

国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资 基金上市交易公告书

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

注册登记人：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

上市时间：2021年2月24日

公告日期：2021年2月19日

目录

一、	重要声明与提示	1
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	6
六、	基金合同摘要	10
七、	基金财务状况	11
八、	基金投资组合	12
九、	重大事件揭示	16
十、	基金管理人承诺	17
十一、	基金托管人承诺	18
十二、	基金上市推荐人意见	19
十三、	备查文件目录	20
附件：	基金合同摘要	21

一、 重要声明与提示

《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（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〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人国寿安保基金管理有限公司（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。本基金托管人招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、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。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者阅读刊登在国寿安保基金管理有限公司网站（www.gsfunds.com.cn）上的《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、 基金概览

- 1、基金名称：国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金二级市场交易简称：AH300ETF（扩位简称：沪港深300ETF）
- 3、基金二级市场交易代码：517300
- 4、基金申购、赎回简称：AH300ETF
- 5、基金申购、赎回代码：517301
- 6、截至公告日前两个工作日即2021年2月10日基金份额总额：3,936,434,450.00份
- 7、截至公告日前两个工作日即2021年2月10日基金份额净值：3,970,458,081.43元
- 8、本次上市交易份额：3,936,434,450.00份
- 9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 10、上市交易日期：2021年2月24日
- 11、基金管理人：国寿安保基金管理有限公司
- 12、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 13、上市推荐人：国泰君安证券有限公司
- 14、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 15、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：

安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将在基金管理人网站公示。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时在基金管理人网站公示。

三、 基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2020年12月18日证监许可〔2020〕3525号。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2021年1月25日至2021年1月29日。其中，网下现金发售的日期为2021年1月25日至2021年1月29日，网下股票发售的日期为2021年1月25日至2021年1月29日，网上现金发售的日期为2021年1月27日至2021年1月29日。

5、发售价格：人民币1.00元。

6、发售期限：网下现金认购5个工作日，网下股票认购5个工作日，网上现金认购3个工作日。

7、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。

8、发售机构：

（1）直销机构

投资者可以通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下股票认购。

（2）代销机构

办理本基金网下现金和网下股票认购的发售代理机构：

国泰君安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司。

网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

（二）基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可[2020]3525号文批准，自2021年1月25日起公开募集，截止2021年1月29日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的募集金额总额为3,936,141,500.00元人民币（含所募集股票市值），折合基金份额3,936,141,500.00份；经基金登记结算机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计292,950.00元人民币，折合基金份额292,950.00份，归基金份额持有人所有；网上现金认购和通过发售代理机构进行网上现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息共计480,325.14元，计入基金财产。募集资金已于2021年2月4日划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为30,148户。其中，本基金管理人国寿安保基金管理有限公司基金从业人员认购本基金200,000份。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

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》以及《国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2021年2月4日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。

(三) 基金上市交易

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〔2021〕65号

2、上市交易日期：2021年2月24日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金二级市场交易简称：AH300ETF（扩位简称：沪港深300ETF）

5、基金二级市场交易代码：517300

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：AH300ETF

7、基金申购、赎回代码：517301

投资者应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括：

安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

上述排名不分先后。本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并及时在基金管理人网站公示。

8、本次上市交易份额：3,936,434,450.00 份

9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

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2021年2月10日，本基金份额持有人户数为30,148户，平均每户持有的基金份额为130,570.33份。

（二）持有人结构

截至2021年2月10日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为2,263,988,450.00份，占基金总份额的57.51%；个人投资者持有的基金份额为1,672,446,000.00份，占基金总份额的42.49%。

（三）场内前十名基金份额持有人情况

截至2021年2月10日，场内前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额的比例
1	中国人寿保险股份有限公司	2,000,269,500.00	50.81%
2	新华人寿保险股份有限公司	100,013,000.00	2.54%
3	中国人寿保险（集团）公司企业年金计划—中国农业银行股份有限公司	40,004,900.00	1.02%
4	宁波珑琪投资管理合伙企业（有限合伙）	30,460,000.00	0.77%
5	中国人寿养老保险股份有限公司—国寿福盈今生个人养老保障管理产品开放式4号投资	20,002,200.00	0.51%
6	都邦财产保险股份有限公司	15,000,000.00	0.38%
7	国寿永诚企业年金集合计划—中国银行股份有限公司	10,000,850.00	0.25%
8	山东省天惠食品集团有限公司	3,000,000.00	0.08%
9	上海徐汇商建房地产有限公司	3,000,000.00	0.08%
10	上海考普雷投资管理有限公司	3,000,000.00	0.08%

五、 基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

- 1、名称：国寿安保基金管理有限公司
- 2、法定代表人：王军辉
- 3、总经理：左季庆
- 4、注册资本：12.88亿元人民币
- 5、住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢306号
- 6、办公地址：北京市西城区金融大街28号盈泰商务中心2号楼11、12层
- 7、设立批准文号：中国证监会证监许可[2013]1308号
- 8、工商登记注册的法人营业执照文号：00000002201808080040
- 9、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
- 10、股权结构：中国人寿资产管理有限公司，持有股份85.03%；AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（安保资本投资有限公司），持有股份14.97%。

