

## 长信基金管理有限责任公司

### 关于以通讯方式召开长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告

长信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）已于 2018 年 12 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》及基金管理人官方网站（<http://www.cxfund.com.cn>）披露了《长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》，为了使本基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布关于以通讯方式召开长信中证能源互联网主题指数型（LOF）证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

#### 一、会议基本情况

长信基金管理有限责任公司（以下简称“我公司”）管理的长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）于 2015 年 11 月 25 日经中国证监会《关于准予长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可【2015】2703 号）准予注册并募集，并于 2016 年 1 月 21 日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，基金管理人经与本基金的基金托管人国泰君安证券股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》。

会议的具体安排如下：

（一）会议的召开方式：通讯方式。

（二）会议投票表决起止时间：自 2019 年 1 月 2 日 0:00 至 2019 年 1 月 18

日 17:00 止(投票表决时间以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间或以基金管理人系统记录时间为准)。

(三) 会议通讯表决票将在公证机关的监督下统计。

## 二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》(以下简称“议案”,详见附件一)。

## 三、权益登记日

本次持有人大会的权益登记日为 2018 年 12 月 28 日,即在 2018 年 12 月 28 日在本基金登记机构中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并表决。

## 四、投票方式

### (一) 纸质投票(仅适用于机构投资者)

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载(<http://www.cxfund.com.cn/>)等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章或相关经授权的业务专用章(以下合称“公章”),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的有效身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

3、基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的,应由受托人在表决票上签字或盖章,并提供授权委托书原件(详

见附件二)以及本公告“五、授权(三)授权方式”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件等相关文件复印件。

4、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内(自2019年1月2日0:00至2019年1月18日17:00止,以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间为准)通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人:

收件人:周思萌

地址:上海市浦东新区银城中路68号9楼

联系电话:021-61009913

传真:021-61009917

邮政编码:200120

请在表决票或相关文件表面注明:“长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决专用”。

## (二)网络投票(仅适用于个人投资者)

为方便基金份额持有人(个人投资者)参与大会投票,自2019年1月2日0:00至2019年1月18日17:00以前(以基金管理人系统记录时间为准),基金管理人在官方网站设立投票专区,通过投票专区进行投票的基金份额持有人,应使用开户证件号码及登录密码进行登录,以核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人的权益。

## 五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会,使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意见,基金份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代为行使表决权。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则:

### (一)委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。基金份额持有人委托他人投票,需向基金管理人提供授权委托书(授权委托书的格式见附件二)。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书,待申购申请确认后,授权委托书自动生效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有基金份额的数额，以登记机构的登记为准。

## （二）受托人（代理人）

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会的表决权。

为使基金份额持有人的权利得到有效行使，建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加受托人名单。

## （三）授权方式

**本基金份额持有人大会仅接受机构投资者以纸面授权的方式授权受托人代为行使表决权。**

授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（<http://www.cxfund.com.cn/>）下载等方式获取授权委托书样本。

1、机构投资者委托他人投票的，应由委托人在填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式见附件二）上加盖该机构公章，并提供该机构加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

### 2、授权效力确定规则

（1）如果同一委托人多次以有效纸面方式授权的，且能够区分授权次序的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面

授权均为表示具体表决意见的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准，若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

(2) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

(3) 如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准，授权视为无效。

### 3、对基金管理人授权开始时间及截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为 2019 年 1 月 2 日 0:00 至 2019 年 1 月 18 日 17:00 时。将填妥的纸面授权委托书通过专人送交、邮寄或传真送达至基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。具体联系方式如下：

收件人：周思萌

地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

联系电话：021-61009913

传真：021-61009917

邮政编码：200120

## 六、计票

(一) 本次表决票的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(国泰君安证券股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期后二个工作日内即 2019 年 1 月 21 日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(二) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，且每份基金份额享有平等的表决权。

(三) 表决票效力的认定如下：

纸质表决票通过专人送交、邮寄或传真送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准；通过网络表决的，表决时间以系统记录时间为准。

### 1、纸面表决票的效力认定

(1) 纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在表决截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决

意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如纸面表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或互相矛盾,但其他各项符合会议通知规定的,视为弃权表决,计入有效表决票;并按“弃权”计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或受托人经有效授权的证明文件的,或未能在投票截止时间之前送达本公告规定的收件人的,为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交纸面表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票;如各表决票表决意见不相同,则按如下原则处理:

①送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

②送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,视为弃权表决,计入有效表决票;

③送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准,传真的以本公告规定的收件人传直接收到的时间为准。

## 2、网络表决票的效力认定

(1) 网络投票的截止时间为2019年1月18日17:00(以基金管理人系统记录时间为准)。

(2) 网络投票系统仅支持单次投票,基金份额持有人通过网络投票的结果无法修改,请持有人谨慎投票。

## 七、决议生效条件

(一) 本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%);

(二) 《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》应当由提交有效表决票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；

（三）本次基金份额持有人大会决议通过的事项，将由本基金管理人自表决通过之日起五日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

## 八、重新召集基金份额持有人大会及重新授权

如本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额未达到权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%），根据《中华人民共和国证券投资基金法》相关规定，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就本次大会审议的议案重新召集基金份额持有人大会。

重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表权益登记日 1/3 以上（含 1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。重新召集基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见基金管理人届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 九、本次大会相关机构

（一）召集人：长信基金管理有限责任公司

客服专线：4007005566

联系人：周思萌

联系电话：021-61009913

传真：021-61009917

网址：<http://www.cxfund.com.cn>

电子邮件：[service@cxfund.com.cn](mailto:service@cxfund.com.cn)

