

国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金
之估值优先和估值进取基金份额上市交易公告书

基金管理人： 国泰基金管理有限公司

基金托管人： 中国工商银行股份有限公司

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

上市时间： 2010年3月11日

公告日期： 2010年3月8日

目 录

一、重要声明与提示.....	2
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.....	5
五、基金主要当事人简介.....	7
六、基金合同摘要.....	10
七、基金财务状况.....	10
八、基金投资组合.....	12
九、重大事件揭示.....	14
十、基金管理人承诺.....	15
十一、基金托管人承诺.....	15
十二、备查文件目录.....	15
附件：基金合同内容摘要.....	16

一、重要声明与提示

国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金之估值优先与估值进取基金份额上市交易公告书（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，国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人国泰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。本基金托管人中国工商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2010年1月14日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及国泰基金管理有限公司网站（www.gtfund.com）上的《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：封闭期内，基金名称为“国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金”；封闭期届满后，基金名称为“国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）”。

2、基金类别：股票型证券投资基金。

3、基金运作方式：契约型基金。本基金《基金合同》生效后，在封闭期内不开放申购、赎回业务。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

4、基金封闭期限：本基金《基金合同》生效后3年。

5、基金份额分离：本基金通过基金资产及收益的不同分配安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个类别，即优先类基金份额（估值优先）和进取类基金份额（估值进取），两类基金份额的基金资产合并运作。

6、基金份额的上市与交易：本基金《基金合同》生效后，在三年封闭期内，由初始基金份额所分离的两类份额，估值优先与估值进取将同时申请在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）上市与交易。在封闭期结束后，估值优先与估值进取将分别以各自份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为同一上市开放式基金（LOF），并继续在深圳证券交易所上市与交易。

7、基金份额总额：本基金总份额843,104,538.41份，按照基金合同约定的1:1比例分离后，其中，估值优先基金份额421,553,139.14份，估值进取基金份额421,551,399.27份。

8、估值优先基金份额参考净值：1.004元（截至2010年3月4日）

9、估值进取基金份额参考净值：0.994元（截至2010年3月4日）

10、本次上市交易的两类基金份额简称及代码：

简称：估值优先 代码：150010

简称：估值进取 代码：150011

11、本次上市交易的两类基金份额总额：估值优先份额249,926,180份，估值进取份额249,924,466份（截至2010年3月4日）

12、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

13、上市交易日期：2010年3月11日

14、基金管理人：国泰基金管理有限公司

15、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1、本基金发售申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可[2009]1295号

2、基金合同生效日：2010年2月10日

3、基金运作方式：契约型

4、基金合同期限：不定期

5、发售日期：2010年1月18日至2010年2月3日

6、发售面值：1.00元人民币

7、发售方式：场内、场外认购

8、发售机构：

(1) 场内发售机构

已经具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

(2) 场外发售机构

1) 直销机构：国泰基金管理有限公司。

2) 代销银行：中国工商银行、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、浦发银行、北京银行、民生银行。

3) 代销券商：中投证券、国泰君安证券、宏源证券、万联证券、中信建投证券、海通证券、银河证券、中信证券、中信金通证券、申银万国、招商证券、东方证券、东吴证券、广发证券、国信证券、兴业证券、上海证券、民生证券、国盛证券、光大证券、渤海证券、华泰证券、长江证券、中信万通证券、华泰联合证券、齐鲁证券、安信证券、东莞证券、恒泰证券、中原证券、华宝证券、厦门证券、中金公司、英大证券、广发华福证券、天相投顾、信达证券、民族证券、华龙证券等。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

10、认购资金总额及入账情况：

本次募集的净认购金额为842,970,017.67元人民币，认购资金在募集期间产生的银行利息共计134,520.74元人民币，已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。

本次募集有效认购总户数为8,534户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，募集期募集资金及其利息结转的基金份额共计843,104,538.41份。其中，国泰基金管理有限公司运用自有资金于2010年2月2日通过代销渠道认购的基金份额为20,001,800.00份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额比例为2.372%；国泰基金管理有限公司的基金从业人员认购本基金的基金份额为197,761.46份（含募集期利息结转的份额），占基金总份额比例为0.023%。