11、内部组织结构及人员情况：

截至2020年12月31日，本公司共设立投资管理部、投资管理二部、股票投资部、绝对收益部、专户投资部、研究部、交易管理部、渠道业务部、机构业务部、电商业务部、客户服务部、产品创新部、运营管理部、合规管理部、监察稽核部、信息技术部、综合管理部等17个部门，绝大多数员工具备多年的基金行业或资产管理行业从业经验。无论从部门设置、部门人员分配、员工知识结构还是从技能与从业经验结构看，公司员工及在基金运作各环节的分配已足以保证基金守法诚信、规范运作。

12、基金管理业务情况简介：

截至2020年12月31日，国寿安保基金管理有限公司旗下共管理71只开放式基金，管理总资产规模2269.18亿元人民币。

13、本基金基金经理简介

李康先生，基金经理，博士研究生。曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2015年3月起任国寿安保沪深300指数型证券投资基金(2018年8月13日转型为国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金)基金经理，2015年5月起任国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金和国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2018年1月起任国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金（2019年4月1日转型为国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金）基金经理。2020年3月起担任国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理。2021年2月起担任国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2019年9月30日，本集团总资产73,059.25亿元人民币，高级法下资本充足率15.44%，权重法下资本充足率12.86%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工87人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、

第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

3、主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991年加入本行；2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任本行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员

任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

4、基金托管业务经营情况

截至2019年12月31日，招商银行股份有限公司累计托管545只证券投资基金。

（三）上市推荐人

国泰君安证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：(021)38676666 转 6161

传真：(021)38670161

客户服务电话:4008888666

网址：www.gtja.com

（四）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021 - 23238888

传真：021 - 23238800

联系人：周祎

经办注册会计师：张勇、周祎、蔡晓慧

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

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

（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2021年2月10日资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资产：	期末余额	负债：	期末余额
银行存款	2,507,369,589.49	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金	30,576,409.86	衍生金融负债	
交易性金融资产	1,627,598,874.44	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	1,627,598,874.44	应付证券清算款	594,741,707.01
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	323,721.10
基金投资		应付托管费	64,744.22
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产	400,000,000.00	应付交易费用	948,660.96
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	535,791.60	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	24,075.81
其他资产	480,325.14	负债合计	596,102,909.10
		所有者权益：	
		实收基金	3,936,434,450.00
		未分配利润	34,023,631.43
		所有者权益合计	3,970,458,081.43
资产总计	4,566,560,990.53	负债和所有者权益总计	4,566,560,990.53

八、 基金投资组合

截止到2021年2月10日，本基金的投资组合如下：

(一) 基金资产组合情况

(一) 截止到2021年2月10日，基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,627,598,874.44	35.64
	其中：股票	1,627,598,874.44	35.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	400,000,000.00	8.76
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,507,369,589.49	54.91
8	其他资产	31,592,526.60	0.69
9	合计	4,566,560,990.53	100.00

(二) 截止到2021年2月10日，报告期末按行业分类的股票投资组合

1、按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	21,016,791.00	0.53
B	采矿业	30,098,960.00	0.76
C	制造业	748,767,039.25	18.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,168,986.00	0.51
E	建筑业	16,163,176.00	0.41
F	批发和零售业	3,551,632.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	15,755,439.38	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,335,487.00	1.07
J	金融业	329,560,358.06	8.30
K	房地产业	30,269,558.00	0.76
L	租赁和商务服务业	34,373,026.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	17,937,000.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,843,452.00	0.05
Q	卫生和社会工作	20,149,272.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	3,863,700.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	1,335,853,876.69	33.64

2、按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	1,236,407.64	0.03
消费者非必需品	48,253,165.10	1.22
消费者常用品	12,458,462.02	0.31
能源	4,570,015.15	0.12
金融	85,229,843.96	2.15
医疗保健	12,649,351.40	0.32
工业	5,535,767.05	0.14
信息技术	14,804,579.78	0.37
电信服务	80,619,841.80	2.03
公用事业	8,891,585.88	0.22
地产建筑业	17,495,977.97	0.44
合计	291,744,997.75	7.35

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（三）截止到2021年2月10日，报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	34,200	88,954,200.00	2.24
2	00700	腾讯控股	119,000	75,221,927.76	1.89
3	601318	中国平安	733,000	58,090,250.00	1.46
3	02318	中国平安	131,000	9,842,211.83	0.25
4	000858	五粮液	131,259	44,975,896.35	1.13
5	600036	招商银行	698,400	38,097,720.00	0.96
5	03968	招商银行	64,000	3,431,539.97	0.09
6	000333	美的集团	351,475	35,758,821.57	0.95
7	300750	宁德时代	79,102	32,123,576.73	0.82
8	601166	兴业银行	983,400	25,980,266.89	0.66
9	600276	恒瑞医药	239,200	26,044,575.31	0.66
10	03690	美团-W	73,000	24,775,817.57	0.66