（二）基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 32 层

联系人：丛艳

联系电话：021-38677336

(三) 公证机构：上海市普陀公证处

办公地址：上海市常德路 1211 号宝华大厦 11 层

邮编：200060

联系人：黄彦

联系电话：021-52562233-351

(四) 律师事务所：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

邮编：200120

联系人：刘佳

联系电话：021-51150298

## 十、重要提示

(一) 请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

(二) 根据《中华人民共和国证券投资基金法》及本基金《基金合同》的规定，本次大会需要本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）方可举行，经出席基金份额持有人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）通过才能做出有效决议。

(三) 为加强交易风险警示，维护市场平稳，本基金场内份额于《长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》发布之日（2018 年 12 月 19 日）开市起停牌，次日（2018 年 12 月 20 日）开市起复牌。本基金场内份额自持有人大会计票之日（2019 年 1 月 21 日）开市停牌并暂停申购、赎回等业务，恢复时间将另行公告。

(四) 上述基金份额持有人大会有关公告可通过长信基金管理有限责任公司网站（<http://www.cxfund.com.cn>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电 4007005566（免长话费）咨询。

(五) 本公告的有关内容由长信基金管理有限责任公司解释。

附件一：《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

特此公告。

长信基金管理有限责任公司

2018年12月20日

附件一：《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）转型有关事项的议案》

**长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人：**

为更好地满足客户需求，保护基金份额持有人利益，我公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议召开基金份额持有人大会审议调整基金名称、基金类别、运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、基金收益分配方式等相关事项，并根据法律法规的修订对《基金合同》相关条款一并更新，同时拟相应修改本基金其他法律文件的相关条款，关于本次《基金合同》的具体修改内容详见下文的基金合同修改对照表。经基金托管人国泰君安证券股份有限公司及基金管理人长信基金管理有限责任公司协商一致，现拟对本次修改事项说明如下：

**一、转型后的产品方案要点**

（一）基金名称：长信价值优选混合型证券投资基金（以下简称“新基金”或“价值优选基金”）

（二）基金类型：混合型证券投资基金

（三）运作方式：契约型开放式

（四）基金存续期限：不定期

（五）投资目标：本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过精选具有估值优势和成长优势的上市公司股票和优质债券进行投资，力争以较低的风险获得中高水平的收益，实现基金资产的长期稳定增值。

（六）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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、国

债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（七）基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的50%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的50%；持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

（八）业绩比较基准： $\text{沪深300指数收益率} \times 75\% + \text{中债综合指数收益率} \times 25\%$ 。

（九）风险收益特征：长信价值优选混合型证券投资基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，价值优选基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

（十）基金费率

（1）申购费用

价值优选基金在申购时收取申购费，申购费率随申购金额的增加而递减。新基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。投资者可以多次申购新基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：

- ① 全国社会保障基金；
- ② 可以投资基金的地方社会保障基金；

- ③ 企业年金单一计划以及集合计划；
- ④ 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- ⑤ 企业年金养老金产品。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户申购费率如下：

申购金额 (M, 含申购费)	养老金客户申购费率
M < 100 万	0.06%
100 万 ≤ M < 500 万	0.05%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

除养老金客户之外的其他投资者申购新基金的申购费率见下表：

申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
M < 100 万	1.2%
100 万 ≤ M < 500 万	1.0%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

注：M 为申购金额

投资新基金的养老金客户，在本公司直销中心办理账户认证手续后，即可享受上述特定费率。未在本公司直销中心办理账户认证手续的养老金客户，不享受上述特定费率。

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

## (2) 赎回费用

新基金赎回费用在投资者赎回新基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，具体费率如下：

持有期限 (Y)	赎回费率
Y < 7 天	1.5%
7 天 ≤ Y < 30 天	0.75%
30 天 ≤ Y < 1 年	0.5%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.2%
2 年 ≤ Y	0

注：Y 为持有期限

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对持有期不少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率。

发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并履行相关信息披露义务。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

### （3）管理费和托管费

新基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

新基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

### （十一）申购和赎回的数量限制：

1、投资人办理新基金申购时，首次申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费，下同），追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元；超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资人通过本公司直销柜台及网上直销平台申购新基金遵循上述规则；各代销机构有不同规定的，投资人在该代销机构办理申购业务时，需同时遵循该代销机构的相关规定。

2、投资人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整新基金首次申购的最低金额。

3、基金份额持有人在销售机构赎回新基金单笔赎回申请不得低于 1 份基金份额；基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留

的基金份额余额不足 1 份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见更新的招募说明书或相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

**(十二) 基金份额净值计算：**

基金份额净值 = 基金资产净值总额 ÷ 基金份额总数。

新基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

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

**(十三) 基金份额、赎回金额计算：**

1、申购份额、余额的处理方式：申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，四舍五入保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

**(十四) 收益分配：**

在符合有关基金分红条件的前提下，新基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

**(十五) 税收：**基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

**(十六) 基金管理人：**长信基金管理有限责任公司

**(十七) 基金托管人：**国泰君安证券股份有限公司

- (十八) 登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- (十九) 会计师事务所：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
- (二十) 律师事务所：上海源泰律师事务所

## 二、转型方案安排

本次基金份额持有人大会表决通过后，修改后的《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效前，本基金将安排不少于 20 个工作日的选择期，具体安排以届时发布的相关公告为准。

选择期内，基金份额持有人可以将其持有的部分基金份额或全部基金份额赎回；在选择期内未申请赎回的场外投资者所持有的长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）的基金份额将在《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效后全部转换为长信价值优选混合型证券投资基金的基金份额，且其持有时间自其取得长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）的基金份额时持续计算。在选择期内未卖出或者申请赎回的场内投资者所持有的长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）的基金份额将在《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效后全部转换为长信价值优选混合型证券投资基金的基金份额，且统一归集于管理人指定账户，其基金份额持有人需要办理确权手续，将原本登记在上海证券账户内的基金份额转登记至普通场外基金账户名下。原长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）场内份额持有人对该部分份额进行重新确认与登记后，在长信价值优选混合型证券投资基金开放申购赎回业务后，方可就其转型后的长信价值优选混合型证券投资基金份额办理赎回业务。。

