

# 华安沪深300指数分级证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

注册登记机构：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

上市日期：2012年7月23日

公告日期：2012年7月18日

## 目 录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	1
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.....	5
五、基金主要当事人简介.....	7
六、基金合同摘要.....	11
七、基金财务状况.....	11
八、基金投资组合.....	13
九、重大事件揭示.....	17
十、基金管理人承诺.....	17
十一、基金托管人承诺.....	18
十二、基金上市推荐人意见.....	18
十三、备查文件目录.....	18
附件：基金合同摘要.....	19

## 一、重要声明与提示

华安沪深300指数分级证券投资基金（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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）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，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报告书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。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2012年5月29日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及华安基金管理有限公司网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）上的《华安沪深300指数分级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、基金名称：华安沪深300指数分级证券投资基金。

2、基金类型：股票型。

3、本基金的基金份额包括华安沪深300指数分级证券投资基金之基础份额（场内简称“华安300”，基金代码“160417”）、华安沪深300指数分级证券投资基金之A类份额（场内简称“华安300 A”，基金代码“150104”）与华安沪深300指数分级证券投资基金之B类份额（场内简称“华安300 B”，基金代码“150105”）。其中，华安300A份额和华安300B份额的基金份额配比始终保持1：1的比例不变。

4、本基金的存续期限为不定期。

5、华安300的申购和赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对华安300份额进行申购与赎回；华安300A、华安300B只上市交易，不接受申购和赎回。

6、份额配对转换：份额配对转换是指华安 300 场内份额与华安 300A 份额、华安 300B 份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

(1) 分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份华安 300 场内份额申请转换成 1 份华安 300A 份额与 1 份华安 300B 份额的行为。

(2) 合并

合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份华安 300A 份额与 1 份华安 300B 份额申请转换成 2 份华安 300 场内份额的行为。

7、定期份额折算

每个会计年度的第一个工作日（除基金合同生效日所在会计年度外）为定期份额折算基准日，本基金将对华安 300A 份额和华安 300 份额进行上一会计年度约定应得收益的定期份额折算。华安 300A 份额每个期末的约定应得收益，即华安 300A 份额每个会计年度最后一日份额参考净值超出 1.000 元部分，将被折算为场内华安 300 份额分配给华安 300A 份额持有人。华安 300 份额持有人持有的每 2 份华安 300 份额将获得按照 1 份华安 300A 份额分配的新增华安 300 份额。持有场外华安 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外华安 300 份额；持有场内华安 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内华安 300 份额。经过上述份额折算，华安 300A 份额的参考净值和华安 300 份额的基金份额净值将相应调整。有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

8、不定期份额折算

当华安 300 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安 300A 份额、华安 300B 份额和华安 300 份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保华安 300A 份额和华安 300B 份额的比例为 1: 1，份额折算后华安 300A 份额、华安 300B 份额和华安 300 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

当华安 300B 份额的参考净值小于或等于 0.300 元后，本基金在根据市场情况确定份额折算基准日后将分别对华安 300A 份额、华安 300B 份额和华安 300 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保华安 300A 份额和华安 300B 份额

的比例为 1: 1, 份额折算后华安 300 份额的基金份额净值以及华安 300A 份额和华安 300B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。

有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

9、华安 300A 与华安 300B 的终止运作: 经基金份额持有人大会决议通过, 华安 300A 与华安 300B 可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过, 即须经参加基金份额持有人大会的华安 300、华安 300A 与华安 300B 各自的基金份额持有人或其代理人所持华安 300、华安 300A 与华安 300B 各自表决权的 2/3 以上 (含 2/3) 通过方为有效。

10、基金份额总额: 截至2012年7月16日, 本基金的基金份额总额为 607,313,857.99份, 其中, 华安300为212,734,025.99份, 华安300A为197,289,916.00份, 华安300B为197,289,916.00份。

11、基金份额净值: 截至2012年7月16日, 华安300的基金份额净值为0.999元, 华安300A的基金份额净值为1.004元, 华安300B的基金份额净值为0.994元。

12、本次上市交易的两类基金份额总额: 华安300A份额197,289,916.00份, 华安300B份额197,289,916.00份

13、上市交易的证券交易所: 深圳证券交易所

14、上市交易日期: 2012年7月23日

15、基金管理人: 华安基金管理有限公司

16、基金托管人: 中国建设银行股份有限公司

17、本次上市交易的基金份额注册登记机构: 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: 中国证监会证监许可[2012]278号文

