

博时中证全球中国教育主题交易型开放  
式指数证券投资基金(QDII)  
上市交易公告书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2021年06月17日

公告日期：2021年06月11日

# 目 录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	1
三、基金的募集与上市交易.....	2
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	3
五、基金主要当事人简介.....	4
六、基金合同摘要.....	16
七、基金财务状况.....	16
八、基金投资组合.....	18
九、重大事件揭示.....	21
十、基金管理人承诺.....	21
十一、基金托管人承诺.....	21
十二、基金上市推荐人意见.....	22
十三、备查文件目录.....	22
附件：基金合同摘要.....	23

## 一、重要声明与提示

博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,博时基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报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。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,投资者欲了解博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的详细信息,请仔细阅读发布在本公司网站[<http://www.bosera.com/>]和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)上的本基金招募说明书、产品资料概要,及刊登在 2021 年 4 月 23 日《证券时报》上的《博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书提示性公告》。

## 二、基金概览

- 1、基金名称:博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)
- 2、基金类型:股票型证券投资基金
- 3、运作方式:交易型开放式
- 4、基金存续期限:不定期
- 5、基金简称:博时全球中国教育(QDII-ETF)
- 6、基金二级市场交易简称及交易代码  
证券简称:教育 ETF, 扩位证券简称:教育 ETF, 交易代码: 513360
- 7、截至公告日前两个工作日的基金份额总额:截至 2021 年 6 月 9 日,本基金的基金份额总额为 256,213,920.00 份。
- 8、截至公告日前两个工作日的基金份额净值:截至 2021 年 6 月 9 日,本基金的基金份额净值为 1.0003 元。
- 9、本次上市交易的基金份额总额:截至 2021 年 6 月 9 日,本次上市交易的基金份额总额为 256,213,920.00 份。

- 10、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 11、上市交易日期：2021年6月17日
- 12、基金管理人：博时基金管理有限公司
- 13、基金托管人：中国银行股份有限公司
- 14、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 15、上市推荐人：招商证券股份有限公司

### 三、基金的募集与上市交易

#### （一）本基金上市前基金募集情况

- 1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可 [2021]1141 号文。
- 2、基金运作方式：交易型、开放式。
- 4、基金合同期限：不定期。
- 5、发售日期：2021年5月10日起至2021年6月2日通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售的日期为2021年5月10日起至2021年6月2日，网上现金发售的日期为2021年5月31日起至2021年6月2日。
- 6、发售价格：1.00元人民币。
- 7、发售期限：网下现金认购发售18个工作日，网上现金认购发售3个工作日。
- 8、发售方式：投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。
- 9、发售机构

##### （1）网下现金发售直销机构

投资者可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。

##### （2）网下现金发售代理机构

中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、光大证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、长江证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中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。

##### （3）网上现金发售代理机构

具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位。

#### （二）基金合同生效

本基金自2021年5月10日起向社会公开募集，截至2021年6月2日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，此次募集的有效净认购金额为人民币256,212,000.00元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币60,977.64元。现金认购资金于2021年6月8日划入本基金托管账户，通过直销中心办理网下现金认购资金在

募集期间产生的利息于 2021 年 6 月 8 日划入本基金托管账户，网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金产生的利息于下一季度银行结息日次一工作日划入托管账户。

本基金于 2021 年 6 月 8 日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件，基金合同于 2021 年 6 月 8 日正式生效。

### （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]246 号

2、上市交易日期：2021 年 6 月 17 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

证券简称：教育 ETF，扩位证券简称：教育 ETF

5、基金二级市场交易代码：513360

6、基金申购、赎回简称：教育 ETF

7、基金申购、赎回代码：513361

投资者应当在本基金指定的一级交易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。

8、本次上市交易的基金份额总额：256,213,920.00 份（截至 2021 年 6 月 9 日）。

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。

8、基金资产净值的披露：在本基金上市交易并开始办理基金份额申购赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即 2021 年 6 月 9 日，本基金份额持有人户数为 2,715 户，平均每户持有的基金份额为 94,369.77 份。

### （二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2021 年 6 月 9 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 110,948,920 份，占基金总份额的 43.30%；个人投资者持有的基金份额为 145,265,000 份，占基金总份额的 56.70%。

(三) 前十名基金份额持有人的情况：

截至公告日前两个工作日即 2021 年 6 月 9 日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

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	华泰证券股份有限公司	20,000,000.00	7.81%
2	国泰君安期货有限公司	20,000,000.00	7.81%
3	金元顺安基金—南京银行—海通证券股份有限公司	10,000,000.00	3.90%
4	首创证券股份有限公司	8,000,000.00	3.12%
5	中国中金财富证券有限公司	8,000,000.00	3.12%
6	华宝证券有限责任公司	7,999,960.00	3.12%
7	东兴证券股份有限公司	7,999,960.00	3.12%
8	中信证券股份有限公司	7,800,000.00	3.04%
9	招商证券股份有限公司	7,000,000.00	2.73%
10	方正证券股份有限公司	7,000,000.00	2.73%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### 一、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层