本基金募集结束后，按照基金合同约定的基金份额分离规则自动按1:1分离为估值优先和估值进取份额，其中，估值优先的基金份额为421,553,139.14份，估值进取的基金份额421,551,399.27份。

募集资金已于2010年2月9日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有

限公司开立的基金托管专户。

11、基金备案情况

本基金于2010年2月9日验资完毕，2010年2月10日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2010年2月10日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2010年2月10日。

13、基金合同生效日的基金份额总额：843,104,538.41份，其中，估值优先的基金份额为421,553,139.14份，估值进取的基金份额421,551,399.27份。

（二）本基金之估值优先与估值进取基金份额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[2010]77号

2、上市交易日期：2010年3月11日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、本次上市的基金份额简称：估值优先、估值进取

5、本次上市的基金份额交易代码：估值优先的交易代码150010、估值进取的交易代码150011

6、本次上市交易份额：估值优先的份额为249,926,180份，估值进取的份额为249,924,466份(数据截至2010年3月4日)

7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布本基金的基金份额净值和两类基金份额估值优先和估值进取的份额参考净值，并在深交所行情发布系统揭示估值优先和估值进取的份额参考净值。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其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2010年3月4日，估值优先场内基金份额持有人户数为4331户，平均每户持有的估值优先场内基金份额57,706.34份。估值进取场内基金份额持有人户数为4331户，平均每户持有的估值进取场内基金份额57,705.95份。

(二) 持有人结构

截至2010年3月4日，场内基金份额持有人结构如下：

场内机构投资者持有的场内估值优先基金份额114,907,271份，占比45.9765%；场内个人投资者持有的场内估值优先基金份额135,018,909份，占比54.0235%。

场内机构投资者持有的场内估值进取基金份额114,907,249份，占比45.9768%；场内个人投资者持有的场内估值进取基金份额135,017,217份，占比54.0232%。

(三) 截至2010年3月4日，场内估值优先基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例 (%)
1	光大证券-光大-光大阳光基中宝（阳光2号二期）集合资产管	15,002,850	6.00
2	国元证券股份有限公司	15,000,849	6.00
3	招商证券股份有限公司	12,500,625	5.00
4	海通证券股份有限公司	10,000,500	4.00
5	中信建投证券有限责任公司	10,000,500	4.00
6	安信证券股份有限公司	10,000,500	4.00
7	孙举德	7,500,575	3.00
8	国信-华夏-“金理财”4号基合资产管理计划	7,500,450	3.00
9	国泰君安证券股份有限公司	7,500,375	3.00
10	谢燕波	5,000,300	2.00

(四) 截至2010年3月4日，场内估值进取基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例 (%)
1	光大证券-光大-光大阳光基中宝（阳光2号二期）集合资产管	15,002,850	6.00
2	国元证券股份有限公司	15,000,848	6.00
3	招商证券股份有限公司	12,500,625	5.00
4	海通证券股份有限公司	10,000,500	4.00
5	中信建投证券有限责任公司	10,000,500	4.00

6	安信证券股份有限公司	10,000,500	4.00
7	孙举德	7,500,574	3.00
8	国信-华夏-“金理财”4号基合资产管理计划	7,500,450	3.00
9	国泰君安证券股份有限公司	7,500,375	3.00
10	谢燕波	5,000,300	2.00

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

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本情况

名称：国泰基金管理有限公司

设立日期：1998年3月5日

住所：上海市浦东新区峨山路91弄98号201A

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心39楼

法定代表人：陈勇胜

总经理：金旭

注册资本：壹亿壹千万元人民币

设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]5号

工商登记注册的法人营业执照文号：310000000060090

经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务

2、股东及出资比例

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	70%
万联证券有限责任公司	20%
中国电力财务有限公司	10%