2、基金运作方式: 契约型开放式

3、基金合同期限: 不定期

4、发售日期: 2012年6月1日至2012年6月18日

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

7、发售机构（排名不分先后）

（1）场外销售机构

直销机构：华安基金管理有限公司

代销银行：中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海银行股份有限公司

代销券商：中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、中航证券有限公司、国盛证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、中山证券有限责任公司。

（2）场内销售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。具体名单可在深圳证券交易所网站查询，本基金管理人就不就此事项进行公告。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的有效认购总户数为2,932户，净认购金额（不含认购费）为607,221,793.60 元人民币，有效认购款项在基金合同生效前产生的利息为92,064.39 人民币，共计607,313,857.99 元。本次募集所有资金已于 2012年6月25日全额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账户。

10、基金合同生效日：2012年6月25日

11、基金合同生效日的基金份额总额：607,313,857.99份

（二）本基金的日常申购、赎回情况

本基金管理人将于2012年7月23日起开始办理本基金的申购和赎回业务，具体业务办理时间等情况在开放申购和赎回业务公告中规定。

### （三）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]235号。

2、上市交易日期：2012年7月23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、本次上市交易的基金份额场内简称：华安300A、华安300B。

5、本次上市交易的基金份额交易代码：华安300A为150104；华安300B为150105。

6、本次上市交易的基金份额总额：华安300A为197,289,916.00份；华安300B为197,289,916.00份。

7、基金资产净值的披露：基金管理人每个开放日（T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。基金管理人在T日内将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，由深交所于T+1日通过行情系统揭示T日基金份额净值。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人的开放式基金账户下，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内（即中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统）后，根据基金合同配对转换的规定申请将份额分拆成华安300A和华安300B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）场内基金份额持有情况（截至2012年7月16日）

本基金持有人户数为2,932户，平均每户持有的基金份额为207,132.97份；华安300A份额为2,237户，平均每户持有的基金份额为88,154.56份；华安300B份额

为2,237户，平均每户持有的基金份额为88,154.56份。

(二) 场内基金份额持有人结构 (截至2012年7月16日)

1、场内机构投资者持有的本次上市交易的华安300A份额60,063,101.00份，占比30.4441%；场内个人投资者持有的本次上市交易的华安300A份额137,226,815.00份，占比69.5559%；

2、场内机构投资者持有的本次上市交易的华安300B份额60,063,098.00份，占比30.4441%；场内个人投资者持有的本次上市交易的华安300B份额137,226,818.00份，占比69.5559%；

(三) 场内华安300A份额前十名持有人情况 (截至2012年7月16日)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占场内份额比例
1	中钢投资有限公司	19,994,833.00	10.13%
2	徐铭	10,001,222.00	5.07%
3	中信证券股份有限公司	5,000,389.00	2.53%
4	民生证券有限责任公司	5,000,388.00	2.53%
5	美高仕科技发展有限公司	5,000,333.00	2.53%
6	红塔证券股份有限公司	5,000,333.00	2.53%
7	中国银河证券股份有限公司	5,000,333.00	2.53%
8	刘端美	4,000,267.00	2.03%
9	中融国际信托有限公司 - 中融安苏 1 号证券投资	3,250,361.00	1.65%
10	汪和君	2,500,277.00	1.27%

(四) 场内华安300B份额前十名持有人情况 (截至2012年7月16日)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占场内份额比例
1	中钢投资有限公司	19,994,832.00	10.13%
2	徐铭	10,000,222.00	5.07%
3	民生证券有限责任公司	5,000,389.00	2.53%
4	中信证券股份有限公司	5,000,388.00	2.53%
5	美高仕科技发展有限公司	5,000,333.00	2.53%
6	红塔证券股份有限公司	5,000,333.00	2.53%

7	中国银河证券股份有限公司	5,000,333.00	2.53%
8	刘端美	4,000,266.00	2.03%
9	中融国际信托有限公司 - 中融安苏 1 号证券投资	3,250,361.00	1.65%
10	汪和君	2,500,278.00	1.27%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任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、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、法定代表人：李勍
- 3、总经理：李勍
- 4、注册资本：1.5亿元人民币
- 5、住所：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层
- 6、办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层
- 7、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【1998】20号
- 8、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000062071
- 9、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

