

# 天弘恒生沪深港创新药精选 50 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：天弘基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

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

上市时间：2021年8月9日

公告日期：2021年8月4日

# 目 录

一、重要声明与提示 .....	3
二、基金概览 .....	3
三、基金的募集与上市交易 .....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	6
五、基金主要当事人简介 .....	7
六、基金合同摘要 .....	12
七、基金财务状况 .....	12
八、基金投资组合 .....	14
九、重大事件揭示 .....	18
十、基金管理人承诺 .....	19
十一、基金托管人承诺 .....	19
十二、备查文件目录 .....	19
附件：基金合同内容摘要 .....	21

## 一、重要声明与提示

《天弘恒生沪深港创新药精选 50 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，天弘恒生沪深港创新药精选 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人天弘基金管理有限公司（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。本基金托管人海通证券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，请投资者详细查阅 2021 年 7 月 6 日刊登在天弘基金管理有限公司网站（[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《天弘恒生沪深港创新药精选 50 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：天弘恒生沪深港创新药精选 50 交易型开放式指数证券投资基金

2、基金场内简称：创新药 AH

3、申赎代码：517381

基金代码：517380

4、2021 年 8 月 2 日基金份额总额：352,326,315.00 份

5、2021 年 8 月 2 日基金份额净值：1.0050 元

6、本次上市交易份额：352,326,315.00 份

7、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

8、上市交易日期：2021年8月9日

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：海通证券股份有限公司

11、上市推荐人：海通证券股份有限公司

12、申购赎回代理券商：中信建投、国信证券、招商证券、中信证券、中信证券山东、中信证券华南、银河证券、海通证券、申万宏源、申万宏源西部、兴业证券、安信证券、华泰证券、东吴证券、方正证券、国联证券、中泰证券、恒泰证券、东兴证券、国盛证券。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商。

### 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 2021 年 3 月 31 日证监许可【2021】1089 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：本基金发售日期为 2021 年 7 月 12 日至 2021 年 7 月 21 日（周六、周日和节假日不受理）。其中，网上现金认购日期为 2021 年 7 月 19 日至 2021 年 7 月 21 日，网下现金认购和网下股票认购日期为 2021 年 7 月 12 日至 2021 年 7 月 21 日（周六、周日和节假日不受理）。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

7、发售机构：

（1）网下现金认购和网下股票认购的直销机构：天弘基金管理有限公司。

（2）网上现金认购的发售代理机构：投资者可直接通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

(3)网下现金认购的发售代理机构：中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司；

(4)网下股票认购的发售代理机构：中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为 352,326,315.00 元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 93,386.66 元人民币（含计入基金资产的网上现金认购的有效资金产生的利息）。

上述有效净认购资金已于 2021 年 7 月 27 日全部划至本基金托管人海通证券股份有限公司的基金托管账户。认购款项在募集期间产生的利息于 2021 年 9 月 22 日划入基金托管账户。

本次募集有效认购户数为 5467 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 0 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

10、基金备案情况

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《天弘恒生沪深港创新药精选 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘恒生沪深港创新药精选 50 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 7 月 27 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人开始正式管理本基金。

11、基金合同生效日：2021 年 7 月 27 日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：352,326,315.00 份。

## （二）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【2021】330号

2、上市交易日期：2021年8月9日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金场内简称：创新药AH

5、基金交易代码：517380

6、本次上市交易份额：352,326,315.00份

7、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8月2日，本基金场内份额持有人户数为5,467户，平均每户持有的基金份额为64,446.01份。

### （二）持有人结构

截至2021年8月2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66,002,185.00份，占基金总份额的18.73%；个人投资者持有的基金份额为286,324,130.00份，占基金总份额的81.27%。

### （三）截至2021年8月2日，前十名基金份额持有人的情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—翘楚3号单一资金信托	50,000,000.00	14.19%
2	上海弘尚资产管理中心（有限合伙）—弘尚科创增强一期私募证券投资基金	8,000,000.00	2.27%
3	上海磐耀资产管理有限公司—磐耀永达私募证券投资基金	5,000,000.00	1.42%
4	王亚娟	2,500,000.00	0.71%
5	何升义	2,000,000.00	0.57%

5	李松	2,000,000.00	0.57%
5	祝小江	2,000,000.00	0.57%
8	杨蕾	1,500,000.00	0.43%
9	张曰智	1,169,000.00	0.33%
10	郭翠萍	1,135,000.00	0.32%

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

#### 1、基金管理人概况

名称：天弘基金管理有限公司

法定代表人：胡晓明

总经理：郭树强

信息披露负责人：童建林

联系电话：022-83310208

注册资本：5.143 亿元人民币

注册地址：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦 A 座 1704-241 号

设立批准文号：证监基金字[2004]164 号

工商登记注册的统一社会信用代码：91120116767620408K

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事特定客户资产管理业务、中国证监会许可的其他业务。

#### 2、股权结构

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%

新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

### 3、内部组织结构及职能

本基金管理人设置了合理的组织结构，并根据业务需要进行了充足的人员配置。

本基金管理人业务部门主要分为投资研究、市场营销、风控合规、基金运营、技术保障等部门。其中，投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作；市场营销部门主要负责产品营销和市场推广等工作；风控合规主要负责公司及业务全流程合规保障、风险控制等工作；基金运营和技术保障主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。上述部门的设置为基金运作等各环节做好充分准备。

