

# 国金通用上证 50 指数分级证券投资 基金上市交易公告书

基金管理人：国金通用基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市日期：2015 年 6 月 5 日

公告日期：2015 年 6 月 2 日

## 目 录

一、重要声明与提示 .....	3
二、基金概览 .....	3
三、基金份额的募集与上市交易 .....	6
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	8
五、基金主要当事人简介 .....	9
六、基金合同摘要 .....	12
七、基金财务状况 .....	12
八、基金投资组合 .....	13
九、重大事件揭示 .....	16
十、基金管理人承诺 .....	16
十一、基金托管人承诺 .....	16
十二、基金上市推荐人意见 .....	17
十三、备查文件目录 .....	17
附件：国金通用上证 50 指数分级证券投资基金基金合同摘要 .....	18

## 一、重要声明与提示

《国金通用上证 50 指数分级证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号——上市交易公告书的内容与格式》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,国金通用基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本公告书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。国金通用上证 50 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)托管人中国民生银行股份有限公司保证本公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”)和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定信息披露媒体和国金通用基金管理有限公司网站([www.gfund.com](http://www.gfund.com))上的《国金通用上证 50 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:国金通用上证 50 指数分级证券投资基金
- 2、基金类型:股票型指数基金
- 3、基金运作方式:契约型开放式
- 4、本基金的基金份额包括国金通用上证 50 指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称“国金 50”,基金代码“502020”)、国金通用上证 50 指数分级证券投资基金之 A 类份额(场内简称“国金 50A”,基金代码“502021”)及国金通用上证 50 指数分级证券投资基金之 B 类份额(场内简称“国金 50B”,基金代码“502022”)。其中,国金 50A 份额和国金 50B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。
- 5、本基金的存续期限为不定期。

6、国金 50 份额的申购和赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对国金 50 份额进行申购与赎回。投资者办理场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和基金管理人委托的场外销售机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且具有相应业务资格的上海证券交易所会员单位。场外、场内销售机构名单参见招募说明书或其他相关公告。国金 50A 份额、国金 50B 份额仅上市交易，不接受申购和赎回。

7、跨系统转托管：通过场内、场外方式认购本基金的基金份额持有人可以通过认购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。

8、份额配对转换：份额配对转换是指国金 50 场内份额与国金 50A 份额、国金 50B 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 份国金 50 场内份额申请转换成 1 份国金 50A 份额与 1 份国金 50B 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 份国金 50A 份额和每 1 份国金 50B 份额申请转换成 2 份国金 50 场内份额的行为。

9、定期份额折算

每个会计年度（基金合同生效不足六个月的年份除外）的 12 月 15 日（遇节假日顺延）为定期份额折算基准日，本基金将对国金 50A 份额和国金 50 份额按照以下规则进行基金的定期份额折算。在基金份额定期折算前与折算后，国金上证 50A 份额和国金上证 50B 份额的份额配比保持 1：1 的比例不变。折算基准日折算前的国金上证 50A 份额的参考净值超出 1.000 元部分，将被折算为场内国金上证 50 份额分配给国金上证 50A 份额持有人。国金上证 50 份额持有人持有的每 2 份国金上证 50 份额将获得按照 1 份国金上证 50A 份额应得约定收益分配的新增国金上证 50 份额。持有场外国金上证 50 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国金上证 50 份额；持有场内国金上证 50 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国金上证 50 份额。经过上述份额折算，国金上证 50A 份额的参考净值和国金上证 50 份额的基金份额净值将相应调整，国金上证 50B 份额的参考净值不发生变化。

#### 10、不定期份额折算

当国金 50 份额的基金份额净值大于或等于 1.500 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国金 50A 份额、国金 50B 份额和国金 50 份额进行不定期份额折算，份额折算后本基金将确保国金 50A 份额和国金 50B 份额的比例为 1 : 1，份额折算后国金 50A 份额、国金 50B 份额和国金 50 份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。