办公地址： 广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层

法定代表人： 江向阳

成立时间： 1998 年 7 月 13 日

注册资本： 2.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 韩强

联系电话：（0755）8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；上海汇华实业有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设两大总部和三十四个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部以及宏观策略部、交易部、指数与量化投资部、多元资产管理部、年金投资部、绝对收益投资部、基础设施投资管理部、综合解决方案业务部、产品规划部、销售管理部、客户服务中心、市场部、养老金业务中心、战略客户部、机构-北京、机构-上海、机构-南方、券商业务部、零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部、零售-中部、央企业务部、互联网金融部、财富管理部、董事会办公室、办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、特定资产管理部、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责公司权益类特定资产专户和权益类社保投资组合的投资管理及相关工作。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、指数与创新组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。

市场部负责市场竞争分析、市场政策的拟订；牵头组织落实公司总体市场战略，协同产品和投资体系以及机构业务团队的协同；拟订年度市场计划和费用预算，具体负责机构业务的绩效考核和费用管理；机构产品营销组织和销售支持；专户业务中台服务与运营支持等工作。战略客户部集中服务国有银行、政策性银行、大型头部保险公司、中央汇金公司等重要金融机构。机构-北京负责北方地区其他银行、保险和财务公司等机构业务。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务中心负责公司社保基金、企业年金、基本养老金及职业年金的客户拓展、销售与服务、养老金研究与政策咨询、养老金销售支持与中台运作协调、相关信息服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务、大宗交易业务、融券业务、做市商业业务、股指期货业务等工作。零售-北京、零售-上海、零售-南方、零售-西部、零售-中部负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。央企业务部负责招商局集团签约机构客户、重要中央企业及其财务公司等客户的拓展、合作业务落地与服务等工作。销售管理部负责总行渠道维护，

零售产品营销组织、销售督导；营销策划及公募销售支持；营销培训管理；渠道代销支持与服务；零售体系的绩效考核与费用管理等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。指数与量化投资部负责公司各类指数与量化投资产品的研究和投资管理。多元资产管理部负责公司的基金中基金投资产品的研究和投资管理。年金投资部负责公司所管理企业年金等养老金资产的投资及相关工作。绝对收益投资部负责公司绝对收益产品的研究和投资管理。基础设施投资管理部负责公司所管理基础设施资产的投资管理、项目运营、内部控制、风险管理及相关工作。综合解决方案业务部负责通过 FOF/MOM 主动管理资产配置，为客户量身定制跨一二级市场解决方案，同时负责主动管理资产的投资管理、产品运营、内部控制、风险管理等工作。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计、重要政府部门、监管部门以及交易所、外汇交易中心等证券市场重要主体的关系维护等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。财富管理部负责高端客户的理财服务与销售。客户服务中心负责电话咨询与服务；网络咨询与服务；电话呼出业务；营销数据分析统计、直销柜台业务等工作。

董事会办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究、公司文化建设；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。办公室负责公司的行政后勤支持、会议及文件管理、外事活动管理、档案管理、工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT 系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

另设北京分公司和上海分公司，分别负责对驻京、沪人员日常行政管理和对赴京、沪、处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司博时资本管理有限公司，以及境外子公司博时基金（国际）有限公司。

截止到 2021 年 3 月 31 日，公司总人数为 671 人，其中研究员和基金经理超过 90% 拥有硕士及以上学位。



公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

## （二）主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

江向阳先生，博士。中共党员，南开大学国际金融博士，清华大学金融媒体 EMBA。1986-1990年就读于北京师范大学信息与情报学系，获学士学位；1994-1997年就读于中国政法大学研究生院，获法学硕士学位；2003-2006年，就读于南开大学国际经济研究所，获国际金融博士学位。1997年8月至2014年12月就职于中国证监会，历任办公厅、党办副主任兼新闻办（网信办）主任；中国证监会办公厅副巡视员；中国证监会深圳专员办处长、副专员；中国证监会期货监管部副处长、处长。2015年1月至7月，任招商局金融集团副总经理、博时基金管理有限公司党委副书记。2015年7月至2020年10月任博时基金管理有限公司总经理。自2020年1月9日至2020年4月15日代为履行博时基金董事长职务。自2020年4月1日起任博时基金管理有限公司党委书记。自2020年4月15日起，任博时基金管理有限公司董事长。