（四）截止到2021年2月10日，报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(五) 截止到2021年2月10日, 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

(六) 截止到2021年2月10日, 报告期末按公允价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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 截止到2021年2月10日, 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八) 截止到2021年2月10日, 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 截止到2021年2月10日, 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

(十) 截止到2021年2月10日, 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

2、 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,576,409.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	535,791.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	480,325.14
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,592,526.60

4、 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截止到2021年2月10日, 本基金未持有可转换债券。

5、 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

6、 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《公开募集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》、《公开募集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》、《公开募集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、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

- 1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；
- 2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、 备查文件目录

(一) 中国证监会准予国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金注册的文件;

(二) 《国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(三) 《国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(四) 《国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

(五) 法律意见书

(六) 基金管理人业务资格批件和营业执照

(七) 基金托管人业务资格批件和营业执照

备查文件存放于基金管理人或基金托管人处, 投资者可在营业时间内免费查阅备查文件。在支付工本费后, 可在合理时间内取得备查文件的复印件。

风险提示: 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书和产品资料概要。敬请投资者注意投资风险。

国寿安保基金管理有限公司

2021年2月19日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人

（一）基金管理人

名称：国寿安保基金管理有限公司

住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号

法定代表人：王军辉

设立日期：2013 年 10 月 29 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2013]1308 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：12.88 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：4009-258-258

（二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

成立时间：1987 年 4 月 8 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复字（1986）175 号文、银复（1987）

86 号文

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.20 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83 号

（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，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，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。

每份基金份额具有同等的合法权益。

二、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；

(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登记机构办理基金登记业务并获得《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) 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、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(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、足额支付赎回对价；

(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；

(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；
- (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》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、基金份额净值、基金份额申购、赎

回对价的现金部分；

(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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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) 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对价的现金部分；

(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，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) 依法并按照基金合同和招募说明书的规定申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召集或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》、招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件；
(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) 缴纳基金认购款项和认购股票、申购对价、赎回对价及法律法规和《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) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

(10) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

(11) 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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

若以本基金为目标基金且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接

基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

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，但法律法规和中国证监会另有规定的除外：

- (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；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准（根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外）；
- (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) 终止基金上市，但因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；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额 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；
- (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、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且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) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 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重大变化；
- (5) 基金推出新业务或服务；

(6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(7) 调整基金份额类别的设置或费率水平、停止现有基金份额类别的销售、调整基金份额分类办法和规则等；

(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、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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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 30 日，在规定媒介公告。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和监管机构允许的其他方式召开，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，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二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，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基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（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或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

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，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，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三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(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，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。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基金份额持有人或其代理人所持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）通过方可做出。转换基金运作方式（基金合同另有约定的除外）、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，表面符合会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面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和代理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 日内在规定媒介上公告。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) 本部分对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，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。

四、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金收益分配原则

1、当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上，可进行收益分配；在收益评价日，基金管理人根据基金累计报酬率和标的指数累计报酬率进行计算，计算方法参见招募说明书；

2、在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配

不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值；

- 3、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 4、本基金的收益分配方式是现金分红；
- 5、本基金每一基金份额享有同等分配权；
- 6、法律法规、监管机构、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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。

（三）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，依据《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（四）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。

五、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

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、具体计算方法及支付方式见招募说明书。

如果指数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许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或在其他公告中披露基金最新适用的方法，此项调整无需召开基金份额持有人大会审议。

六、基金资产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于其他股票（包含港股通标的股票、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货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的相关规定）。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。

本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。

本基金将根据法律法规参与转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。

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。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；
- （2）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%；
- （3）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%；
- （4）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%；

(5) 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%；

(6) 本基金应投资于信用评级为 **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；

(7) 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；

(8) 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%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(9) 每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需交纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(10) 本基金持有的单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

(11) 本基金参与股指期货、国债期货交易，遵守下列投资比例限制：

1) 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%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 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%；

4) 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%；

5) 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；

6) 本基金在任何交易日日终，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%；

7) 本基金在任何交易日日终，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%；

8) 本基金所持有的债券（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约定；

9) 本基金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%；

(12) 本基金参与转融通证券出借业务，需遵守下列规定：

- 1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%；
- 2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；
- 3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；
- 4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(13) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(14) 本基金管理人管理的全部开放式基金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 15%；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 30%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

(15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%，因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(17) 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（6）、（12）、（15）、（16）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。

如果法律法规或监管部门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者承销期内承销的证券，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，遵循基金份额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。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

七、基金资产净值的计算方法及公告方式

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0.0001元，小数点后第五位四舍五入。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基金份额净值，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本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，将基金份额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。

八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（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同意后变更并公告，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执行，并自决议生效后2日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《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 个工作日内成立基金财产清算小组，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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算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，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符合《中华人民共和国证券法》规定的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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（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。

九、争议的处理和适用的法律

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任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金管理人、基金托管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》受中国法律管辖。

十、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。