当国金 50B 份额的参考净值小于或等于 0.250 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国金 50A 份额、国金 50B 份额和国金 50 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保国金 50A 份额和国金 50B 份额的比例为 1 : 1，份额折算后国金 50 份额的基金份额净值以及国金 50A 份额和国金 50B 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。

11、基金份额总额：截至 2015 年 5 月 29 日，本基金的基金份额总额为 206,962,434.38 份，其中国金 50 为 16,705,108.38 份，国金 50A 为 95,128,663.00 份，国金 50B 为 95,128,663.00 份。

12、基金份额净值：截至 2015 年 5 月 29 日，国金 50 的基金份额净值为 1.000 元，国金 50A 的基金份额参考净值为 1.000 元，国金 50B 的基金份额参考净值为 1.000 元。

13、本次上市交易的基金份额简称及其交易代码：国金通用上证 50 份额（场内简称：国金 50），交易代码：502020；国金通用上证 50A 份额（场内简称：国金 50A），交易代码：502021；国金通用上证 50B 份额（场内简称：国金 50B），交易代码：502022。

14、本次上市交易的基金份额总额：国金 50 份额 4 份；国金 50A 份额 95,128,663.00 份，国金 50B 份额 95,128,663.00 份。

15、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

16、上市交易日期：2015 年 6 月 5 日

17、基金管理人：国金通用基金管理有限公司（网站：[www.gfund.com](http://www.gfund.com)）

18、基金托管人：中国民生银行股份有限公司

19、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、基金份额的募集与上市交易

(一) 本基金上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]594 号

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：2015 年 5 月 11 日至 2015 年 5 月 20 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) 场外发售机构

直销机构：国金通用基金管理有限公司直销柜台、国金通用基金网上直销系统。

其他销售机构：中国民生银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。

(2) 场内发售机构

本基金的场内发售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位。本基金募集结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。具体名单可在上海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：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况：经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，国金通用上证 50 已收到首次募集扣除认购费用后的有效净认购金额为人民币 206,933,433.00 元，折合 206,933,433.00 份基金份额。募集资金在募集期间产生的利息为人民币 29,001.38 元，折合 29,001.38 份基金份额。截止 2015 年 5 月 25 日本次募集的实收基金 206,962,434.38 元已全额划入本基金在基金托管人中国民生银行股份有限公司开立的本基金托管专户。本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额 1.00 元计算，本基金募集期间含本息共募集

206,962,434.38 份基金份额，其中场外认购的基金份额为 16,705,104.38 份；场内认购的基金份额为 190,257,330.00 份。

10、募集备案情况：本基金已于 2015 年 5 月 25 日验资完毕，于 2015 年 5 月 26 日向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续，并于 2015 年 5 月 27 日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2015 年 5 月 27 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：206,962,434.38 份。

#### （二）本基金日常申购、赎回安排

本基金管理人将于 2015 年 6 月 5 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）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书 [2015]233 号

2、上市交易日期：2015 年 6 月 5 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、本次上市交易的基金份额场内简称：国金 50、国金 50A、国金 50B。

5、本次上市交易的基金份额交易代码：国金 50 为 502020、国金 50A 为 502021；国金 50B 为 502022。

6、本次上市交易的基金份额：国金 50 为 4 份；国金 50A 为 95,128,663.00 份；国金 50B 为 95,128,663.00 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上交所，由上交所于 T+1 日通过行情系统揭示 T 日基金份额净值。根据《中华人民共和国证券投资基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对其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上海证券交易所场内后，场内国金 50 份额可以上



市交易，也可申请分拆成国金 50A 和国金 50B 后上市交易。

9、本基金开通跨系统转托管业务日期：2015 年 6 月 5 日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）基金份额持有情况（截止 2015 年 5 月 29 日）

本基金持有人户数为 1,189 户，平均每户持有的基金份额为 174,064.28 份；国金 50A 份额为 8 户，平均每户持有的基金份额为 11,891,082.88 份；国金 50B 份额为 8 户，平均每户持有的基金份额为 11,891,082.88 份。