苏敏女士，分别于1990年7月及2002年12月获得上海财经大学金融专业学士学位和中国科学技术大学工商管理硕士学位。苏女士分别于1998年6月、1999年6月及2008年6月获中国注册会计师协会授予的注册会计师资格、中国资产评估协会授予的注册资产评估师资格及安徽省人力资源和社会保障厅授予的高级会计师职称。苏女士拥有管理金融类公司及上市公司的经验，其经验包括：自2015年9月及2015年12月起任招商局金融集团有限公司总经理及董事；自2016年6月起任招商证券股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600999；香港联交所上市公司，股票代码：6099）董事；自2014年9月起担任招商银行股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600036；香港联交所上市公司，股票代码：3968）董事。自2016年1月至2018年8月任招商局资本投资有限责任公司监事；自2015年11月至2018年8月任招商局创新投资管理有限公司董事；自2015年11月至2017年4月任深圳招商启航互联网投资管理有限公司董事长；自2013年5月至2015年8月任中远海运能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：600026；香港联交所上市公司，股票代码：1138）董事；自2013年6月至2015年12月任中远海运发展股份有限公司（上海证券交易所上市公司，股票代码：601866；香港联交所上市公司，股票代码：2866）董事；自2009年12月至2011年5月担任徽商银行股份有限公司（香港联交所上市公司，股票代码：3698）董事；自2008年3月至2011年9月担任安徽省皖能股份有限公司（深圳证券交易所上市公司，股票代码：000543）董事。苏女士亦拥有会计等相关管理经验，其经验包括：自2011年3月至2015年8月担任中国海运（集团）总公司总会计师；自2007年5月至2011年4月担任安徽

省能源集团有限公司总会计师，并于 2010 年 11 月至 2011 年 4 月担任该公司副总经理。自 2018 年 9 月 3 日起，任博时基金管理有限公司董事。

高阳先生，中共党员，经济学硕士，CFA，总经理。1998 年 7 月至 2000 年 2 月在中国国际金融股份有限公司任销售交易部经理。2000 年 3 月至 2008 年 2 月在博时基金管理有限公司历任债券组合经理、固定收益部总经理、基金经理、股票投资部总经理。2008 年 8 月至 2021 年 1 月在鹏华基金管理有限公司工作，2008 年 12 月至 2021 年 1 月在在鹏华基金管理有限公司任副总经理。自 2021 年 2 月 5 日起，任博时基金管理有限公司总经理。自 2021 年 4 月 7 日起，任博时基金管理有限公司第八届董事会董事。

姚俊先生，博士。1993 年至 1997 年在华南理工大学学习，获双学士学位。1997 年至 2000 年在华南理工大学工商管理专业学习，获硕士学位。2002 年 9 月至 2005 年 7 月在华南理工大学管理专业学习，获得博士学位。2000 年 6 月至 2002 年 8 月任广东电信广州分公司业务部业务主管。2005 年 9 月至 2007 年 7 月，招商局集团博士后工作站任博士后研究员。2007 年 8 月至 2014 年 5 月，任招商证券研究发展中心分析师。2014 年 6 月至 2015 年 6 月任招商证券研究发展中心二部总经理助理。2015 年 6 月至 2016 年 7 月任招商证券研究发展中心二部副总经理（主持工作）。2016 年 7 月至 2020 年 3 月任招商证券研究发展中心二部总经理。2020 年 3 月至今任招商证券财富管理及机构业务总部财富管理部总经理。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

何翔先生，北京大学财务学专业学士。1995 年 7 月至 2000 年 2 月任中国农业银行广西分行国际业务部科员、副科长。2000 年 2 月至 2012 年 2 月任中国长城资产管理公司南宁办事处副科长、科长、副处长、高级经理。2012 年 2 月至 2014 年 12 月，任中国长城资产管理公司乌鲁木齐办事处总经理助理、副总经理；2014 年 12 月至 2018 年 2 月，任中国长城资产管理公司广西分公司副总经理。2018 年 2 月至 2019 年 8 月中国长城资产管理股份有限公司资金管理部副总经理。2019 年 8 月至今，任中国长城资产管理股份有限公司投资投行部（资产经营三部）副总经理。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

李楚楚女士，香港注册会计师。2008 年以全额奖学金被香港中文大学录取，并获得工商管理学士学位。2012 年起加入毕马威香港办公室审计部门，为大型企业提供上市财务、审计、商业咨询及资本市场服务；2014 年起，调入毕马威香港办公室咨询部门，历任高级顾问和咨询经理，参与了众多并购、上市、尽职调查、公司治理、合规管理、风险管理等项目，积累了丰富的行业知识及企业运营管理经验。2017 年，加入上海信利股份投资基金管理有限公司并工作至今，历任投资经理、投资总监、董事等职，同时兼任上海汇华实业有限公司投资总监和上海盛业股权投资基金有限公司监事，负责股权投资项目管理。李女士在私募股权投资、投后管理等方面拥有丰富的经验，领导并管理了多个行业的投资，包括金融服

务（保险、资产管理、金融科技等）、医疗保健、消费与零售、新能源与环境、科技与媒体通信等。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司董事。

姜立军先生，1955 年生，会计师，工商管理硕士（MBA）。1974 年 12 月参加工作，历任中国远洋运输总公司财务处科员、中国-坦桑尼亚联合海运服务公司财务部经理、日本中铃海运服务公司财务部经理、中远（英国）公司财务部经理、香港益丰船务公司财务部经理、香港-佛罗伦租箱公司（香港上市公司）副总经理、中远太平洋有限公司（香港上市公司）副总经理、中远日本公司财务部长和营业副本部长、中远集装箱运输有限公司副总会计师等职。2002.8-2008.7，任中远航运股份有限公司（A 股上市公司）首席执行官、董事。2008.8-2011.12，任中远投资（新加坡）有限公司（新加坡上市公司）总裁、董事会副主席、中远控股（新加坡）有限公司总裁；并任新加坡中资企业协会会长。2011.11-2015.12，任中国远洋控股股份有限公司执行（A+H 上市公司）执行董事、总经理。2012.2-2015.12，兼任中国上市公司协会副监事长、天津上市公司协会副会长；2014.9-2015.12，兼任中国上市公司协会监事会专业委员会副主任委员。自 2017 年 11 月 3 日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