3、内部组织结构及职能

公司目前下设20个部门和2个分公司，其主要职能如下：

基金管理部：负责权益类公募基金的投资管理工作；

固定收益部：负责固定收益类公募基金的投资和研究工作；

研究开发部：负责公司的投资策略、宏观经济的研究及上市公司的研究和调研等工作；

金融工程部：负责量化投资的研究、基金的风险与绩效分析、提供数量化技术支持等工作；

交易管理部：负责公司所有产品的交易执行、管理和风险控制等相关工作；

财富管理中心：负责企业年金、专户理财和投资咨询业务的市场拓展、投资管理、产品设计、客户服务等相关工作；

销售部：负责基金代销机构的业务协调、基金产品的直销和代销业务等工作；

产品规划部：负责产品的基础研究及产品开发、设计、报批等工作；

国际业务部：负责国际业务的发展规划、市场拓展和管理等工作；

营销策划部：负责公司市场营销及品牌推广等工作；

客户服务部：负责公司的客户服务等工作；

稽核监察部：负责揭示、控制公司各项业务风险，对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务；

运营管理部：负责公司基金和账户的估值核算、资金清算、注册登记、账户管理等工作；

信息技术部：负责公司信息系统的建设和维护等工作；

财务管理部：负责公司财务预决算及成本管理和财务分析等工作；

人力资源部：负责公司人力资源开发与管理工作；

财富大学：负责公司的各类培训工作；

总经理办公室：负责公司战略管理、办公管理及公司品牌建设等工作；

董事会办公室：负责董事会相关工作；

行政管理部：负责公司行政管理及后勤保障等工作；

北京分公司：负责与主管机关及相关单位的联络沟通以及其它行政工作；

深圳分公司：负责所辖区域内基金销售工作。

4、人员情况

截至2009年12月31日，本基金管理人共有员工179人，其中93人具有硕士学历，13人具有博士学历。

5、信息披露负责人：李峰

咨询电话：400-888-8688

6、基金管理业务情况

截至2009年12月31日，国泰基金管理有限公司旗下共管理12只开放式基金、2只封闭式基金及多个社保投资组合、企业年金投资组合和特定客户资产管理计划。公募基金的资产管理规模为594.03亿元。

7、本基金基金经理

余荣权，男，硕士研究生，16年证券基金从业经验。1993年7月至2000年6月在深圳赛格集团财务公司投资部任经理；2000年6月至2002年11月在上海华宝信托投资公司投资管理部任总经理；2002年11月至2007年7月在华宝兴业基金管理有限公司任投资总监；2007年8月加盟国泰基金管理有限公司，2007年8月至2009年4月任公司投资总监，现拟任公司副总经理；2008年4月起任国泰金马稳健回报基金的基金经理。

程洲，硕士研究生，CFA，9年证券基金从业经验。2000年7月至2004年3月在上海申银万国证券研究所策略研究部任策略分析师；2004年4月加盟国泰基金管理有限公司，历任高级策略分析师、基金经理助理；2008年4月起任国泰金马稳健回报基金的基金经理，2009年12月起兼任金泰证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币334,018,850,026元

联系电话：010-66105799

联系人：蒋松云

2、主要人员情况

截至2009年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工117人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级

职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2009年6月，托管证券投资基金127只，其中封闭式8只，开放式119只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2009年初，中国工商银行先后被《环球金融》、《全球托管人》、《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》及《证券时报》评选为2008年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得18项国内外大奖。

（三）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：陈宇

经办注册会计师：薛竞、陈宇

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集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收取认购费。

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。

国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金2010年3月4日资产负债表如下：

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

资 产	本期末 2010 年 3 月 4 日
资 产：	
银行存款	500,224,043.01
结算备付金	2,772,859.20
存出保证金	-
交易性金融资产	213,840,661.93
其中：股票投资	213,840,661.93
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	200,000,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	543,675.77
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产合计：	917,381,239.91
负债和所有者权益	本期末 2010 年 3 月 4 日
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	75,088,288.53
应付赎回款	-
应付管理人报酬	139,097.32
应付托管费	23,182.88
应付销售服务费	-
应付交易费用	178,954.70
应付税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	26,892.29
负债合计	75,456,415.72
所有者权益：	
实收基金	843,104,538.41

未分配利润	-1,179,714.22
所有者权益合计	841,924,824.19
负债与持有人权益总计：	917,381,239.91

八、基金投资组合

截至2010年3月4日，国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	213,840,661.93	23.31
	其中：股票	213,840,661.93	23.31
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	200,000,000.00	21.80
	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	502,996,902.21	54.83
6	其他资产	543,675.77	0.06
7	合计	917,381,239.91	100.00