在选择期期间，由于本基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。

关于选择期的具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

**三、为实现基金变更的平稳过渡，本基金管理人已就基金变更有关的会计**

处理、注册登记、系统准备方面进行了深入研究，做好了基金运作的相关准备。

#### 四、转型后新基金合同的生效

自本次基金份额持有人大会决议生效后，选择期结束之日的次日起，《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效，《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》同时失效。

以上议案，请予审议。

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

2018年12月20日

**《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》与《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同（草案）》修改前后对照表**

章节	《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》版本	《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同（草案）》版本
	内容	内容
基金名称	长信 <del>中证能源互联网主题指数型</del> 证券投资基金（ <del>LOF</del> ）	长信 <u>价值优选混合型</u> 证券投资基金
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”)和其他有关法律、法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、<u>《证券投资基金经营机构参与内地与香港股票市场交易互联互通指引》(以下简称“《港股通指引》”)</u>、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”)和其他有关法律、法规。</p>
	<p>三、证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。中国证监会对本基金<u>募集申请</u>的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>	<p>三、<u>长信价值优选混合型证券投资基金</u>（以下简称“<u>本基金</u>”）由长信<u>中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）变更注册而来</u>，长信<u>中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）</u>由基金管理人依照《基金法》、<u>《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金合同》</u>及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。中国证监会对<u>长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）变更</u>为本基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>
	无	<p>六、<u>基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</u></p> <p><u>基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机</u></p>

		<p>制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)的,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行 T+0 回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。</p>
第二 部分 释 义	<p>7、基金份额发售公告:指《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)基金份额发售公告》</p>	<p>7、基金份额发售公告:指原《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)基金份额发售公告》</p>
	<p>15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会</p>	<p>15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会</p>
	<p>无</p>	<p>24、<u>港股通</u>:指内地投资者委托内地证券公司,经由上海证券交易所/深圳证券交易所设立的证券交易服务公司,向香港联合交易所进行申报,买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票</p>
	<p><del>24、会员单位:指具有开放式基金代销资格,经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员单位</del></p> <p><del>27、上海证券账户:指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户(即 A 股账户)或证券投资基金账户</del></p>	<p>删除</p>
	<p>30、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期</p>	<p>29、基金合同生效日:指《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》生效起始日,《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)基金合同》自同一日起失效</p>
	<p>32、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过 3 个月</p>	<p>删除</p>
	<p>34、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日</p>	<p>32、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日(若本基金参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日,则本基金有权不开放申购、赎回,并按规定进行公告)</p>
	<p>无</p>	<p>40、摆动定价机制:指当遭遇大额申购赎回时,</p>

		<p>通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p>
	<p><b>40、认购：</b>指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为</p> <p><b>43、场内：</b>指通过上海证券交易所内的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回</p> <p><b>44、场外：</b>指通过基金管理人或本基金代销机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回</p> <p><b>45、上市交易：</b>指基金合同生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为</p> <p><b>47、注册登记系统：</b>指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统。通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在本系统</p> <p><b>48、证券登记结算系统：</b>指中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统。通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在本系统</p> <p><b>49、系统内转托管：</b>基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为</p> <p><b>50、跨系统转托管：</b>基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为</p>	<p>删除</p>
<p>第三部分基金的基本情况</p>	<p>二、基金的类别 <b>指数</b>型证券投资基金</p>	<p>二、基金的类别 <b>混合</b>型证券投资基金</p>
	<p>三、基金的运作方式 <b>上市</b>契约型开放式</p>	<p>三、基金的运作方式 契约型开放式</p>
	<p>四、基金的投资目标 <b>本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求</b></p>	<p>四、基金的投资目标 <b>本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过精选具有估值优势和成长优势的上市公司股</b></p>

	<p>基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争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%, 以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>五、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。</p> <p>六、基金份额面值和认购费用 本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金的认购费按招募说明书的规定执行。</p>	<p>票和优质债券进行投资, 力争以较低的风险获得中高水平的收益, 实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>删除</p>
<p>第四部分基金的历史沿革</p>	<p>第四部分<u>基金份额的发售</u></p> <p>一、<u>基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</u></p> <p>1、<u>发售时间</u> 自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月, 具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、<u>发售方式</u> 本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。场外将通过基金管理人的直销机构和代销机构(具体名单详见发售公告)。场内将通过上海证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售(具体名单详见上海证券交易所相关业务公告)。</p> <p>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功, 而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况, 投资人应及时查询并妥善行使合法权利。</p> <p>3、<u>发售对象</u> 符合法律法规规定的可投资证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p>二、<u>基金份额的认购</u></p> <p>1、<u>认购费用</u> 本基金的认购费率由基金管理人决定, 并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。</p> <p>2、<u>募集期利息的处理方式</u> 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有, 其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录</p>	<p>第四部分<u>基金的历史沿革</u></p> <p>长信价值优选混合型证券投资基金由长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)变更注册而来。长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)于 2015 年 11 月 24 日经中国证监会《关于准予长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)注册的批复》(证监许可(2015)2703 号)注册并募集。基金管理人为长信基金管理有限责任公司, 基金托管人为国泰君安证券股份有限公司, 并于 2016 年 1 月 21 日成立。</p> <p>长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)自 2015 年 12 月 8 日至 2016 年 1 月 15 日进行公开募集, 募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)首次设立募集规模为 242,530,801.91 份基金份额, 有效认购户数为 1,404 户。经中国证监会书面确认, 长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)于 2016 年 1 月 21 日正式成立, 《长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2016 年 1 月 21 日生效。</p> <p>XXXX 年 X 月 X 日, 长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)以 XX 方式召开基金份额持有人大会并审议通过了《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》, 内容包括长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)修改基金名称、基金类别、运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、基金收益分配方式等, 将“长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)”变更为“长信价值优选混合型证券投资基金”。根</p>