赵如冰先生，1956 年生，教授级高级工程师，国际金融专业经济学硕士研究生。赵如冰先生历任葛洲坝水力发电厂工程师、高级工程师、葛洲坝二江电厂电气分厂主任、书记；1989.09—1991.10 任葛洲坝至上海正负 50 万伏超高压直流输电换流站书记兼站长，主持参加了我国第一条直流输电工程的安装调试和运行。1991.10—1995.12 任厂办公室主任兼外事办公室主任。1995.12—1999.12，赵如冰先生任华能南方开发公司党组书记、总经理，兼任中国华能集团董事、深圳南山热电股份有限公司（上市公司代码 0037）副董事长、长城证券有限责任公司副董事长、深圳华能电讯有限公司董事长。2000.01-2004.07，华能南方公司被国家电力公司重组后，任华能房地产开发公司副总经理，长城证券有限责任公司副董事长。2004.07-2009.03，赵如冰先生任华能房地产开发公司党组书记、总经理。2009.12-2016.8，赵如冰先生任景顺长城基金管理公司董事长、景顺长城资产管理（深圳）公司董事长兼长城证券公司党委副书记。2016.8-2020.03，赵如冰先生任阳光资产管理股份有限公司副董事长；2016.8-至今，任西南证券、百隆东方独立董事，2020.03-至今深圳市深粮控股股份有限公司独立董事。自 2017 年 11 月 3 日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

宋子洲先生，1960 年生，中国保险资产管理业协会金融科技委员会主任委员。历任中国人寿保险公司稽核部制度处处长、资金运用部财会监督处处长、资金运用中心副总经理，中国人寿资产管理有限公司风险管理及合规部总监、首席风险官、副总裁。从事保险资金投资管理工作 20 余年，在保险资产管理公司的投资、运营、风险管理等方面积累了丰富的经验。自 2020 年 12 月 8 日起，任博时基金管理有限公司独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

何敏女士，1975年出生，中南财经大学会计学硕士。1999年7月至2006年4月任招商证券股份有限公司财务部会计核算岗，2006年4月至2009年4月任招商证券股份有限公司财务部总经理助理，2009年4月至2019年2月任招商证券股份有限公司财务部副总经理，2019年2月至今任招商证券股份有限公司财务部总经理。自2019年4月10日起，任博时基金管理有限公司监事会主席。

蒋伟先生，硕士。2011年3月至2017年5月就职于中国长城资产管理公司，分别任办公室外事处一级业务员、业务副主管、业务主管。2017年5月至2020年7月就职于长城罗斯基金管理有限公司任行政总监/执行董事。2020年7月至今任中国长城资产管理股份有限公司资产经营三部副高级经理（处室负责人）。

赵兴利先生，硕士。1987年至1995年就职于天津港务局计财处。1995年至2012年5月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港（集团）公司委派货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012年5月至2020年6月就职于天津港（集团）有限公司金融事业部副部长，天津港（集团）有限公司计财部副部长。2020年6月至今任天津港（集团）有限公司专职董监事。自2013年3月起，任博时基金管理有限公司监事。

严斌先生，硕士。1997年7月起先后在华侨城集团公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司财务部总经理。自2015年5月起，任博时基金管理有限公司监事。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005年加入博时基金管理有限公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理、固定收益总部董事总经理、年金投资部总经理、公司总经理助理。现任公司首席资产配置官兼社保组合投资经理。自2016年3月18日起，担任博时基金管理有限公司监事。

车宏原先生，工学硕士。1985年至1989年在四川大学计算机系学习，获得学士学位。1989年至1992年在清华大学计算机系学习，获得硕士学位。1992年至1995年深圳市天元金融电子有限公司任技术部负责人，1995年至2000年在中国农业银行总行南方软件开发中心担任副总工程师，2001年至2003年在太极华清信息系统有限公司担任副总经理，2003年至2014年在景顺长城基金管理有限公司担任信息技术总监，2014年至2015年任中财国信（深圳）有限公司总经理，2015年至今担任博时基金管理有限公司信息技术部总经理。

### 3、高级管理人员

江向阳先生，简历同上。

高阳先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司CAD与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理。现任公司副总经理、首席信息官，主管IT、指数与量化投资、养老金、基金零售等工作，兼任博时基金(国际)有限公司及博时资本管理有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理管理工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监、社保组合投资经理。现任公司副总经理兼首席固定收益投资官、兼任博时基金(国际)有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

徐卫先生，硕士，副总经理。1993年起先后在深圳市证券管理办公室、中国证监会、摩根士丹利华鑫基金工作。2015年6月加入博时基金管理有限公司，现任公司副总经理兼博时资本管理有限公司董事、博时基金(国际)有限公司董事会主席。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长，兼任博时基金(国际)有限公司董事、博时资本管理有限公司副董事长。