### 10、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
上海电气（集团）总公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

### 11、内部组织结构及职能

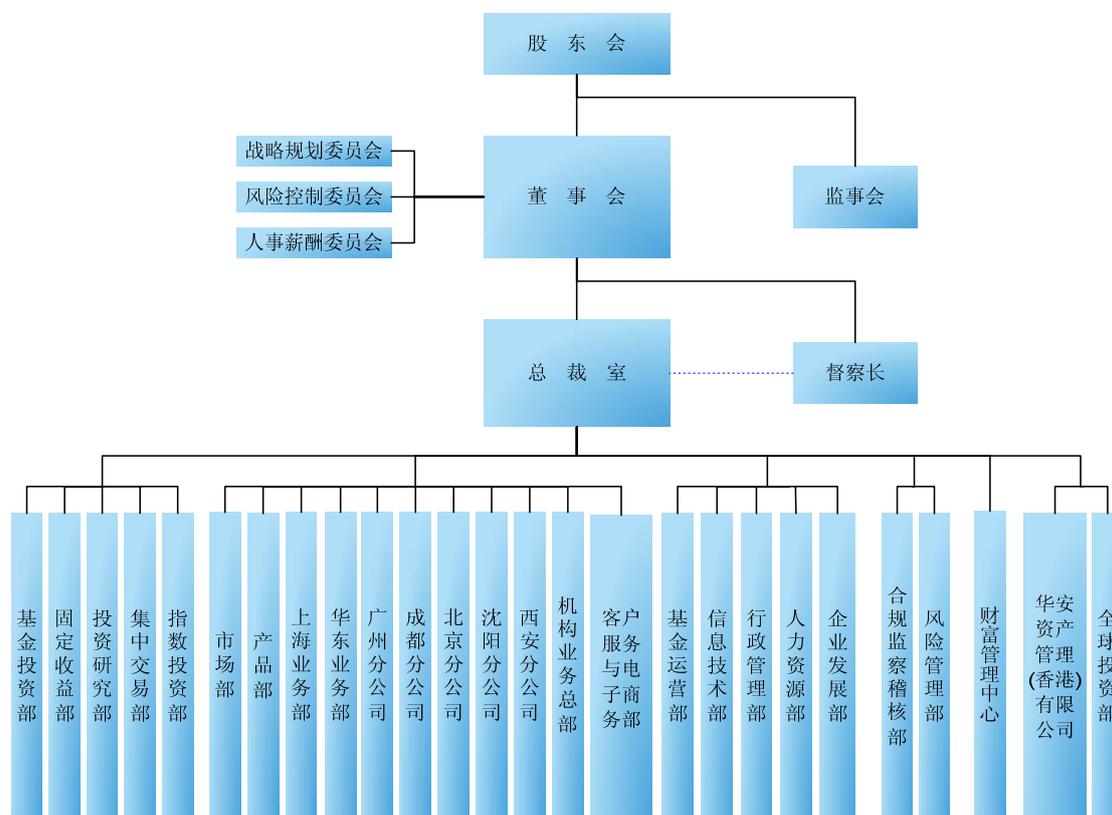
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。

董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由九名董事组成，其中五家股东单位分别推荐一名董事，公司管理层推荐一名，另三名为独立董事。独立董事人数占董事会总人数的1/3，超过单一股东派出的董事人数。董事会下设风险控制、战略规划和人事薪酬等三个专业委员会。

监事会由八名监事组成，其中三名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

公司组织架构以公司发展战略为导向而建立，主要采用管理扁平、分工明确的职能制结构，新增业务部分（如财富管理中心）采用灵活高效的事业部制，设有投资研究、市场营销、运营及后台、风险控制等四大板块共25个部门以及1个香港全资子公司。公司组织架构如下图所示：



## 12、人员情况:

截至 2012 年 3 月 31 日, 公司目前共有员工 297 人, 主要来自国内外证券公司等金融机构, 其中 80.1% 以上具有三年证券业或五年金融业从业经历, 具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

## 13、信息披露负责人: 冯颖

电话: (021) 38969720

## 14、基金管理业务情况简介:

截至2012年3月31日, 华安基金管理有限公司旗下共管理2只封闭式基金和25只开放式基金, 资产规模达744.89亿元人民币。旗下管理的基金包括: 华安安信封闭、华安安顺封闭、华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安上证180ETF、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安上证180ETF联接、华安动态灵活配置混合、华安行业轮动股票、华安香港精选股票(QDII)、华安上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安稳固收益债券、华安升级主题股票、华安大中华升级股票(QDII)、华安可转债债券、华安深证300指数LOF、华安信用四季红债券、华安科技动力股票、华安标普全球石油指数(QDII-LOF)。