### （二）场内基金份额持有人结构（截止 2015 年 5 月 29 日）

1、场内机构持有人持有的本次上市交易的国金 50A 份额 95,009,824.00 份，占场内基金份额总数的 99.8751%；场内个人持有本次上市交易的国金 50A 份额 118,839.00 份，占场内基金份额总数的 0.1249%。

2、场内机构持有人持有的本次上市交易的国金 50B 份额 95,009,824.00 份，占场内基金份额总数的 99.8751%；场内个人持有本次上市交易的国金 50B 份额 118,839.00 份，占场内基金份额总数的 0.1249%。

### （三）场内国金 50A 份额前十名持有人情况（截止 2015 年 5 月 29 日）

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	银河资本—邮储银行—银河资本青昀套利 6 号资产管理计划	25,002,875.00	26.28%
2	银河资本—邮储银行—银河资本青昀套利 7 号资产管理计划	25,002,875.00	26.28%
3	银河资本—邮储银行—青昀 8 号资产管理计划	15,001,525.00	15.77%
4	银河资本—光大银行—银河资本—青昀 1 号资产管理计划	12,501,187.00	13.14%
5	银河资本—邮储银行—青昀套利 4 号资产管理计划	10,000,850.00	10.51%
6	银河资本—光大银行—银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	7,500,512.00	7.88%
7	徐昱	69,324.00	0.07%
8	杨龙杰	49,515.00	0.05%
9			
10			



**(三) 场内国金 50B 份额前十名持有人情况 (截止 2015 年 5 月 29 日)**

序号	持有人名称 (全称)	持有基金份额 (份)	占场内总份额比例 (%)
1	银河资本—邮储银行—银河资本青昀套利 6 号资产管理计划	25,002,875.00	26.28%
2	银河资本—邮储银行—银河资本青昀套利 7 号资产管理计划	25,002,875.00	26.28%
3	银河资本—邮储银行—青昀 8 号资产管理计划	15,001,525.00	15.77%
4	银河资本—光大银行—银河资本—青昀 1 号资产管理计划	12,501,187.00	13.14%
5	银河资本—邮储银行—青昀套利 4 号资产管理计划	10,000,850.00	10.51%
6	银河资本—光大银行—银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	7,500,512.00	7.88%
7	徐昱	69,324.00	0.07%
8	杨龙杰	49,515.00	0.05%
9			
10			

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司上海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：国金通用基金管理有限公司
- 2、法定代表人：尹庆军
- 3、总经理：尹庆军
- 4、注册资本：2.8 亿元人民币
- 5、注册地址：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6
- 6、设立批准文号：中国证监会证监许可[2011]1661 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：110000014379949
- 8、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
- 9、股权结构：国金通用基金管理有限公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、中

国通用技术（集团）控股有限责任公司，四家企业共同出资 2.8 亿元人民币，出资比例分别为 49%、19.5%、19.5%和 12%。

#### 10、内部组织结构及职能：

公司总经理在董事会的直接领导下，履行全面管理职责。督察长及其它实际履行上述职责的管理人员（以下简称“公司副职”）配合和协助总经理履行职责。公司设量化投资事业部、指数投资事业部、权益投资事业部、网络金融事业部、销售事业部、固定收益投资部、合规风控部、基金交易部、市场运营部和运营支持部等 10 个一级管理部门，在总经理或公司副职的直接管理下开展工作，并为各事业部提供各类综合管理职能。

#### 11、人员情况：

截止到 2015 年 5 月 18 日，公司正式员工 73 人，具备基金从业资格的人员有 51 人，所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

#### 12、信息披露负责人：徐炜瑜

电话：010-88005601

#### 13、本基金基金经理

宫雪女士，博士，毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，管理科学与工程专业。2008 年 7 月至 2011 年 11 月在博时基金管理有限公司股票投资部工作，任产业分析师。2012 年 2 月加盟国金通用基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部总经理、指数投资部副总经理，2013 年 7 月 26 日起担任国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 8 月 27 日起担任国金通用鑫安保本混合型证券投资基金基金经理，2014 年 10 月 31 日起任指数投资事业部总经理兼基金经理。