<p>为准。</p> <p><b>3、基金认购份额的计算</b> 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p><b>4、认购份额余额的处理方式</b> 场外认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分（四舍五入），由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内认购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的认购资金零头由交易所会员单位退还给投资者。</p> <p><b>三、基金份额认购金额的限制</b></p> <p><b>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</b></p> <p><b>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</b></p> <p><b>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</b></p> <p><b>4、基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。认购一经受理不得撤销。</b></p>	<p>据基金份额持有人大会决议，变更注册后的《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》于<u>201X年X月X日</u>生效。</p>
<p><b>第五部分 基金的存续</b></p> <p><b>一、基金备案的条件</b> 本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p><b>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</b> 如果募集期限届满，未满足募集生效条件，</p>	<p><b>第五部分 基金的存续</b> 连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p>

	<p>基金管理人应当承担下列责任：—</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；—</p> <p>2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。—</p> <p>3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。—</p> <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>—《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	
<p>原合同) 第六部分基金份额的上市交易</p>	<p>基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。—</p> <p>一、上市交易的地点</p> <p>上海证券交易所</p> <p>二、上市交易的时间</p> <p>本基金合同生效后在符合上市交易条件后的三个月内，基金管理人将根据规定申请本基金在上海证券交易所上市交易。—</p> <p>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介上刊登基金份额《上市交易公告书》。—</p> <p>三、上市交易的规则</p> <p>上市交易的基金份额上市交易遵循《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易规则》及相关规定。—</p> <p>四、上市交易的费用</p> <p>基金份额上市交易的费用按照上海证券交易所所有规定办理。—</p> <p>五、上市交易的行情揭示</p> <p>基金份额在上海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</p>	<p>删除</p>

	<p>考) 净值。</p> <p>六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市</p> <p>基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和上海证券交易所的相关规定执行。</p> <p>七、相关法律法规、中国证监会及上海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，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。</p> <p>八、若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。</p>	
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过场内和场外两种方式进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销机构和基金管理人委托的场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为上海证券交易所具有基金代销业务资格的上海证券交易所会员单位。具体的销售机构和会员单位名单将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p><u>本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。</u></p> <p><u>投资人应当在销售机构办理基金申购、赎回业务或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。销售机构可以酌情增加或减少其销售网点、变更营业场所。</u></p>
	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日<u>申请</u>办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及相关期货交易所的正常交易日的交易时间<u>(若本基金参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日，则本基金有权不开放申购、赎回，并按规定进行公告)</u>，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更、<u>非港股通交易日</u>或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
	<p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p>	<p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p>

<p>.....</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在<u>申购、赎回开放日前</u>依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告<u>申购与赎回的开始时间</u>。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的<u>申购或者</u>赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且<u>登记机构确认接受</u>的，其基金份额申购、赎回或转换价格为<u>下一开放日</u>基金份额申购、赎回或转换的价格。</p>	<p>.....</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，<u>由基金管理人最迟于办理申购赎回开始日前 2 日在指定媒体及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）上公告</u>。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的<u>申购、赎回或者</u>转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回、转换价格为<u>下次办理</u>基金份额申购、赎回<u>时间所在开放日</u>的价格。</p>
<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、<b>场外</b>赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>.....</p> <p><b>投资者通过上海证券交易所交易系统办理本基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守上海证券交易所的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行，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。</b></p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>.....</p> <p>删除</p>
<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构<u>及上海证券交易所</u>规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>.....</p> <p>基金销售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构或基金管理公司的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。<b>投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效。</b></p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>.....</p> <p>基金销售机构<u>对</u>申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构或基金管理公司的确认结果为准。对于<u>申购、赎回</u>申请及申购份额、<u>赎回金额</u>的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。</p>

<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 <del>3</del> 位，小数点后第 <del>4</del> 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。……</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。<del>场外</del>申购份额保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。<del>场内申购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给投资者。</del></p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 <u>4</u> 位，小数点后第 <u>5</u> 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。……</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。申购份额保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p><b>8、摆动定价机制</b> <u>本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，并履行相关信息披露义务。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p>
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、基金管理人<b>认为</b>接受某笔或某些申购申请<b>可能</b>会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>3、证券/期货交易所<b>或外汇市场</b>交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、基金管理人接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、基金管理人<b>认为</b>继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>3、证券/期货交易所<b>或外汇市场</b>交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、基金管理人继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p>
<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(3) 本基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动的，基金管理人<b>有权</b>对该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20% 以上的部分赎回申请进行延期办理；对该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(3) 本基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动的，基金管理人<b>可以</b>对该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20% 以上的部分赎回申请进行延期办理；对该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人<b>可以根据前段“(1) 全额赎回：当基金管理人认为</b></p>

<p>有权根据前段“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</p> <p><del>—(5) 巨额赎回的场内业务，按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定处理。</del></p>	<p><u>有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行”或“(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制”</u>的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</p>
<p>3、巨额赎回的公告 当发生上述<b>延期</b>赎回并延期办理时……</p>	<p>3、巨额赎回的公告 当发生上述<b>巨额</b>赎回并延期办理时……</p>
<p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（含 2 周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露<b>管</b>理办法》的有关规定，提前 2 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的基金份额净值。</p>	<p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（含 2 周），暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，提前 2 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的基金份额净值。</p>