## 15、本基金基金经理

牛勇先生, 复旦大学经济学硕士, FRM(金融风险管理师), 7年证券、金融从业经历, 曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师。2009年7月3日至2010年9月2日担任华安中国A股增强指数证券投资基金的基金经理助理; 2010年6月18日起至今担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理; 2010年9月2日起至今担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理; 2010年11月18日起至今担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金; 2010年11月18日起至今担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

张昊先生, 密歇根大学金融工程硕士, 4年证券、基金行业从业经历。曾在

美国 Triagelet Delta Funds 担任量化分析师、风险对冲管理师等职。2009 年 6 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师。

## （二）基金托管人

1、名称：中国建设银行股份有限公司

2、法定代表人：王洪章

3、注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

4、住所：北京市西城区金融大街25号

5、专门基金托管部门负责人及人员情况：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，并已经成为常态化的内控工作手段。

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。

6、信息披露负责人：尹东

电话：（010）67595003

7、托管业务情况简介：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）基金验资机构

- 1、名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
- 2、住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
- 3、办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
- 4、法定代表人：杨绍信
- 5、电话：（021）23238888
- 6、传真：（021）23238800
- 7、联系人：金毅
- 8、经办注册会计师：汪棣、金毅

## 六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

## 七、基金财务状况

深圳证券交易所华安沪深300指数分级证券投资基金认购期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。

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。

华安沪深300指数分级证券投资基金截至2012年7月16日资产负债表如下:

单位：人民币元

项目	
资 产：	

银行存款	32,312,705.27
结算备付金	2,927,721.79
存出保证金	878.15
交易性金融资产	91,530,137.75
其中：股票投资	91,530,137.75
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	480,000,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	260,978.14
应收股利	53,092.52
应收申购款	-
其他资产	-
资产合计：	607,085,513.62
负债和所有者权益	
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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	265,784.38
应付托管费	58,472.57
应付销售服务费	-
应付交易费用	80,575.29
应付税费	-

应付利息	
应付利润	
其他负债	38,238.25
负债合计	443,070.49
所有者权益:	
实收基金	607,313,857.99
未分配利润	-671,414.86
所有者权益合计	606,642,443.13
负债与所有者权益合计:	607,085,513.62

注：报告截止日2012年7月16日，华安300份额净值为0.999，份额数为212,734,025.99。华安300A份额净值为1.004，份额数为197,289,916.00。华安300B份额净值为0.994，份额数为197,289,916.00。

## 八、基金投资组合

截至2012年7月16日，本基金的投资组合情况如下：

### (一) 期末（2012年7月16日）基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	91,530,137.75	15.08
	其中：股票	91,530,137.75	15.08
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	480,000,000.00	79.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	35,240,427.06	5.80
6	其他各项资产	314,948.81	0.05

7	合计	607,085,513.62	100.00
---	----	----------------	--------

(二) 期末 (2012年7月16日) 指数投资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	614,036.00	0.10
B	采掘业	9,550,032.79	1.57
C	制造业	34,065,479.55	5.62
C0	食品、饮料	7,513,403.15	1.24
C1	纺织、服装、皮毛	352,816.00	0.06
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,002,231.00	0.33
C5	电子	1,330,161.00	0.22
C6	金属、非金属	6,766,381.54	1.12
C7	机械、设备、仪表	11,545,781.98	1.90
C8	医药、生物制品	4,551,274.88	0.75
C99	其他制造业	3,430.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,385,370.98	0.39
E	建筑业	3,135,416.00	0.52
F	交通运输、仓储业	2,778,752.00	0.46
G	信息技术业	2,329,067.00	0.38
H	批发和零售贸易	2,339,567.17	0.39

I	金融、保险业	26,599,196.84	4.38
J	房地产业	5,209,330.92	0.86
K	社会服务业	874,520.00	0.14
L	传播与文化产业	328,983.50	0.05
M	综合类	1,320,385.00	0.22
	合计	91,530,137.75	15.09