#### 4、本基金基金经理

万琼女士，硕士。2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国A股指数证券投资基金(2017年9月29日-2019年9月5日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日-2019年10月11日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日-2019年10月11日)的基金经理。现任上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日一至今)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日一至今)、博时标普500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年10月8日一至今)、博时标普500交易型开放式指数证券投资基金(2015年10月8日一至今)、博时中证500交易型开放式指数证券投资基金(2019年8月1日一至今)、博时中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019年12月30日一至今)、博时中证可持续发展100交易型开放式指数证券投资基金(2020年1月19日一至今)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020年3月20日一至今)、博时沪深300交易型开放式指数证券投资基金(2020年4月3日一至今)、博时恒生沪深港大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020年4月30日一至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年3月18日一至今)、博时创业板指数证券投资基金(2021年4月2日一至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资

基金(2021年5月11日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021年5月17日—至今)的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

委员：高阳、邵凯、黄健斌、邵佳民、张龙、魏凤春、过钧、曾鹏、黄瑞庆、金晟哲  
高阳先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

黄健斌先生，简历同上。

邵佳民先生，硕士。1997年起先后在海通证券、海富通基金、中国人寿养老保险股份有限公司、平安资产管理公司工作。2021年加入博时基金管理有限公司，现任公司首席年金投资官。

张龙先生，硕士。1996年起先后在长江证券、长盛基金、华夏基金、北京金百朋投资管理有限公司工作。2019年加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部总经理、公司投资决策委员会专职委员，现任公司首席权益投资官。

魏凤春先生，博士。1993年起先后在山东经济学院、江南信托、清华大学、江南证券、中信建投证券工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时抗通胀增强回报证券投资基金(2015年8月24日-2016年12月19日)、博时平衡配置混合型证券投资基金(2015年11月30日-2016年12月19日)的基金经理、多元资产管理部总经理、博时颐泽稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）(2019年3月20日—2020年9月3日)、博时颐泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）(2019年8月28日—2020年9月3日)的基金经理。现任首席宏观策略分析师兼宏观策略部总经理。

过钧先生，硕士。1995年起先后在上海工艺品进出口公司、德国德累斯顿银行上海分行、美国Lowe's食品有限公司、美国通用电气公司、华夏基金固定收益部工作。2005年加入博时基金管理有限公司。历任博时稳定价值债券投资基金(2005年8月24日-2010年8月4日)基金经理、固定收益部副总经理、博时转债增强债券型证券投资基金(2010年11月24日-2013年9月25日)、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金(2013年2月1日-2014年4月2日)、博时裕祥分级债券型证券投资基金(2014年1月8日-2014年6月10日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2013年9月13日-2015年7月16日)、博时新财富混合型证券投资基金(2015年6月24日-2016年7月4日)、博时新机遇混合型证券投资基金(2016年3月29日-2018年2月6日)、博时新策略灵活配置混合型证券投资基金(2016年8月1日-2018年2月6日)、博时稳健回报债券型证券投资基金（LOF）(2014年6月10日-2018年4月23日)、博时双债增强债券型证券投资基金(2016年10月24日-2018年5月5日)、博时鑫润灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2018年5月21日)、博时鑫和灵活配置混合型证券投资基金(2017年12月13日-2018年6月16日)、博时鑫惠灵活配置混合型证券投资基金(2017年1月10日-2018年7月30日)的基金经理、固定收

益总部公募基金组负责人、博时新价值灵活配置混合型证券投资基金(2016年3月29日-2019年4月30日)、博时乐臻定期开放混合型证券投资基金(2016年9月29日-2019年10月14日)、博时转债增强债券型证券投资基金(2019年1月28日-2020年4月3日)、博时鑫源灵活配置混合型证券投资基金(2016年9月6日-2020年7月20日)、博时新起点灵活配置混合型证券投资基金(2016年10月17日-2020年7月20日)、博时鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月10日-2020年7月20日)、博时中债3-5年国开行债券指数证券投资基金(2019年7月19日-2020年10月26日)的基金经理。现任公司董事总经理兼固定收益总部指数与创新组负责人、博时信用债券投资基金(2009年6月10日一至今)、博时新收益灵活配置混合型证券投资基金(2016年2月29日一至今)、博时中债3-5年进出口行债券指数证券投资基金(2018年12月25日一至今)、博时双季鑫6个月持有期混合型证券投资基金(2021年1月20日一至今)的基金经理。

曾鹏先生，硕士。2005年起先后在上投摩根基金、嘉实基金从事研究、投资工作。2012年加入博时基金管理有限公司。历任投资经理、博时灵活配置混合型证券投资基金(2015年2月9日-2016年4月25日)基金经理。现任公司董事总经理兼权益投资总部一体化投研总监、权益投资主题组负责人、博时新兴成长混合型证券投资基金(2013年1月18日一至今)、博时特许价值混合型证券投资基金(2018年6月21日一至今)、博时科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(2019年6月27日一至今)、博时科技创新混合型证券投资基金(2020年4月15日一至今)、博时沪港深优质企业灵活配置混合型证券投资基金(2021年1月20日一至今)、博时新兴消费主题混合型证券投资基金(2021年1月20日一至今)、博时港股通领先趋势混合型证券投资基金(2021年2月9日一至今)的基金经理。