（二）期末按行业分类的股票投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A 农、林、牧、渔业	—	—
B 采掘业	—	—
C 制造业	166,905,008.94	19.83
C0 食品、饮料	24,305,667.72	2.89
C1 纺织、服装、皮毛	23,795,695.14	2.83
C2 木材、家具	—	—

C3 造纸、印刷	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	66,112,962.52	7.85
C5 电子	-	-
C6 金属、非金属	13,673,188.02	1.62
C7 机械、设备、仪表	19,678,648.34	2.34
C8 医药、生物制品	19,338,847.20	2.30
C99 其他制造业	-	-
D 电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储业	19,120,000.00	2.27
G 信息技术业	-	-
H 批发和零售贸易	4,152,250.54	0.49
I 金融、保险业	19,344,000.00	2.30
J 房地产业	4,319,402.45	0.51
K 社会服务业	-	-
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	-	-
合计	213,840,661.93	25.40

(三)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600600	青岛啤酒	711,316	24,305,667.72	2.89
2	000635	英力特	1,358,129	24,066,045.88	2.86
3	000726	鲁泰A	2,137,978	23,795,695.14	2.83
4	600352	浙江龙盛	1,800,000	21,834,000.00	2.59
5	600426	华鲁恒升	985,227	20,019,812.64	2.38
6	600036	招商银行	1,200,000	19,344,000.00	2.30
7	601006	大秦铁路	2,000,000	19,120,000.00	2.27
8	000423	东阿阿胶	655,585	18,356,380.00	2.18
9	600169	太原重工	929,946	13,660,906.74	1.62

10	000708	大冶特钢	660,234	8,351,960.10	0.99
----	--------	------	---------	--------------	------

(四) 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末，本基金未持有债券。

(五) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末，本基金未持有债券。

(六) 投资组合报告附注

(1) 本基金前10名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前1年内受到公开谴责、处罚的证券。

(2) 本基金前10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) 本基金2010年3月4日，其他资产构成如下：

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	543,675.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	543,675.77

(4) 截至公告前两个工作日即2010年3月4日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 截至公告前两个工作日即2010年3月4日，本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

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、深圳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《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》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《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》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《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》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

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

- （一）中国证监会核准基金募集的文件
- （二）《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金基金合同》
- （三）《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金招募说明书》
- （四）《国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金托管协议》
- （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

附件：基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一) 基金份额持有人的权利与义务

每份基金份额具有同等的合法权益，但在本基金转换为上市开放式基金（LOF）前，估值优先、估值进取基金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。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (3) 在其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《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集基金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 在符合有关法律规和《基金合同》的前提下，制订和调整《业务规则》，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- (13) 依照法律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；

(14) 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;

(15) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的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;

(17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

(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; 如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及有关法律法规规定, 应呈报中国证监会和其他监管部门, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(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、谨慎勤勉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) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产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) 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, 按有关规定计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告;

(11) 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;

(12) 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保密，不向他人泄露；

（13）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；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）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；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）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；

（19）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；

（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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

（23）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；

（24）基金管理人募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 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；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其它权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的

基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用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）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，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；

（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予以保密，不得向他人泄露；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）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；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）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；

（15）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；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）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；

（18）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监管机构，并通知基金管理人；

（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿

责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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拥有平等的投票权。

1、在封闭期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由估值优先、估值进取基金份额持有人独立进行表决。估值优先、估值进取基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

2、本基金封闭期届满，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人将按其所持上市开放式基金的每一基金份额享有相应的投票权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式，但本基金封闭期到期后转为上市开放式基金（LOF）除外；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%，下同）基金份额的基金份额持有人（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

书面要求召开基金份额持有人大会（在封闭期内，依据本基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额10%以上基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有估值优先和估值进取各自的基金总份额10%以上基金份额的基金份额持有人”）；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）法律法规、《基金合同》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。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，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；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率；

（4）经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

（5）基金管理人、基金注册登记机构、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）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（7）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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