	<p>十三、基金的转托管</p> <p><b>1、系统内转托管</b></p> <p><del>（1）基金份额持有人可将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间系统内转托管或在证券登记结算系统内不同会员单位(交易单元)之间进行转指定。</del></p> <p><del>（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额赎回业务的销售机构(网点)时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。</del></p> <p><del>（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额上市交易或场内赎回的会员单位(交易单元)时，须办理已持有基金份额转指定。</del></p> <p><del>具体办理方法参照相关业务规则的有关规定以及基金代销机构的业务规则。</del></p> <p><b>2、跨系统转托管</b></p> <p><del>（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。</del></p> <p><del>（2）本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。</del></p> <p><del>（3）基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。</del></p>	<p>十三、基金的转托管</p> <p><u>基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。</u></p> <p><u>如果出现基金管理人、登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。</u></p>
	<p>无</p>	<p><b>十六、基金份额的转让</b></p> <p><u>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者通过其他方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</u></p> <p><u>十七、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况在履行一定程序后对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告。</u></p>
<p><b>第七部分基金合同当事人及</b></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（二）基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p><del>（24）基金管理人在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</del></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（二）基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>删除</p>

<p>权利 义务</p>	<p>管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；—</p> <p>二、基金托管人 (二) 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： (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算； 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： (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户，按照《基金合同》及《托管协议》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； (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》及《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《托管协议》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； (16) 按照法律法规和《基金合同》及《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作； (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》及《托管协议》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，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；</p>	<p>二、基金托管人 (二) 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： (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、<u>资金账户、期货结算账户等投资所需账户</u>，为基金办理证券、<u>期货</u>交易资金清算； 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： (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、<u>期货结算账户</u>及投资所需的其他账户，按照《基金合同》及《托管协议》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； (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； (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； (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，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；</p>
<p>第八 部分 基金 份额 持有 人大 会</p>	<p>一、召开事由 1、除法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定外，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： (5) <del>提高</del>基金管理人、基金托管人的报酬标准； 2、在不违反法律法规、基金合同以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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、基金托管费及其他应当由基金承担的费用； (6) 在对基金份额持有人利益无实质性不</p>	<p>一、召开事由 1、除法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定外，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： (5) <u>调整</u>基金管理人、基金托管人的报酬标准； 2、在不违反法律法规、基金合同以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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<u>除</u>基金管理费、基金托管费<u>外</u>其他应当由基金承担的费用； (6) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围</p>

	<p>利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关<b>认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管</b>等业务规则；</p>	<p>内调整有关<b>申购、赎回、转换、非交易过户、转托管</b>等业务规则；</p>
<p>第十部分基金的投资</p>	<p>一、投资目标 <b>本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的有效跟踪。</b></p>	<p>一、投资目标 <b>本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过精选具有估值优势和成长优势的上市公司股票和优质债券进行投资，力争以较低的风险获得中高水平的收益，实现基金资产的长期稳定增值。</b></p>
	<p>二、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<b>标的指数成份股及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货、资产支持证券</b>以及法律法规或中国证监会允许<b>本基金</b>投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：<b>本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的90%，其中，中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；</b>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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p><b>如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</b></p>	<p>二、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<b>国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、国债期货、股指期货、股票期权</b>以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>……</p> <p>基金的投资组合比例为：<b>股票资产占基金资产的50%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的50%；本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。</b>本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）<b>或者</b>到期日在一年以内的政府债券。<b>股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</b></p> <p><b>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。</b></p>
	<p>三、投资策略 <b>本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证能源互联网主题</b></p>	<p>三、投资策略 <b>1、资产配置策略</b> <b>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、</b></p>

指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,使跟踪误差控制在限定的范围之内。

### 1、资产配置策略

为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的90%,其中,中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;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。原则上本基金将采用指数完全复制法,按指数编制方法中计算出的标的指数成份股权重构建组合,少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充,以保证对标的指数的有效跟踪。

### 2、股票投资策略

本基金使用完全复制法进行被动式指数化投资,根据中证能源互联网主题指数的成份股及其编制方法创建一个投资组合,并根据指数的调整对组合进行相应的调整。

本基金股票投资策略流程如下图所示:

图:本基金股票投资流程

具体如下:

#### (1) 投资目标的确定

本基金的投资目标为追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内,以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金采用跟踪偏离度来度量本基金的跟踪误差,即选取基金一年内每日的跟踪误差时间序列数据的标准差平方和来计算年度跟踪误差,再除以日频率总数计算日均跟踪

行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源,基于本基金的投资目标和投资理念,从宏观和微观两个角度进行研究,开展战略资产配置,之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合,实现组合内各类别资产的优化配置,并追求稳健的收益。

### 2、债券投资策略

本基金主要采用积极管理型的投资策略,自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面,结合对各市场上不同投资品种的具体分析,共同构成本基金的投资策略结构。

#### (1) 利率预期策略

基于对宏观经济、货币政策、财政政策等利率影响因素的分析判断,合理确定投资组合的目标久期,提高投资组合的盈利潜力。如果预测利率趋于上升,则适当降低投资组合的修正久期;如果预测利率趋于下降,则适当增加投资组合的修正久期。

#### (2) 收益率曲线策略

债券市场的收益率曲线随时间变化而变化,本基金将根据收益率曲线的变化,和对利率走势变化情况的判断,在长期、中期和短期债券间进行配置,并从相对变化中获利。适时采用哑铃型、梯型或子弹型投资策略,以最大限度地规避利率变动对投资组合的影响。

#### (3) 优化配置策略

根据基金的投资目标和管理风格,分析符合投资标准的债券的各种量化指标,包括预期收益指标、预期风险指标、流动性指标等,利用量化模型确定投资组合配置比例,实现既定条件下投资收益的最优化。