### 4、人员情况

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共有员工 567 人，其中 97%以上具有本科及以上学历。其中，高管 6 人，投研体系 132 人、市场营销部门 144 人、基金运营部 52 人、技术研发部 118 人、风控合规内审部 34 人、产品部 8 人、品牌管理部 10 人，客户服务部 13 人、大数据中心 8 人，人力财务综合 42 人。

### 5、基金管理业务介绍

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2004]164 号文批准，于 2004 年 11 月 8 日正式成立，注册资本金为 5.143 亿元人民币。公司总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司，并在北京设有子公司。自成立以来，始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人（含专户和子公司产品）资产管理总规模 11,329.16 亿元。其中，公募基金资管规模 10533.91 亿元；专户规模 339.28 亿元；子公司产品规模 455.96 亿元。截至 2021 年 6 月 30 日，共管理 117 只公募基金，业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资，以及股权、债权、其他财产权利投资等。

### 6、本基金基金经理



杨超先生，金融数学与计算硕士，11年证券从业经验。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。历任天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金经理（2019年6月至2019年9月）、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金经理（2019年6月至2019年12月）、天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理（2019年6月至2020年8月）、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2020年08月至2021年06月）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2020年03月至2021年06月）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020年02月至2021年06月）。现任本公司指数与数量投资部副总经理、基金经理。天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、天弘中证500指数增强型证券投资基金基金经理、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证科技100指数增强型发起式证券投资基金基金经理、天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金基金经理、天弘多利一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、天弘中证光伏产业指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、天弘中证科创创业50指数证券投资基金基金经理、天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

胡超先生，范德比尔特大学金融学硕士，8年证券从业经验。历任普华永道咨询（深圳）有限公司高级顾问、中合中小企业融资担保股份有限公司高级业务经理、中国人民财产保险股份有限公司海外投资业务主管。2016年6月加盟本公司，历任国际业务研究员。现任本公司基金经理。天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）基金经理、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）基金经理、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）基金经理、天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）基金经理、天弘恒生沪深港创新药精选50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：海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 30 层 3002 单元

法定代表人：周杰

成立时间：1988 年 8 月 15 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 1150170.0000 万元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2013】1643 号

联系人：郭兴邦

联系电话：021-23219000

## 2、主要人员情况

周杰先生，工学硕士，2016 年 10 月 28 日至今担任海通证券董事长，2016 年 7 月至今担任海通证券党委书记。1992 年 2 月至 1996 年 6 月在上海万国证券有限公司投资银行部工作；1996 年 6 月至 2001 年 12 月先后担任上海上实资产经营有限公司投资部经理、副总经理、董事长兼总经理；2001 年 12 月至 2003 年 4 月担任上海实业医药科技(集团)有限公司董事兼总经理；2002 年 1 月至 2016 年 7 月，先后担任上海实业控股有限公司(于香港联交所上市，股份代号:0363)执行董事兼副行政总裁、执行董事兼常务副总裁、副董事长兼行政总裁；2004 年 8 月至 2016 年 7 月，先后担任上海上实(集团)有限公司策划总监、执行董事兼副总裁、执行董事兼常务副总裁、总裁兼党委副书记；2010 年 3 月至 2012 年 5 月担任上海医药集团股份有限公司(于上交所上市，股份代号:601607；于香港联交所上市，股份代号:02607)监事长，2012 年 6 月至 2013 年 6 月、2016 年 5 月至 2016 年 7 月担任上海医药集团股份有限公司董事长兼党委书记；2009 年 1 月至今担任中芯国际集成电路制造有限公司(于纽约证券交易所上市，股份代号:SMI；于香港联交所上市，股份代号:00981)非执行董事。周先生 2016 年至今任上海证券交易所监事、薪酬委员会主任，2016 年至今任上海证券同业公会会长，2017 年至今任上海金融业联合会副理事长，2016 年至今任上海上市公司协会理事会

副会长，2016 年至今任中国互联网金融协会会员代表，2017 年至今任上海金融理财师协会会长，2017 年至今任上海市仲裁委仲裁员。

陈春钱先生，海通证券总经理助理，负责公司经纪业务。陈先生还兼任海通证券经纪业务委员会主任、国际业务协调委员会委员、战略发展与 IT 治理委员会委员和中国证券业协会证券经纪业专业委员会委员。陈先生于 1988 年 7 月获安徽财经学院经济学硕士学位并于 1995 年 7 月获厦门大学经济学博士学位，拥有 17 年的证券业工作及管理经验。1997 年 10 月至 1998 年 1 月，担任海通证券深圳分公司业务部负责人；1998 年 1 月至 2000 年 3 月，担任国际业务部副总经理；2000 年 3 月至 2000 年 12 月，担任深圳分公司副总经理；2000 年 12 月至 2006 年 5 月，担任投资管理部（深圳）总经理；2006 年 5 月至 2013 年 2 月，担任销售交易总部总经理，其间 2007 年 11 月至 2009 年 3 月兼任机构业务部总经理。