黄瑞庆先生，博士。2002年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013年加入博时基金管理有限公司，历任股票投资部ETF及量化组投资副总监、基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长混合基金（2015.2.9-2016.10.24）、博时价值增长贰号混合基金（2015.2.9-2016.10.24）、博时特许价值混合基金（2015.2.9-2018.6.21）的基金经理。现任指数与量化投资部总经理兼博时量化平衡混合基金（2017.5.4-至今）、博时量化多策略股票基金（2018.4.3-至今）、博时量化价值股票基金（2018.6.26-至今）的基金经理。

金晟哲先生，硕士。2012年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、资深研究员、博时睿利定增灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月28日-2017年12月1日)、博时睿益定增灵活配置混合型证券投资基金(2017年2月28日-2018年2月22日)、博时睿益事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2018年2月23日-2018年8月13日)、博时睿丰灵活配置定期开放混合型证券投资基金(2017年3月22日-2018年12月8日)的基金经理、研究部副总经理。现任研究部副总经理（主

持工作)兼博时鑫泽灵活配置混合型证券投资基金(2016年10月24日一至今)、博时价值增长证券投资基金(2017年11月13日一至今)、博时睿利事件驱动灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(2017年12月4日一至今)、博时主题行业混合型证券投资基金(LOF)(2020年5月13日一至今)、博时荣泰灵活配置混合型证券投资基金(2020年8月26日一至今)、博时恒泰债券型证券投资基金(2021年4月22日一至今)的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人情况

### (一) 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### (三) 证券投资基金托管情况

截至2021年3月31日，中国银行已托管932只证券投资基金，其中境内基金888只，QDII基金44只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基



金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

### 三、上市推荐人

公司	招商证券股份有限公司
注册地址：	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址：	深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼
法定代表人：	霍达
联系人：	黄婵君
电话：	0755-82943666
传真：	0755-83734343
客户服务电话：	4008881111；95565
网址：	<a href="http://www.newone.com.cn/">http://www.newone.com.cn/</a>

### 四、一级交易商

目前，本基金一级交易商名单如下：

安信证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、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、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

#### 五、基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：张振波、沈兆杰

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

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。

### （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

截至公告前两个工作日即 2021 年 6 月 9 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资 产	本报告期末
	2021 年 6 月 9 日

资 产：	
银行存款	256,213,920.00
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	
其中：股票投资	8,014,722.00
债券投资	
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	64,039.58
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	264,292,681.58
负债和所有者权益	
负 债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	8,000,493.00
应付赎回款	
应付管理人报酬	3,510.62
应付托管费	1,053.19
应付销售服务费	
应付交易费用	5,850.24
应交税费	
应付利息	
应付利润	

其他负债	483.10
负债合计	8,011,390.15
所有者权益：	
实收基金	256,213,920.00
未分配利润	67,371.43
所有者权益合计	256,281,291.43
负债和所有者权益总计	264,292,681.58

注：截至 2021 年 6 月 9 日，基金份额净值 1.0003 元，基金份额总额 256,213,920.00 份。

## 八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2021 年 6 月 9 日，本基金的投资组合情况如下：

### （一）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		
	其中：股票	8,014,722.00	3.03
2	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
5	银行存款和结算备付金合计	256,213,920.00	96.94
6	其他资产	64,039.58	0.03
7	合计	264,292,681.58	100.00

注：本基金目前仍处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

### （二）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比

			例 (%)
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	1441573.00	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	328040.00	0.13
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	2623634.00	1.02
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	3445018.00	1.34
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业	176457.00	0.07
S	综合		
	合计	8,014,722.00	3.03

(三) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	002607 SZ	中公教育	108,400.00	2913792.00	1.1370
2	002230 SZ	科大讯飞	16,900.00	999635.00	0.3901
3	002841 SZ	视源股份	7,600.00	973180.00	0.3797
4	002261 SZ	拓维信息	51,600.00	492780.00	0.1923
5	600868 SH	梅雁吉祥	111,200.00	328040.00	0.1280
6	300010 SZ	豆神教育	40,700.00	251526.00	0.0981
7	300248 SZ	新开普	22,600.00	215604.00	0.0841
8	603377 SZ	东方时尚	17,900.00	204239.00	0.0797
9	600636 SH	国新文化	18,300.00	195810.00	0.0764
10	002093 SZ	国脉科技	29,500.00	186440.00	0.0727

(四) 按券种分类的债券投资组合

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有债券。

(五) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有债券。

(六) 按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 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

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有贵金属。

(八) 按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有权证。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有股指期货。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、本报告期内，本基金投资的前十名证券中除豆神教育(300010 SZ)、东方时尚(603377 SZ)的发行主体外，没有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。