#### (4) 久期控制策略

久期作为衡量债券利率风险的指标,反映了债券价格对收益率变动的敏感度。本基金通过建立量化模型,把握久期与债券价格波动之间的关系,根据未来利率变化预期,以久期和收益率变化评估为核心,严格控制组合的目标久期。根据对市场利率水平的预期,在预期利率下降时,增加组合久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;在预期利率上升时,减小组合久期,以规避债券价格下降的风险。通过久期控制,合理配置债券类别和品种。

#### (5) 风险可控策略

根据公司的投资管理流程和基金合同,结合对

误差，其计算公式为：
$$S_e = \sqrt{\frac{\sum_{t=1}^T (e_t - \bar{e})^2}{T-1}}$$

$e_t$  为考核期内各时点跟踪误差，

$e_t = R_{P_t} - R_{T_t}$ ，其中  $R_{P_t}$  为本基金组合收益

率， $R_{T_t}$  为中证能源互联网主题指数收益率，

$T$  为考核期内可计算的日频率跟踪误差数据的总个数。

#### (2) 投资组合的构建

本基金投资组合的构建包含确定目标组合、建仓策略及组合构建三个步骤。首先是根据本基金的投资目标，采用完全复制标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合；其次是根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析，确定合理的建仓策略；最后就是依据建仓策略，在建仓期内将组合逐步调整到目标准则。

#### (3) 投资组合的调整

为了紧跟目标指数，本基金将制定合理的交易策略，针对投资组合中的股票出现的一些非交易性场景进行投资组合的维护工作，如分红配股的处理，新股上市、摘牌、停牌及暂停交易，基金的日常申购与赎回等非交易性场景的日常处理。

#### (4) 投资组合的再平衡

本基金将定期对投资组合进行业绩评估和分析，根据投资组合拟合目标指数的情况对样本股投资比例权重的再调整。一方面使得投资组合能够配合目标指数调整、保持同步变动，另一方面也减少投资组合相对指数出现系统性偏差。

#### (5) 投资组合的业绩评价

本基金以标的指数为参照基准，对投资组合进行绩效评定，以衡量指数化投资过程中投资组合的跟踪表现，并通过控制跟踪误差来进行风险管理。

### 3、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利

市场环境的判断，设定基金投资的各项比例控制，确保基金投资满足合规性要求；同时借助有效的数量分析工具，对基金投资进行风险预算，使基金投资更好地完成投资目标，规避潜在风险。

#### (6) 现金流管理策略

统计和预测市场交易数据和基金未来现金流，并在投资组合配置中考虑这些因素，使投资组合具有充分的流动性，满足未来基金运作的要求。本基金的流动性管理主要体现在申购赎回资金管理、交易金额控制和修正久期控制三个方面。

#### (7) 对冲性策略

利用金融市场的非有效性和趋势特征，采用息差交易、价差交易等方式，在不占用过多资金的情况下获得息差收益和价差收益，改善基金资产的风险收益属性，获取更高的潜在收益。息差交易通过判断不同期限债券间收益率差扩大或缩小的趋势，在未来某一时点将这两只债券进行置换，从而获取利息差额；买入较低价格的资产，卖出较高价格的资产，赚取中间的价差收益。

### 3、股票投资策略

#### (1) 行业配置策略

在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。

#### (2) 个股投资策略

本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略，专注于具备行业领先优势、治理完善、经营稳健的优质公司，重视风险收益比，在估值低估的时候进行买入，从质地和估值两方面控制风险，力争以较低的风险获得中高水平的收益。本基金重点选择业绩优良、经营稳定、具备增长潜力、具有行业领先优势的上市公司股票。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，争取实现基金资产的长期稳健增值。

#### ① 品质评估分析

品质评估分析是本基金管理人基于企业的全面评估，对企业价值进行的有效分析和判断。上

率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。

#### 4、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资资产支持证券将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

上市公司品质评估分析包括财务品质评估和经营品质评估。

#### ② 风险因素分析

风险因素分析是对个股的风险暴露程度进行多因素分析，该分析主要从两个角度进行，一个是利用个股本身特有的信息进行分析，包括竞争引致的主营业务衰退风险、管理风险、关联交易、投资项目风险、股权变动、收购兼并等。另一个是利用统计模型对风险因素进行敏感性分析。

#### ③ 估值分析

个股的估值是利用绝对估值和相对估值的方法，寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里我们主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折现模型、P/E 模型、EV/EBIT 模型、Franchise P/E 模型等估值模型针对不同类型的产业和个股进行估值分析，另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响，排除通胀的影响因素。

#### 4、港股通投资策略

本基金将仅通过港股通投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。

本基金将通过港股通机制投资香港联合交易所上市 的股票，在上述行业配置和个股投资策略下，比较个股与 A 股市场同类公司的质地及估值水平等要素，优选具备质地优良、行业景气的公司进行重点配置。

#### 5、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权等金融工具的投资。

##### （1）权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险，有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过权证标的股票基本面的研究，并结合期权定价模型，评估权证的合理投资价值，在有效控制风险的前提下进行权证投资；本基金将通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略，杠杆交易策略等，利用权证进行对

冲和套利等。

**(2) 资产支持证券投资策略**

本基金将在严格控制风险的前提下，根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录 and 损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析，形成对资产证券的风险和收益进行综合评估，同时依据资产支持证券的定价模型，确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上，本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率，对资产支持证券进行跟踪和测评，从而形成有效的风险评估和控制。

**(3) 股指期货投资策略**

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

**(4) 国债期货的投资策略**

本基金通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长，通货膨胀压力浮现，央行政策趋于紧缩时，本基金建立国债期货空单进行套期保值，以规避利率风险，减少利率上升带来的亏损；反之，在经济增长趋于回落，通货膨胀率下降，甚至通货紧缩出现时，本基金通过建立国债期货多单，以获取更高的收益。