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

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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，由基金托管人召集；

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，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额10%以上（含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，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（含10%）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%以上（含10%）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，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）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。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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前35天，在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）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；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和表决方式，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、表决意见提交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

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。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%（含50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在表决截止日前公布2次相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，

则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具意见的,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%(含50%);

(4) 上述第(3)项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符,并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定;

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额10%(含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交临时提案,临时提案应当在大会召开日至少30天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日30天前公告。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核,符合条件的应当在大会召开日30天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

（1）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。

（2）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。

单独或合并持有权益登记日基金总份额10%（含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。法律法规另有规定除外。

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，应当最迟在基金份额持有人大会召开前30日公告。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下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表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所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委

托人姓名（或单位名称）等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，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2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。但在封闭期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由估值优先、估值进取基金份额持有人独立进行表决，且估值优先、估值进取基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

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，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项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。但在封闭期内，一般决议须同时经参加大会的估值优先、估值进取各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会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。但在封闭期内，特别决议须同时经参加大会的估值优先、估值进取各自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。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

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，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

（七）计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举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) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，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、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，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的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一家指定报刊及基金管理人网站上公告。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。

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议。

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。

三、封闭期基金份额的分离与收益分配规则

（一）封闭期基金份额的分离规则

本基金在封闭期将基金份额持有人初始有效认购的基金总份额按照1:1的比例分离成预期收益与风险不同的两种份额类别，即优先类基金份额（基金份额简称“估值优先”）和进取类基金份额（基金份额简称“估值进取”）。

根据本基金初始基金总份额的比例分离规则，估值优先在基金份额持有人初始有效认购基金总份额中的份额占比为50%，估值进取在基金份额持有人初始有效认购基金总份额中的份额占比为50%，且两类基金份额的基金资产合并运作。

在本基金封闭期，估值优先与估值进取两类基金份额同时在深圳证券交易所分别上市和交易，交易代码不同。初始基金份额持有人或二级市场投资者可以在市场内单独交易估值优先或者估值进取份额。

（二）封闭期末估值优先和估值进取基金份额的收益分配规则

本基金份额所分离的两类基金份额估值优先和估值进取在封闭期末具有不同的资产及收益分配安排，即估值优先和估值进取基金份额的风险和收益特性不同。

在封闭期末，本基金净资产优先分配估值优先基金份额的本金及估值优先约定应得收益，即估值优先为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先分配估值优先基金份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产分配予估值进取基金份额，即估值进取为高风险且预期收益相对较高的基金份额。

估值优先约定应得收益和估值进取应得资产及收益的分配规则如下：

（1）估值优先基金份额约定年基准收益率为5.7%，其对应收益分配金额采用单利计算，年基准收益率及收益均以基金份额的认购面值为基准进行计算；

（2）在封闭期末，当本基金基金份额净值超过1.6元时，即基金份额总收益率超过60%，则再次将基金份额净值超出1.6元的超额收益部分的15%分配予估值优先基金份额；

(3) 在封闭期末，本基金净资产优先分配予估值优先基金份额的本金及估值优先约定应得收益后的剩余净资产分配予估值进取基金份额；

(4) 在封闭期末，如本基金净资产等于或低于估值优先份额的本金及估值优先约定应得收益的总额，则本基金净资产全部分配予估值优先份额后，仍存在额外未弥补的估值优先份额本金及估值优先约定应得收益总额的差额，则不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证封闭期满时估值优先持有人的约定应得收益，即如在封闭期末本基金资产出现极端损失情况下，估值优先仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

在封闭期内本基金不对估值优先和估值进取基金份额进行收益分配。对投资者认购或上市交易购买并持有到期的每一份估值优先和估值进取基金份额，在本基金封闭期届满后，按照《基金合同》所约定的资产收益分配规定分别计算估值优先和估值进取封闭期末净值，并以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额，以在基金转换运作方式的同时实现基金份额持有人的资产及收益分配。