2021 年 4 月 27 日，因存在未及时披露公司重大事项,未依法履行其他职责的违规行为，深圳证券交易所对豆神教育科技（北京）股份有限公司处以出具监管函的行政处罚。

2021 年 3 月 8 日，因存在未按照规则要求合理安排每日股份回购数量，回购数量超过规定限额的违规行为，上海证券交易所对东方时尚驾驶学校股份有限公司处以监管关注的行政处罚。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

2、本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下：

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收利息	64,039.58
4	其他资产	
5	合计	64,039.58

4、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金未持有可转换债券。

#### 5、本报告期前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2021 年 6 月 9 日，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

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

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

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《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；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为招商证券股份有限公司。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》规定的有关条件；
- 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) 中国证监会准予博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的文件

(二) 《博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》

(三) 《博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)托管协议》

(四) 《博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书》

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 法律意见书

(八) 中国证监会要求的其他文件

存放地点：备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

博时基金管理有限公司

2021年06月11日



## 附件：基金合同摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

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。

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）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会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）交纳基金认购款项、申购对价及法律法规和《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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

(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和转融通证券出借业务；

(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、期货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、转托管、定期定额投资、收益分配、开通人民币之外的其他币种的申购、赎回或者本基金的场外申购、赎回等方面的业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的相关费率结构和收费方式；

(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价格、申购对价、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，确定基金份额申购、赎回对价，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，但监管机构、司法机关等有权机关要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

(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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

(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；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

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

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

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权呈报中国证监会，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) 选择、更换或撤销境外托管人并与之签署有关协议；

(8) 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（或委托境外托管人保管）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，但监管机构、司法机关等有权机关要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

(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；

(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 20 年以上，法律法规或监管规则另有规定的除外；

(12) 从基金管理人处接收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) 选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责；境外托管人依据基金财产投资地法律法规、监管要求、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人之间的主次托管协议持有、保管基金财产，并履行资金清算等职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致基金财产受损的，基金托管人承担相应责任。在判断境外托管人是否存在过错、疏忽等不当行为时，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议适用法律及当地的法律法规、证券市场规则与惯例决定；

(23) 资金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有，现金存入资金账户时构成境外托管人的等额债务，基金份额持有人不对该现金资产享有优先求偿权，除非法律法规及撤销或清盘程序明文规定该等现金不归于清算财产外。境外托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘或破产等原因进行终止清算时，除非在相关法律法规强制要求下，不得将托管资产项下的证券、非现金资产归入其清算资产；

(24) 按规定向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

(25) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

(26) 基金托管人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(27) 按照《托管协议》的约定将公司行为信息通知基金管理人；

(28) 法律法规及中国证监会、外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，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 ETF，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致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或者委派代表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，联接基金基金份额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、除法律法规、中国证监会和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：

- (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；
- (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；
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 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情形除外；
- (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、调低赎回费率或变更收费方式或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整；

(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) 基金管理人、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则（包括申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；

(6) 经履行相关程序后，基金推出新业务或服务；

(7) 本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回；

(8) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(9) 进行基金份额的拆分与合并；

(10) 调整基金销售币种；

(11) 在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、在其他证券交易所上市；

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

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信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，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。除法律法规、监管机构另有规定或《基金合同》另有约定外,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按规定在规定媒介上公告。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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内

容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，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。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；
- 3、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率（经汇率调整后）达到 0.01%以上时，可进行收益分配；
- 4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率（经汇率调整后）为原则进行收益分配。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除息后的基金份额净值低于面值；
- 5、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 6、法律法规、监管机关、证券交易所或基金登记机构另有规定的，从其规定。

在不违反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，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。

#### （二）基金收益分配比例及金额的确定原则

- 1、在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率、标的指数同期增长率。

基金收益评价日本基金相对标的指数的超额收益率=基金份额净值增长率-标的指数同期增长率。

基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日的指数收盘价之比减去 1 乘以 100%。

期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算上述指标。

收益评价日日期以本基金管理人相关公告为准。

- 2、根据前述收益分配原则计算截至基金收益评价日本基金的份额可分配收益，并确定收益分配比例。
- 3、根据前述可供分配利润及收益分配比例计算收益分配金额。

#### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （四）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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### （五）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。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费（含境外托管人的托管费）；
- 3、基金的证券、期货、期权、基金等交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（含 out-of-pocket fee）；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、公证费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用、账户开户及维护费用、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 10、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 11、代表基金投资或其他与基金投资活动有关的费用；
- 12、基金依照有关法律法规应当缴纳或预提的任何税收、征费及相关的利息、费用和罚金，以及直接为处理基金税务事项产生的税务代理费；
- 13、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（简称“税收”），及基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- 14、其他为基金的利益而产生的费用；
- 15、因更换境外托管人而进行的资产转移所产生的费用；
- 16、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

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

基金管理费每日计提，按月支付。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月初 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 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 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。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月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、除管理费和托管费，根据有关法规及相应协议规定，基金费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、指数许可使用费；
- 5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）基金税收

本基金支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 五、基金资产的投资范围和投资限制

### （一）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。

为了更好地实现投资目标，本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具，其中境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF）；依法发行上市的内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联