**(5) 股票期权投资策略**

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股票期权定价模型，选

	<p>择估值合理的股票期权合约。 <u>基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。</u></p>
<p>四、投资限制 1、组合限制 <del>（1）本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的 90%，其中，中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；</del> <del>（2）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，保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；</del> <del>（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</del> <del>（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</del> <del>（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；</del> <del>（6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</del> <del>（7）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%；</del> <del>（8）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%；</del> <del>（9）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%；</del> <del>（11）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；</del> <del>（12）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</del> <del>（13）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</del></p>	<p>四、投资限制 1、组合限制 <u>（1）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</u> <u>（2）股票资产的投资比例为基金资产的 50-95%；投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%；</u> <u>（3）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</u> <u>（4）本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；</u> <u>（5）本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；</u> <u>（6）本基金投资的权证，在任何交易日买入的总金额，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%；</u> <u>（7）本基金投资资产支持证券的，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%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值</u></p>

值的40%，债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

~~(14) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；~~

~~(15) 基金投资流通受限证券时，遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字【2006】141号）及相关规定执行；~~

~~(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。~~

除上述第(2)、(10)、(16)、(17)项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 2、禁止行为

(6) 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。

的20%。

(9) 基金投资流通受限证券时，遵照流通受限证券相关规定执行；

(10) 本基金参与股指期货、国债期货的交易，除中国证监会另有规定外，应当遵守下列要求：

1) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；在任何交易日日终，所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

2) 在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；在任何交易日日终，持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关规定；

3) 在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(11) 本基金参与股票期权交易，遵守下列投资比例限制：

1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；

2) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(14) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不

	<p>得超过该上市公司可流通股票的 <b>15%</b>；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 <b>30%</b>；</p> <p><b>(15)</b> 本基金的总资产不得超过基金净资产的 <b>140%</b>；</p> <p><b>(16)</b> 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；</p> <p><b>(17)</b> 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。</p> <p>除上述第 <b>(5)</b>、<b>(8)</b>、<b>(12)</b>、<b>(13)</b> 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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 <b>10</b> 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p><b>(6)</b> 法律、<b>行政法规</b>和<b>中国证监会</b>规定禁止的其他活动。</p>
<p>五、业绩比较基准</p> <p><b>1、标的指数</b></p> <p>本基金的标的指数为<b>中证能源互联网主题指数</b>。</p> <p>如果标的指数被停止编制及发布或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。</p> <p>由于上述原因变更标的指数，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p><b>本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准为中证综合债券指数，复合业绩比较基准为：</b></p> <p><b>沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%</b></p> <p><b>沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，是上海和深圳证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，具有较强的独立性、代表性和良好的市场流动性；沪深 300 指数编制方法的透明度较高，且具有较高的市场认同度和未来广泛使用的前景，使基金之间更易于比较。</b></p> <p><b>中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，因此该指数是本基金较为切合的市场基准选择。</b></p> <p><b>如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，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比较基准时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告。</b></p>

	<p><b>2、业绩比较基准</b></p> <p><del>95%×中证能源互联网主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）</del></p> <p>由于本基金投资标的指数为中证能源互联网主题指数，且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，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，<del>本基金将业绩比较基准定为 95%×中证能源互联网主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）。</del></p> <p>如果今后法律法规发生变化，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指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。若业绩比较基准和标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准、标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若业绩比较基准、标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名、指数编制方案调整等)，则无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人应与基金托管人协商一致后报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。</p>	
	<p><b>六、风险收益特征</b></p> <p>本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。</p>	<p><b>六、风险收益特征</b></p> <p>本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>
<p><b>第十三部分基金的财产</b></p>	<p><b>三、基金财产的账户</b></p> <p>基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。</p>	<p><b>三、基金财产的账户</b></p> <p>基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货<b>结算</b>账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。</p>
<p><b>第十</b></p>	<p><b>二、估值对象</b></p>	<p><b>二、估值对象</b></p>

<b>四部分基金资产估值</b>	基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货、 <u>国债期货、股票期权</u> 和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的<b>估值方法</b>估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p><del>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</del></p> <p><b>3、交易所市场交易的固定收益品种的估值</b></p> <p>（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，<b>选取每日收盘价作为估值全价；</b></p> <p>.....</p> <p>根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的<b>市价（收盘价）</b>估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p><b>3、流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），</b>按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p><b>4、交易所市场交易的固定收益品种的估值</b></p> <p>（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，<b>按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</b></p> <p><b>交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；</b></p> <p><b>7、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</b></p> <p><b>9、股票期权合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。</b></p> <p><b>10、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。</b></p>

		<p>.....</p> <p><b><u>当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</u></b></p> <p>根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布，<b><u>由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。</u></b></p>
	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到<b>0.001</b>元，小数点后第<b>4</b>位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>五、估值错误的处理</p> <p>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后<b>3</b>位以内(含第<b>3</b>位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</p> <p>2、估值错误处理原则</p> <p><del>（5）估值错误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。如果基金管理人委托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。</del></p>	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到<b>0.0001</b>元，小数点后第<b>5</b>位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>五、估值错误的处理</p> <p>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后<b>4</b>位以内(含第<b>4</b>位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</p> <p>2、估值错误处理原则</p> <p>删除</p>
	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场<b>或外汇市场</b>遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p>
	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第<b>7</b>项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；</p> <p>2、.....由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人<b>可以</b>免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>	<p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第<b>11</b>项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；</p> <p>2、.....由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人<b>免除</b>赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p>