（三）本基金基金份额净值的计算

本基金在封闭期内及封闭期届满转为上市开放式（LOF）基金后，均依据以下公式计算T日基金份额净值：

$$T\text{日基金份额净值} = T\text{日闭市后的基金资产净值} / T\text{日基金份额的余额数量}$$

封闭期内，T日基金份额的余额数量为估值优先和估值进取的份额总额；封闭期届满转为上市开放式（LOF）基金后，T日基金份额的余额数量为该LOF基金份额总额。基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。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。

（四）估值优先和估值进取在封闭期末的基金份额净值计算

按照上述本基金资产及收益分配规则，在封闭期末对估值优先与估值进取单独进行基金份额净值计算，并按各自的基金份额净值进行资产分配及份额转换。

假设NAV为本基金在封闭期截止当日T基金份额净值，NAV_a为封闭期截止当日

T估值优先基金份额净值，NAV_b为封闭期截止当日T估值进取基金份额净值。估值优先约定基准年收益率为Ra为单利5.7%。

封闭期截止当日T的估值优先与估值进取基金份额净值计算公式如下：

(1) 当NAV<0.586时，则估值优先与估值进取截至封闭期末当日T基金份额净值：

$$NAV_a = NAV / 0.5;$$

$$NAV_b = 0;$$

(2) 当0.586≤NAV≤1.600时，则估值优先与估值进取截至封闭期末当日T基金份额净值：

$$NAV_a = 1 + 3 \times Ra;$$

$$NAV_b = (NAV - 0.5 \times NAV_a) / 0.5;$$

(3) 当NAV>1.600时，则估值优先与估值进取截至封闭期末当日T基金份额净值：

$$NAV_a = 1 + 3 \times Ra + 15\% \times (NAV - 1.600) / 0.5;$$

$$NAV_b = (NAV - 0.5 \times NAV_a) / 0.5;$$

在封闭期末计算估值优先与估值进取份额净值时，各自保留小数点后8位，小数点后第9位四舍五入，由此产生的计算误差归入基金资产，并由基金管理人通知基金托管人对账务进行调整。

(五) 估值优先和估值进取基金份额参考净值的计算

基金管理人在基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算并公告估值优先和估值进取基金份额参考净值。封闭期间的基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

估值优先和估值进取基金份额参考净值在当天收市后计算，并在T+1日内与本基金基金份额净值一同公告。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。

设第T日为基金份额参考净值日，NAV为本基金封闭期内第T日基金份额净值；NAV_a为封闭期内第T日估值优先基金份额参考净值；NAV_b为封闭期内第T日估值进取基金份额参考净值；估值优先约定年收益率Ra约定为单利5.7%；基金封闭期内每年天数设定为Ty（y=1, 2, 3。T₁、T₂、T₃可能均为365，或其中之一为366，

而其余为365），则封闭期实际总天数为 $T_t = T_1 + T_2 + T_3$ 天（ T_t 的值等于365+365+365=1095或365+365+366=1096）。在封闭期内，基金管理人可根据基金运作的实际情况对用于估值优先和估值进取基金份额参考净值计算的实际运作天数进行调整，如调整，届时可参见更新的基金招募说明书及基金管理人公告。

封闭期内第 T 日，估值优先和估值进取基金份额参考净值的计算公式如下：

（1）当 $NAV < 0.5 \times (1 + 3 \times Ra \times T / T_t)$ 时，则估值优先与估值进取在封闭期内第 T 日（ $0 < T \leq T_t$ ）基金份额参考净值：

$$NAV_a = NAV / 0.5;$$

$$NAV_b = 0;$$

（2）当 $0.5 \times (1 + 3 \times Ra \times T / T_t) \leq NAV \leq 1.600$ 时，则估值优先与估值进取在封闭期内第 T 日（ $0 < T \leq T_t$ ）基金份额参考净值：

$$NAV_a = 1 + 3 \times Ra \times T / T_t;$$

$$NAV_b = (NAV - 0.5 \times NAV_a) / 0.5;$$

（3）当 $NAV > 1.600$ ，则估值优先与估值进取在封闭期内第 T 日（ $0 < T \leq T_t$ ）基金份额参考净值：

$$NAV_a = 1 + 3 \times Ra \times T / T_t + 15\% \times (NAV - 1.600) / 0.5;$$

$$NAV_b = (NAV - 0.5 \times NAV_a) / 0.5;$$

估值优先与估值进取基金份额参考净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

（六）估值优先和估值进取基金份额净值转换

本基金封闭期届满，本基金所分离的两类基金份额将按约定的收益的分配规则进行净值计算，并以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额，并办理基金的申购、赎回业务。