注：由于四舍五入原因，公允价值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有尾差。

（三）期末（2012年7月16日）积极投资按行业分类的股票投资组合  
本基金本期末未持有积极投资部分股票。

（四）期末（2012年7月16日）指数投资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	601318	中国平安	64,012	2,789,002.84	0.46
2	600104	上汽集团	227,940	2,780,868.00	0.46
3	600016	民生银行	447,200	2,656,368.00	0.44
4	600036	招商银行	244,800	2,467,584.00	0.41
5	600519	贵州茅台	7,520	1,972,120.00	0.33
6	601328	交通银行	453,600	1,964,088.00	0.32
7	601166	兴业银行	149,600	1,834,096.00	0.30
8	600030	中信证券	136,000	1,698,640.00	0.28
9	600000	浦发银行	221,600	1,690,808.00	0.28
10	000002	万科A	168,000	1,634,640.00	0.27

(五) 期末(2012年7月16日)积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票明细

本基金本期末未持有积极投资股票。

(六) 期末(2012年7月16日)按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(七) 期末(2012年7月16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

本基金本报告期末未持有债券。

(八) 期末(2012年7月16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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(九) 期末(2012年7月16日)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(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(元)
1	存出保证金	878.15
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	53,092.52
4	应收利息	260,978.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	314,948.81

#### 4 期末（2012年7月16日）持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没有处于转股期的可转换债券。

#### 5 期末（2012年7月16日）前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 九、重大事件揭示

华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同已于 2012年6月25日正式生效，基金管理人已于2012年6月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登华安沪深300指数分级证券投资基金基金合同生效公告。

## 十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（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

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

- (一) 中国证监会核准华安沪深 300 指数分级证券投资基金募集的文件
- (二) 《华安沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《华安沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 《华安沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书

(六) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(八) 中国证监会要求的其他文件

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。

## 附件：基金合同摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### 1. 基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海浦东新区世纪大道 8 号，上海国金中心二期 31、32 层

办公地址：上海浦东新区世纪大道 8 号，上海国金中心二期 31、32 层

邮政编码：200120

法定代表人：李勍

成立时间：1998 年 6 月 4 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1998】20 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元

存续期间：持续经营

#### 2. 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：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委员会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

### 3. 基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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。

投资人购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，投资人自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。

华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额、华安沪深 300 份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。

### 4. 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和交易所规则的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、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，拒绝或暂停受理华安沪深 300 份额的申购和赎回申请；

(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) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(10) 选择、更换代销机构，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；

(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) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 5. 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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(10) 按规定受理华安沪深 300 份额申购和赎回申请，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、半年度和年度基金报告；

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

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

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

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

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

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

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

(22) 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。

## 6. 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) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 7. 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，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

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

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
- (7) 保守基金商业秘密,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
- (8) 对基金财务会计报告、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;
- (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。

## 8. 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) 依法转让其持有的华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额，依法申请赎回其持有的华安沪深 300 份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 9. 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、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

10. 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。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1. 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。基金份额持有人大会的审议事项应分别由华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内具有同等的投票权。

## 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、基金托管人或者单独或合计持有华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自份额 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) 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、中国证监会和基金合同另有规定的除外)；
- 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) 终止华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的运作；
- 10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 11) 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华安沪深 300 份额的申购费率、收费方式或调低赎回费率；
- 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) 经中国证监会批准，基金推出新业务或服务；
- 5) 基金管理人、注册登记机构、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；
- 6) 标的指数更名或调整指数编制方法；
- 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) 单独或合计持有华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项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，单独或合计持有华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自份额 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) 单独或合计持有华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自份额 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，单独或合计持有华安沪深 300

份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自份额 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 日在指定媒体公告。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、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式。

2) 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。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定进行表决。

4) 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。

5) 会议的召开方式由召集人确定，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。

##### (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华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额应占权益登记日各自基金份额的 50%以上(含 50%，下同)；

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书代理手续完备，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：

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

②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书面意见的基金份额持有人所代表的华安沪深300份额、华安沪深300A份额与华安沪深300B份额占权益登记日各自基金份额的50%以上;

⑤直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人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,并与注册登记机构记录相符。

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。

## 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华安沪深300份额、华安沪深300A份额与华安沪深300B份额各自基金份额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。

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作出决定。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作出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)单独或合并持有权益登记日华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自基金份额 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,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;如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自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在其对应的份额级别内享有平等的表决权。