### （二）基金托管人

1、名称：中国民生银行股份有限公司（简称“中国民生银行”）

2、成立日期：1996 年 2 月 7 日

3、注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

4、办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

5、注册资本：28,365,585,227 元人民币

6、法定代表人：洪崎

7、资产托管业务批准文号：证监基金字〔2004〕101号

8、资产托管部信息披露负责人：赵天杰

9、联系电话：010-58560666

10、主要人员情况

杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

11、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 60 人，平均年龄 36 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。

截止到 2015 年 3 月 31 日，本行共托管基金 36 只，分别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金账簿货币市场基金、长信增利动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、中银美丽中国股票型证券投资基金、建信消费升

级混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、中银互利分级债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场证券投资基金、国金通用金腾通货币市场证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定添利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦新动力灵活配置混合型证券投资基金和兴业年年利定期开放债券型证券投资基金。托管基金资产净值为 906.15 亿元。

### （三）基金验资机构

- 1、名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
- 2、法定代表人：吴港平
- 3、注册地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
- 4、经办注册会计师：汤骏、王珊珊
- 5、联系电话：010-58152145

## 六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金截至 2015 年 5 月 29 日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产	期末数	负债及持有人权益	期末数

资 产：		负 债：	
银行存款	206,962,434.38	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	-	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	11,341.46
基金投资	-	应付托管费	1,134.15
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	-
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	37,029.57	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	1,418.67
其他资产	-	负债合计	13,894.28
		所有者权益：	-
		实收基金	206,962,434.38
		未分配利润	23,135.29
		所有者权益合计	206,985,569.67
资产合计：	206,999,463.95	负债与持有人权益总计：	206,999,463.95

## 八、基金投资组合

国金通用上证 50 指数分级证券投资基金的投资组合如下：

(一) 截至 2015 年 5 月 29 日，基金资产组合情况

资产项目	金额（人民币元）	占基金资产总值比例(%)
银行存款和清算备付金	206,962,434.38	99.98
股票市值	-	-
债券市值	-	-
权证市值	-	-
买入返售金融资产	-	-
其他资产	37,029.57	0.02
合计	206,999,463.95	100.00

(二) 截至 2015 年 5 月 29 日，指数投资按行业分类的股票投资组合：

分 类	市值（元）	占期末净值比例
A 农、林、牧、渔业	-	-

B 采矿业	-	-
C 制造业	-	-
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 批发和零售业	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J 金融业	-	-
K 房地产业	-	-
L 租赁和商务服务业	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-
S 综合	-	-
合计	-	-

(三) 截至 2015 年 5 月 29 日, 积极投资按行业分类的股票投资组合:

截至 2015 年 5 月 29 日, 本基金未持有积极投资部分股票。

(四) 截至 2015 年 5 月 29 日, 指数投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细:

截至 2015 年 5 月 29 日, 本基金未持有指数投资股票。

(五) 截至 2015 年 5 月 29 日, 积极投资按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细:

截至 2015 年 5 月 29 日, 本基金未持有积极投资部分股票。

(六) 截至 2015 年 5 月 29 日, 按券种分类的债券投资组合:

截至 2015 年 5 月 29 日, 本基金未持有债券投资。

(七) 截至 2015 年 5 月 29 日, 按市值占基金资产净值比例大小排序的前五

名债券投资明细：

截至 2015 年 5 月 29 日，本基金未持有债券投资。

（八）截至 2015 年 5 月 29 日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细：

截至 2015 年 5 月 29 日，本基金未持有资产支持证券。

（九）截至 2015 年 5 月 29 日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细：

截至 2015 年 5 月 29 日，本基金未持有权证。

（十）投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库  
基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,029.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,029.57

4、截至 2015 年 5 月 29 日，持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2015 年 5 月 29 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、截至 2015 年 5 月 29 日，前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2015 年 5 月 29 日，本基金期末前十名股票中不存在流通受限情况。



## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前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、上海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》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）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，并将纠正结果报告中国证监会。