有关基金份额转换及申购、赎回规则及实施办法见本基金招募说明书相应部分。有关基金份额转换及申购、赎回开始时间见本基金管理人届时公告。

四、基金份额的上市与交易

（一）上市交易的基金份额

《基金合同》生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金在封闭期内，基金份额所分离的估值优先与估值进取两类

基金份额同时申请上市与交易。

在本基金封闭期届满，估值优先与估值进取份额分别按照《基金合同》约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF）基金份额，转换后的基金份额继续在深圳证券交易所上市与交易。

（二）上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

本基金份额（封闭期内估值优先与估值进取）上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记结算系统后，方可上市交易。

（三）上市交易的时间

《基金合同》生效后三个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊登基金份额上市交易公告书。

（四）上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

- 1、本基金在封闭期内所分离的估值优先与估值进取两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的参考净值；
- 2、本基金封闭期届满，估值优先与估值进取份额转换为上市开放式基金（LOF）基金份额后，本基金基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值；
- 3、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- 4、本基金买入申报数量为100 份或其整数倍；
- 5、本基金申报价格最小变动单位为0.001 元人民币；
- 6、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

（五）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

（六）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额参考净值。

（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

（八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

五、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、本基金在封闭期内及封闭期届满时，收益分配应遵循下列原则：

（1）在封闭期内，本基金不单独对基金份额所分离的估值优先与估值进取基金份额进行收益分配；

（2）在封闭期届满，按照《基金合同》第三部分关于封闭期末收益分配规则与封闭期末基金份额净值计算的约定，单独计算出估值优先与估值进取份额各自的份额净值并转换为上市开放式基金（LOF）份额，基金份额持有人可通过赎回基金份额实现应得收益；

（3）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2、本基金封闭期届满并转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金收益分配应遵循下列原则：

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效

不满3个月可不进行收益分配；

（2）场外认购/申购的基金份额，登记在注册登记系统的基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（3）场内认购/申购和上市交易的基金份额，登记在证券登记结算系统的基金收益分配方式只能为现金分红，基金份额持有人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所和注册登记机构的相关规定；

（4）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（5）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；

（6）每一基金份额享有同等分配权；

（7）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、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，在2日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。

六、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第3—7项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理人费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理人费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理人费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的有关规定，在至少一家指定报刊和基金管理人网站上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

七、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

其中，封闭期内股票投资占基金资产的60%-100%，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-40%。

封闭期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，股票投资占基金资产的60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，本基金在封闭期后保留不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

（二）投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （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其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- （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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- a、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；
- b、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

c、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%；

d、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同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

e、封闭期后现金或到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%；

f、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

g、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

h、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

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

j、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

k、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》或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。

八、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（二）基金资产净值、基金份额净值的公告方式

1、在本基金封闭期间：

本基金的《基金合同》生效后，在估值优先和估值进取两类份额开始上市交易前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值和两类基金的基金份额的参考净值；

在估值优先和估值进取上市交易后，基金管理人应当通过基金管理人网站、上市的证券交易所、基金销售网点以及其他媒介，在每个交易日的次日披露基金份额净值、估值优先和估值进取基金份额参考净值；

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、基金份额净值和估值优先和估值进取两类基金的基金份额参考净值。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、两类基金的基金份额参考净值登载在指定报刊和基金管理人网站上。

基金托管人对估值优先和估值进取的参考净值、封闭期届满时基金份额净值的折算及相关披露内容进行复核。

2、在本基金封闭期届满并转换为上市开放式基金（LOF）后：

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后，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报刊和基金管理人网站上。

九、封闭期届满与基金份额转换

（一）封闭期届满后基金的存续形式

本基金《基金合同》生效满三年后，满足《基金合同》约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称为“国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）”。

本基金在封闭期届满后，按照《基金合同》在封闭期内的收益分配约定分别对估值优先份额和估值进取份额计算封闭期末基金份额净值，并以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为同一上市开放式基金（LOF）