(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华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额表决权的 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华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的基金份额持有人(或其代理人)各自所持华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额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、终止华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的运作、终止基金合同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。

### (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 2 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生效后方可执行, 关于本章第 2 条所规定的第 9)-11) 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、基金收益分配原则、执行方式

#### 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

在存续期内,本基金(包括华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额)不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过,并经中国证监会核准后,如果终止华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额的运作,本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 1. 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) 基金财产拨划支付的银行费用;
- (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和律师费;
- (7) 基金的证券交易费用;
- (8) 基金的开户费用、账户维护费用;

(9) 基金上市费用；

(10) 基金合同生效以后的标的指数使用许可费；

(11) 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，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

(12) 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% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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，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 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，支付日期顺延。

(3) 基金的标的指数使用许可费

根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的指数的使用许可费率年费率为 0.02%。通常情况下，标的指数使用许可费按前一日

基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的标的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，标的指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元（基金合同生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。标的指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行。

(4) 除管理费、托管费和标的指数使用许可费之外的基金费用，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。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### 1. 投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

## 2. 投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、债券回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%;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;投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

如法律法规或监管机构在基金合同生效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. 投资策略

本基金为被动式股票指数基金,采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差,追求尽可能贴近标的指数的表现。

为有效控制指数的跟踪误差,本基金在注重风险管理的前提下,将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点,通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化,并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时,可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距;在本基金发生大额净赎回时,可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本,从而确保

投资组合对指数跟踪的效果。

正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不得超过 4%。

#### 4. 投资限制与禁止行为

##### (1) 组合限制

1) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，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%；

2) 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%；

3) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的 85%；

4) 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 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；

5) 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%；

6) 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的 10%；

7) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约价值不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

8) 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；

9) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

10) 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。

11)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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，基金管理人在履行相关程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。

## (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) 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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- 9) 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。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

本基金作为分级基金，按照华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的净值计算规则依据以下公式分别计算并公告 T 日华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的基金份额净值：

1. 华安沪深 300 份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

$T$  日华安沪深 300 份额的基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日本基金基金份额的总数

本基金作为分级基金， $T$  日本基金基金份额的总数为华安沪深 300A 份额、华安沪深 300B 份额和华安沪深 300 份额的份额数之和。

2. 华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的基金份额净值计算

设  $T$  日为基金份额净值计算日， $T=1, 2, 3, \dots, N$ ； $N$  为当年实际天数； $t=\min\{\text{自年初至 } T \text{ 日的天数, 自基金合同生效日至 } T \text{ 日的天数, 自会计年度内最近一次不定期份额折算日至 } T \text{ 日的天数}\}$ ； $NAV_{300}$  为  $T$  日每份华安沪深 300 份额的基金份额净值； $NAV_{300A}$  为  $T$  日华安沪深 300A 份额的参考净值； $NAV_{300B}$  为  $T$  日华安沪深 300B 份额的参考净值； $R$  为华安沪深 300A 份额的约定年基准收益率，则：

$$NAV_{300A} = 1 + R \times \frac{t}{N}$$

$$NAV_{300B} = 2 \times NAV_{300} - NAV_{300A}$$

华安沪深 300 份额的基金份额净值以及华安沪深 300A 份额和华安沪深 300B 份额的参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

$T$  日的基金份额净值在当天收市后计算，并在  $T+1$  日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

3. 本基金的基金合同生效后，在开始办理华安沪深 300 份额申购或者赎回或华安沪深 300A 份额及华安沪深 300B 份额上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额及华安沪深 300B 份额各自的基金份额净值；

4. 在开始办理华安沪深 300 份额申购或者赎回或华安沪深 300A 份额及华安沪深 300B 份额上市交易后，基金管理人将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，披露开放日华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额及华安沪深 300B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值；

5. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日(或自然日)基金资产净值和华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额及华安沪深 300B 份额各自的基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日(或自然日)的次日，将基金资产净值以及华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额及华安沪深 300B 份额各自的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 1. 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) 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；
- (4) 中国证监会规定的其他情况。

### 2. 基金财产的清算

#### (1) 基金财产清算组

1) 自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内，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。

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) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 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) 根据基金合同终止日华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自的基金份额净值分别计算华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在华安沪深 300 份额、华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额各自类别内按其基金份额持有人持有的该类别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。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的华安沪深 300A 份额与华安沪深 300B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### (5) 基金财产清算的公告

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。

## 八、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。

## 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。