## 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

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

- （一）中国证监会核准国金通用上证50指数分级证券投资基金募集的文件；
- （二）《国金通用上证50指数分级证券投资基金基金合同》；
- （三）《国金通用上证50指数分级证券投资基金招募说明书》；
- （四）《国金通用上证50指数分级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；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

国金通用基金管理有限公司

2015年6月2日

## 附件：国金通用上证 50 指数分级证券投资基金基金合同摘要

### 第一部分 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一) 基金管理人

##### 1、基金管理人简况

名称：国金通用基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区府前街三号楼 3-6

法定代表人：尹庆军

设立日期：2011 年 11 月 2 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2011]1661 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.8 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：张丽

联系电话：010-88005888

##### 2、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) 依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜；
- 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) 按照规定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、更换基金销售机构, 对基金销售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登记业务并获得基金合同规定的费用, 若委托其他机构办理登记业务的, 应对委托的基金登记机构办理基金登记的行为进行监督;
- 10) 依据基金合同及有关法律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) 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;
- 13) 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;
- 14) 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;
- 15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;
- 16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、份额配对转换等业务规则;
- 17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

(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) 依法募集资金, 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、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,确定国金上证 50 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内发出,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前提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；

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；

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26) 建立并保存基金份额持有人名册，按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人简况

名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996 年 2 月 7 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复[1996]14 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2004]101 号

### 2、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、托管协议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费用；

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) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

(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、证券账户等投资所需账户，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；

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、国金上证 50 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) 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管理人、基金份额持有人依法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,应为基金份额持有人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议;

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。

### (三) 基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受,基金投资者依据基金合同取得本基金的基金份额,即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。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。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 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；
- (5) 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；
- (6) 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；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 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。

## 第二部分 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国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 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同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (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；
- (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) 单独或合计持有国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额各自份额 10%以上（含 10%）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；

(12) 终止国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

(13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(14) 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、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (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且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(4) 因相应的法律法规、上海证券交易所或注册登记机构相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(6) 在法律法规和基金合同规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，更改标的指数名称或调整指数编制方法；

(7) 经中国证监会批准，基金推出新业务或服务；

(8) 按照法律法规和基金合同规定不需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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、单独或合计持有国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额各自基金份额 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，单独或合计持有国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额各自基金份额 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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、单独或合计持有国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额各自基金份额 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，单独或合计持有国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额各自基金份额 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 30 日，在指定媒介公告。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、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （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）授权委托证明的内容要求（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、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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证明委派代表出席，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，基金管理人或基金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证明符合法律法规、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益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额应占权益登记日各类别基金份额的二分之一以上（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额少于本基金在权益登记日各类别基金份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项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到会者在权益登记日代表的有效的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额应不少于在权益登记日各类别基金份额的三分之一（含三分之一）。

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书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

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约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，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书面意见的，基金份额持有人所代表的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额占权益登记日各类别基金份额的二分之一以上（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额小于在权益登记日各类别基金份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项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国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额各类别基金份额三分之一以上（含三分之一）的基金份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

#### (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前及时公告。

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。

## 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，则由出席大会的国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额各自的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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拒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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### (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。

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国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额表决权的二分之一以上（含二分之一）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。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的国金上证 50 份额、国金上证 50A

份额与国金上证 50B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。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、本基金与其他基金合并、终止国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额运作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，否则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，形式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，但应当计入出具表决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书面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 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。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。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，经与基金托管人协商一致，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 第三部分 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）收益分配原则

在本基金存续期内，本基金（包括国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额、国金上证 50B 份额）不进行收益分配。

如果基金份额持有人大会决定终止国金上证50A份额与国金上证50B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。

#### 第四部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取与支付

##### （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有关的会计师费、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、期货交易费用。
- 7、基金的开户费用、账户维护费用。
- 8、基金上市费用。
- 9、基金合同生效以后的标的指数使用许可费。
- 10、基金的银行汇划费用。
- 11、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。

##### （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

###### 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 1.0% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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付指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力，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 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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付指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力，支付日期顺延。

### 3、基金标的指数使用许可费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中予以披露。

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。

#### （三）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。

（四）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 2 日前在指定媒介上刊登公告。

#### （五）基金税收

本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。

## 第五部分 基金财产的投资范围和投资限制

### （一）投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪上证 50 指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