的份额。

本基金份额转换为上市开放式基金（LOF）份额后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

（二）封闭期届满后的份额转换规则

1、对投资者认购或通过上市交易购买并持有到期的每一份估值优先份额和估值进取基金份额，在本基金封闭期届满后，按照《基金合同》所约定的资产收益分配规定分别计算估值优先和估值进取封闭期末净值，并以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值（NAV）转换为同一上市开放式基金（LOF）的份额。无论基金份额持有人单独持有或同时持有估值优先和估值进取份额，均无需支付转换基金份额的费用。

2、估值优先和估值进取的封闭期末份额转换

（1）转换日确定

本基金份额所分离的估值优先和估值进取基金份额转换日为《基金合同》生效之日起至三年封闭期末对应日。如该对应日为非工作日，则封闭期到期日顺延到下一个工作日。转换日确定日期，届时见基金管理人公告。

（2）转换方式及份额计算

本基金封闭期末转换日日终，基金管理人将根据估值优先和估值进取基金份额转换比例对基金份额持有人转换日登记在册的基金份额实施转换。转换后，估值优先和估值进取基金份额持有人基金份额数按照转换规则将相应增加或减少。本基金封闭期末转换日T 的份额净值计算见《基金合同》第三部分。

估值优先基金份额和估值进取基金份额转换公式为：

估值优先转换后基金份额数=转换前估值优先基金份额数×T 日估值优先基金份额净值/T 日基金份额净值

估值进取转换后基金份额数=转换前估值进取基金份额数×T 日估值进取基金份额净值/T 日基金份额净值

其中，转换后基金份额数，场外保留到小数点后2 位，场内保留到整数位，T 日基金份额净值保留到小数点后8 位，采用循环进位的方法分配因小数点运算引起的剩余份额。

3、基金转换日当日及后续申购与赎回的计算

本基金份额在转换日（如非工作日，则顺延至工作日）后不超过30 天开放申购、赎回业务，转换日后的基金份额申购、赎回以申购、赎回当日的基金份额净值计算申购份额、赎回款项。份额转换后的本基金开放份额申购、赎回日期，届时见基金管理人公告。

在转换日后，基金份额净值将在转换日基金份额净值的基础上变动，投资者申购、赎回价格将以当日基金份额净值计算。转换后的基金份额的申购、赎回的具体操作办法见本基金招募说明书或基金管理人的相关公告。

（三）封闭期届满后基金的投资管理

1、封闭期届满，如本基金继续存续并转换为上市开放式基金（LOF）后，则本基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围不变；

2、封闭期届满后，如本基金继续存续并转换为上市开放式基金（LOF）后，则本基金的有关投资限制继续符合《基金合同》的约定，并符合相关法律法规的规定。

（四）封闭期届满的公告

1、封闭期届满时，在符合本基金存续条件下，本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续的相关事宜进行公告；

2、封闭期届满时，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金管理人将在临时公告或在招募说明书中公告相关规则。基金管理人可以修改相关规则，并将在临时公告或更新的招募说明书中公告；

3、在封闭期到期前三十个工作日，基金管理人还将进行提示性公告。

十、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》的变更

1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式，但本基金封闭期到期后转为上市开放式基金（LOF）除外；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）变更基金类别；

(6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金份额持有人大会召开程序；

(9) 终止《基金合同》；

(10) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

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后变更并公告，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率；

(4) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(5) 基金管理人、基金注册登记机构、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) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(7) 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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

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

2、关于《基金合同》变更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，基金管理人应在中国证监会核准后按照《信息披露办法》的有关规定，在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。

（二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）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；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告。
- （7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

若在封闭期届满前基金合同终止，则本基金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，根据前述“虚拟清算”的原则计算并确定估值优先和估值进取基金份额持有人分别应得的剩余资产比例，并据此比例对估值优先和估值进取的基金份额持有人进行剩余基金资产的分配。

若在封闭期届满，即本基金转为上市开放式基金（LOF）后基金合同终止，则本基金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。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。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小组进行公告。

（七）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。

十一、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

十二、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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