。
- 5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外, 借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金、集合计划资产净值的 10%。
- 6) 利用融资购买证券, 但投资金融衍生品除外。
- 7) 参与未持有基础资产的卖空交易。
- 8) 从事证券承销业务。
- 9) 不公平对待不同客户或不同投资组合。
- 10) 除法律法规规定以外, 向任何第三方泄露客户资料。
- 11) 中国证监会禁止的其他行为。

## (六) 基金财产的估值

### 1. 估值对象

基金所拥有的股票、基金、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### 2. 估值时间

本基金合同生效后, 每个开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放

日对基金资产进行估值，T+1 日完成 T 日估值。

### 3. 估值方法

#### (1) 股票估值方法

1) 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

A. 送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

B. 首次发行且未上市的股票，按成本价估值；首次发行且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估值。

#### (2) 基金估值方法

1) 上市流通的基金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) 其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

若基金价格无法通过公开信息取得的，由基金管理人负责从其经纪商处取得，并及时通过书面形式告知基金托管人。

#### (3) 债券估值方法

1) 对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券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。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得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

2) 对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。若债券价格无法通过公开信息取得的，由基金管理人负责从其经纪商处取得，并及时通过书面形式告知基金托管人。

#### (4) 存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其所在证券交易所的最近交易日的收盘价估值。

#### (5) 汇率

本基金外币资产价值计算中，所涉及人民币对美元、港元、欧元、英镑和日元的汇率应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率为准。涉及其他货币对人民币

的汇率,采用彭博金融终端提供的估值日各种货币对美元折算率并采用套算的方法进行折算。

#### (6) 税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金,本基金将按权责发生制原则进行估值;对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的,基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收,基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金管理人或其聘请的税务顾问对最终税务的处理的真实准确负责。

(7)在任何情况下,基金管理人如采用本款第1—8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—8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;

(8)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

### 4.基金份额净值错误的处理方式

#### (1) 差错类型

基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担相关责任。

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无法预见、无法避免、无法抗拒,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人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

因基金估值错误给基金投资人造成的损失应由基金托管人和基金管理人协商共同承担,基金托管人和基金管理人对不应由其承担的责任,有权根据过错原则,向过错人追偿,基金合同的当事人应将按照以下约定处理。

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,

给当事人造成的损失由差错责任方承担；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，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

2) 差错的责任方对可能导致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，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) 基金份额净值计算差错小于基金份额净值 0.5%时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理。

5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

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过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；其中基金份额净值计算差错小于基金份额净值 0.5%时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；基金份额净值计算差错达到或超过基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；

4) 根据差错处理的方法, 需要修改基金登记结算机构的交易数据的, 由基金登记结算机构进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认。

#### (4) 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开放日估值时间点计算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。

#### (5) 特殊情况的处理

1) 基金管理人或基金托管人按上述估值方法进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2) 对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的, 相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

3) 全球投资涉及不同市场及时区, 由于时差、通讯或其他非可控的客观原因, 在本基金管理人和本基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易, 导致的对基金资产净值的影响, 不作为基金资产估值错误处理。

4) 由于不可抗力原因, 或由于各家数据服务机构发送的数据错误, 本基金管理人和本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, 本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任。但基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### 5. 暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资涉及的主要证券市场遇法定节假日或因其他原因停市时;

(2) 因不可抗力或其它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人的利益, 决定延迟估值;

(4) 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无法评估基金资产的;

(5) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (七) 基金资产净值、基金份额净值公告

1. 本基金的基金合同生效后, 在开始办理基金份额申购或者赎回前, 基金管理人将至少



每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2.在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人将在每个开放日后的 2 个工作日内，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；

3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个工作日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述工作日后的 2 个工作日内，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。

#### (八) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

##### 1.基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

1)终止基金合同；

2)转换基金运作方式；

3)变更基金类别；

4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

5)变更基金份额持有人大会程序；

6)更换基金管理人、基金托管人；

7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据基金合同及适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

8)本基金与其他基金的合并；

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、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

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重大变化；

5)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。

(2)关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## 2. 本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

(1)基金份额持有人大会决定终止的;

(2)基金管理人职责终止,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)基金托管人职责终止,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;

(4)中国证监会规定的其他情况。

## 3.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,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。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。

### (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)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;

2)基金合同终止时,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)对基金财产进行估价和变现;

5)聘请律师事务所出具法律意见书;

6)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;

7)将基金财产清算结果报告中国证监会;

8)参加与基金财产有关的民事诉讼；

9)公布基金财产清算结果；

10)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) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果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。

## (九) 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。

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

## (十) 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。

1. 本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或其授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，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备案并公告之日止。

2. 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。

3. 本基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，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。

4. 本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和登记结算机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。