### （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，包括上证 50 指数的成份股、备选成份股、其他股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)、债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货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）。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单、证券投资基金的，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与同业存单、证券投资基金的投资，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%；投资于标的指数成份股及其备选成份股的组合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，本基金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超过基金资产净值的 3%。

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。

待证券投资基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以根据相关法律法规的规定，在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。

### （三）投资策略

本基金采用指数完全复制方法，按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复



制指数的目的，力争保持基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如遇特殊情况（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）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，并运用股指期货等金融衍生工具，以实现跟踪误差的有效控制。

### 1、投资组合的构建

本基金采用指数完全复制方法构建基金的股票投资组合，即根据个股在标的指数中相应的权重构建基金的指数化股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。

### 2、组合的调整

#### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和对备选股的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### 2) 不定期调整

①当标的指数成份股发生包括股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等事件时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整。

②当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整。

③根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标指数的有效跟踪。

④因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整。

⑤在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

⑥如法律法规对指数型基金投资比例的规定进行调整，本基金将在履行适当程序后，对本基金的投资组合进行调整，无需召开持有人大会。

### 3、股票的替代

在建仓阶段和基金后续运作过程中，如遇到特殊情况（如：市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将根据



市场情况以跟踪误差最小化为原则，以行业、规模、历史表现相似度为标准，采用合理的方法进行适当调整和替代。

#### 4、股指期货投资策略

基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要采用流动性好、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。

#### 5、跟踪误差的监控与管理

跟踪误差的管理将作为本基金主要的风险控制手段之一，基金经理及风险控制部门将每日跟踪投资组合与标的指数投资回报率之间的偏离度。月末、季末定期对基金投资组合与标的指数收益率间的累积偏离程度进行归因分析，并对控制跟踪误差提出解决方案。

#### （四）标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数为中证指数有限公司发布的上证 50 指数。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{上证 50 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$

如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致上证 50 指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，基金管理人认为有必要作相应调整时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称等。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更，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，报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略等无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、标的指数更名等事项），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及时公告。标的指数发生变更的，本基金业绩比较基准也相应变更。

#### （五）风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种，其预

期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金三类基金份额来看，国金上证 50 份额具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，国金上证 50A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；国金上证 50B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

## （六）投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（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）本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%；投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 80%；

（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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

（7）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额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）本基金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；

（10）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；

(11) 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 5%；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%；

(12) 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。本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三个月内全部卖出；

(13) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(14) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其它投资限制。

因证券/期货市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。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。

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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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) 违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外。
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资。
- (6) 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。

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 第六部分 基金资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### (二) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### (三) 估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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，确定公允价值；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(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。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、股指期货合约按交易所当日公布的结算价进行估值，若当日无结算价，则按最近一个交易日的结算价进行估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知



对方，共同查明原因，双方协商解决。

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。

#### （四）估值程序

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 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额（参考）净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额（参考）净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （五）估值错误的处理

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（参考）净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下

述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误责任方。

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估。

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误责任方进行更



正和赔偿损失。

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额（参考）净值估值错误处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额（参考）净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额及国金上证 50B 份额中任一类别份额（参考）净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额及国金上证 50B 份额中任一类别份额（参考）净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 因基金份额（参考）净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形

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。

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额（参考）净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额（参考）净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

(八) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于中证指数公司、证券/期货交易所或登记结算公司发送的数据错误等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的或即使发现错误但因前述原因无法纠正的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第七部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人协商一致后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

### （二）基金合同的终止事由

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) 基金合同终止情形出现时，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) 对基金剩余财产进行分配。

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

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，分别计算国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额各自的应计分配比例，并据此由国金上证 50 份额、国金上证 50A 份额与国金上证 50B 份额各自的基金份额持有人根据其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财产清算报告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。

## 第八部分 争议解决方式

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，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。

基金合同受中国（不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区）法律管辖。

### **第九部分 基金合同存放地和投资者取得合同的方式**

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。