合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证（包括全球存托凭证、美国存托凭证等）、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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；其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。未来如果证券投资基金成为互联互通机制标的，则本基金可直接参与，无需召开基金份额持有人大会。

境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、国债期货、股指期货、股票期权、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）、债券回购、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人可以将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金投资标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例会做相应调整。

## （二）投资限制

### 一）组合限制

#### 1、本基金境内投资应遵循以下限制：

（1）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%；

（2）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%；

（3）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%；

（4）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%；



(5) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(6) 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;

(7) 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, 债券回购到期后不得展期;

(8) 本基金参与融资的, 在任何交易日日终, 本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;

(9) 本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求:

1) 出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%, 出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

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不符合本条规定的, 基金管理人不得新增出借业务;

(10) 基金因未平仓的股票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%; 开仓卖出认购股票期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽股票期权的, 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股票期权保证金的现金等价物; 未平仓的股票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;

(11) 本基金参与股指期货和国债期货交易, 需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%; 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%;

2) 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 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%; 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%;

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%; 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%;

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有关约定; 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;

(12) 本基金投资流通受限证券, 基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度, 防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(13) 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该比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(14) 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本基金合同约定的投资范围保持一致;

(15) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;

(16) 本基金每个交易日日终在扣除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;

(17) 本基金投资境内发行的存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行, 与境内上市交易的股票合并计算;

(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。

除第(5)、(9)、(13)、(14)、(16)条外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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。

2、本基金境外投资应遵循以下限制:

(1) 投资比例限制

1) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%, 其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行, 但在基金托管账户的存款可以不受上述限制;

2) 基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%, 其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%;

3) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或《基金合同》规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产;

4) 基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。持有货币市场基金可以不受上述限制;

5) 基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金, 不得超过该境外基金总份额的 20%;

6) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%;

#### (2) 金融衍生品投资限制

基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理, 不得用于投机或放大交易, 投资于境外金融衍生品的, 同时应当严格遵守下列规定:

1) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

2) 基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

3) 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品, 应当符合以下要求:

①所有参与交易对手方(中资商业银行除外)应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值, 并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

4) 基金拟投资衍生品, 基金管理人在产品募集申请中应当向中国证监会提交基金投资衍生品的风险管理流程、拟采用的组合避险、有效管理策略。

5) 基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

6) 基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

(3) 本基金可以参与境外证券借贷交易, 并且应当遵守下列规定:

1) 所有参与交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4) 除中国证监会另有规定外, 担保物可以是以下金融工具或品种:

①现金;

②存款证明;

③商业票据;

④政府债券;

⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还

任一或所有已借出的证券。

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(4) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

(5) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(6) 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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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 30 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

3、本基金境内外投资均应遵循以下限制：

(1) 本基金投资标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）的资产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) 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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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 30 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

4、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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行。

## 二) 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) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。临时用途借入现金的比例超过基金资产净值的 10%；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品以及法律法规及中国证监会另有规定的除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (14) 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；
- (15) 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。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行。

## 六、基金净值信息的计算方法和公告方式

### (一) 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（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收

盘价)确定公允价值;估值日无交易的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的,应对市价进行调整,确定公允价格;

(2)交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本基金合同另有规定的除外),选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值,具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定;

(3)交易所上市交易的可转换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确定公允价值;估值日没有交易的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,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。如有充足证据表明估值日或最近交易日的收盘价不能真实反映公允价值的,应对收盘价进行调整,确定公允价格;

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;

(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,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)流通受限的股票,指在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、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),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、存托凭证估值方法

本基金投资境外存托凭证,公开挂牌的存托凭证按估值日在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值。本基金投资境内存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票执行。

4、对于首次发行未上市的境外债券按成本价估值;对于非上市境外债券,参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

对于上市流通的境外债券,境外证券交易所实行净价交易的债券按估值日在证券交易所的收盘价估值,估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;境外证券交易所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，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

#### 6、衍生品估值方法

(1) 本基金投资股指期货合约、国债期货合约，一般以估值当日结算价确定公允价值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。

(2) 本基金投资期权等衍生品，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

7、本基金参与融资或转融通证券出借业务的，将按照法律法规及行业协会的相关规定进行估值。

#### 8、汇率

本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应使用基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价或其他基金管理人与托管人协商一致的第三方数据服务商提供的汇率；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

若无法取得上述汇率价格信息时，以基金托管人或境外托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

#### 9、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

10、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方法估值。

11、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，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

## （二）基金净值信息

《基金合同》生效后，在基金份额上市交易或者开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金份额上市交易或者在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个交易日/开放日后的 2 个工作日内，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点以及其他媒介，披露交易日/开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的后的 2 个工作日内，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 七、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。对于法律法规规定和基金合同约定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方可执行，自决议生效后按规定在规定媒介公告。

### （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《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、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4、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。

5、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。

6、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剩余财产中支付。

#### (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《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20年以上，法律法规或监管规则另有规定的除外。

### 八、争议的处理

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，如不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人、基金托管人应恪守基金管理人和基金托管人的职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和基金托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和

台湾地区法律) 管辖。

#### 九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所查阅。