<p>第十五部分 基金费用与 税收</p>	<p>一、基金费用的种类 3、<del>《基金合同》生效后的指数使用许可费；</del> <del>9、基金上市费用；</del></p>	<p>一、基金费用的种类 3、<b>因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；</b></p>
	<p>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<del>0.6%</del>年费率计提。管理费的计算方法如下： <math>H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}</math> …… 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<del>0.13%</del>的年费率计提。托管费的计算方法如下： <math>H = E \times 0.13\% \div \text{当年天数}</math> …… <b>3、《基金合同》生效后的指数使用许可费</b> <b>本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。如上述指数使用许可协议约定的指数使用许可费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数使用许可费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，计算方法如下：</b> <b>指数使用许可费按前一日的基金资产净值的<b>0.02%</b>的年费率计提。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：</b> <math>H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}</math> <b>H为每日应计提的指数使用许可费</b> <b>E为前一日的基金资产净值</b> <b>基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下限为每季度5万元。指数使用许可费将按照上述指数使用许可协议的约定进行支付。</b> 上述“一、基金费用的种类”中第<del>4—11</del>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。</p>	<p>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<b>1.5%</b>年费率计提。管理费的计算方法如下： <math>H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}</math> …… 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<b>0.1%</b>的年费率计提。托管费的计算方法如下： <math>H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}</math> …… 上述“一、基金费用的种类”中第<b>3—10</b>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。</p>

	五、费用调整 基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。 <del>调低费率不需要基金份额持有人大会决议通过。</del> 基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。	五、费用调整 基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。
第十六部分基金的收益与分配	三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金分红条件的前提下， <del>本基金每年收益分配次数最多为6次</del> ，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配； 2、…… <del>场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资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上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；</del>	三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金分红条件的前提下， <u>本基金可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告</u> ，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配； 2、…… 删除
第十七部分基金的会计与审计	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日； <del>基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；</del>	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
第十八部分基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 3、…… <del>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前</del> ，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。 （三）《基金合同》生效公告 基金管理人应当 <del>在收到中国证监会确认文件的次日</del> 在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。	五、公开披露的基金信息 （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 3、…… <u>基金管理人应及时</u> 将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。 （三）《基金合同》生效公告 基金管理人应当 <u>及时</u> 在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。
	<del>（四）《上市交易公告书》</del> <del>基金管理人应当在基金上市交易3个工作日前，将《上市交易公告书》登载在指定媒介上。</del>	删除
	（五）基金资产净值、基金份额净值 ……	（四）基金资产净值、基金份额净值 ……

<p>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<b>发售</b>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。</p>	<p>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<b>销售</b>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。</p>
<p>(八) 临时报告 <b>26、基金份额停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；</b></p>	<p>(七) 临时报告 <b>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</b></p>
<p>无</p>	<p><b>(十一) 基金投资国债期货信息披露</b> <u>基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</u></p>
<p><b>(十一) 基金投资股指期货的信息披露</b> 在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p>	<p><b>(十二) 基金投资股指期货的信息披露</b> <u>基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</u></p>
<p>无</p>	<p><b>(十三) 基金投资股票期权的信息披露</b> <u>基金管理人应当在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</u></p> <p><b>(十四) 基金投资权证的信息披露</b> <u>基金管理人将严格按照《信息披露办法》及相关法律、法规和中国证监会的有关规定，将权证投资有关信息在基金定期报告和开放式基金的招募说明书（更新）中披露。基金管理人将在基金季度报告、半年度报告、年度报告的投资组合报告中披露基金投资权证的有关信息。</u></p> <p><b>(十五) 基金投资流通受限证券的信息披露</b> <u>基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。</u></p> <p><b>(十六) 基金投资港股通标的股票的信息披露</b> <u>基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和《招募说明书》（更新）等</u></p>

		文件中披露参与港股通标的股票交易的相关情况。
	八、暂停或延迟信息披露的情形： 1、基金投资所涉及的证券/期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；	八、暂停或延迟信息披露的情形： 1、基金投资所涉及的证券/期货市场 <u>或外汇市场</u> 遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
第二十分违约责任	一、……但是发生下列情况的，当事人可以免责： 2、基金管理人和基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等； <del>4. 基金托管人由于按基金管理人符合《基金合同》及《托管协议》约定的有效指令执行而造成的损失等；</del> 5. <del>基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由商业银行、证券经纪机构等其他机构负责清算交收的委托资产及其收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产带来的损失等，但由于基金托管人过错造成的除外；</del> 6. <del>基金管理人、基金托管人对由于第三方（包括但不限于证券交易所、中登公司等）发送或提供的数据错误给本基金资产造成的损失等。</del>	一、……但是发生下列情况的，当事人免责： 2、基金管理人和 <u>/或</u> 基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等； 删除
第二十分基金合同的效力	《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、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。 4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。	《基金合同》是约定基金 <u>合同</u> 当事人之间、基金与基金 <u>合同</u> 当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并 <u>自基金份额持有人大会决议决定之日起生效</u> 。 4、《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一式一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

附件二：授权委托书（样本）

本机构特此授权\_\_\_\_\_代表本机构参加投票截止日为 年 月 日的以通讯方式召开的长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会表决结束之日止。若长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

**委托人信息：**

**机构名称(盖公章)：**

**法定代表人姓名：**

**机构证件类型：**

**机构证件号码（填写）：**

**基金账户号：**

**受托人（签字或盖章）：**

**受托人证件类型：**

**受托人证件号码（填写）：**

签署日期： 年 月 日

**授权委托书填写注意事项：**

1、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

2、如果同一委托人多次以有效纸面方式授权的，且能够区分授权次序的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面

授权均为表示具体表决意见的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准，若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

3、以上授权是基金份额持有人就其在权益登记日持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。

4、本授权委托书（样本）中“机构证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