凌如水先生，海通证券基金托管部总经理，拥有证券从业资格与基金从业资格。自 1995 年已有 23 年金融从业经历。先后从事过银行证券投资、证券经纪业务管理、证券财富管理、资产托管业务管理等工作。其中 1995 年至 2001 年在交通银行绍兴分行证券部，负责证券投资业务。2001 年至 2013 年分别在海通证券上虞营业部担任总经理等职务，在此期间其管理的证券营业部连续七年荣获“十佳营业部”荣誉。2013 年至今分别在海通证券企业及私人客户部和基金托管部担任副总经理、总经理，负责公司专业机构客户财富管理业务和资产托管业务管理。

### 3、基金托管业务经营情况

海通证券于 2013 年 12 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，是国内第一家取得证券投资基金托管资格的证券公司，海通证券始终遵循“务实、开拓、稳健、卓越”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。

#### （三）上市推荐人

名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 33 楼

法定代表人：周杰

电话：021-23219275

联系人：李笑鸣

客户服务热线：95553

网址：www.htsec.com

#### （四）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：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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888

经办注册会计师：张振波、林佳璐

联系人：林佳璐

## 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 8 月 2 日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

<b>资产</b>	<b>本期末</b> <b>2021年08月02日</b>
<b>资产：</b>	
银行存款	300,547,466.33
结算备付金	14,569,642.10
存出保证金	3,346,498.82
交易性金融资产	119,864,839.63
其中：股票投资	119,864,839.63
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
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	109,269.13
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	71,677.24
资产总计	438,509,393.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2021年08月02日</b>
<b>负债：</b>	
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	84,337,158.36
应付赎回款	-
应付管理人报酬	28,965.34
应付托管费	5,793.07
应付销售服务费	-

应付交易费用	29,794.08
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	2,658.25
负债合计	84,404,369.10
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	352,326,315.00
未分配利润	1,778,709.15
所有者权益合计	354,105,024.15
负债和所有者权益总计	438,509,393.25

## 八、基金投资组合

本基金目前处于建仓期，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约定。

截至 2021 年 8 月 2 日，本基金的投资组合如下：

### 1 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	119,864,839.63	27.33
	其中：股票	119,864,839.63	27.33
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	-	-

	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	315,117,108.43	71.86
8	其他资产	3,527,445.19	0.80
9	合计	438,509,393.25	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为38,894,893.66元，占基金资产净值的比例为10.98%。

## 2 按行业分类的股票投资组合

### 2.1（指数投资）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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,371,703.45	14.51
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	3,198,243.00	0.90
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	26,399,999.52	7.46
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	80,969,945.97	22.87

## 2.2 (积极投资) 按行业分类的境内股票投资组合

截至2021年08月02日, 本基金未持有积极投资股票。

## 2.3 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	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	38,894,893.66	10.98
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
地产业	-	-
合计	38,894,893.66	10.98

注: 以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 3 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

### 3.1 指数投资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	603259	药明康德	88,400	13,507,520.00	3.81
1	02359	药明康德	20,800	2,979,487.06	0.84
2	02269	药明生物	115,500	11,635,127.54	3.29
3	600276	恒瑞医药	176,480	9,750,520.00	2.75



4	300142	沃森生物	95,000	8,250,750.00	2.33
5	600196	复星医药	75,400	6,212,206.00	1.75
5	02196	复星医药	31,500	1,849,951.22	0.52
6	300347	泰格医药	38,000	5,997,540.00	1.69
7	01801	信达生物	81,500	5,355,866.23	1.51
8	01093	石药集团	562,000	4,899,396.86	1.38
9	01177	中国生物 制药	709,000	3,945,639.24	1.11
10	002821	凯莱英	9,300	3,781,380.00	1.07

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细  
截至2021年08月02日，本基金未持有积极投资股票。

4 按债券品种分类的债券投资组合

截至2021年08月02日，本基金未持有债券。

5 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

截至2021年08月02日，本基金未持有债券。

6 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

截至2021年08月02日，本基金未持有资产支持证券。

7 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08月02日，本基金未持有贵金属。

8 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

截至2021年08月02日，本基金未持有权证。

9 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至2021年08月02日，本基金未持有股指期货。

10 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至2021年08月02日，本基金未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本基金未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 本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。

### 11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,346,498.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	109,269.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	71,677.24
8	合计	3,527,445.19

### 11.4 基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2021年08月02日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 11.5.1 指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2021年08月02日，本基金指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

#### 11.5.2 积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至2021年08月02日，本基金未持有积极投资股票。

### 11.6 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

(一) 2021年7月28日发布天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数

证券投资基金基金合同生效公告。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、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、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的公司住所和上海证券交易所，投资者可在办公时间免费查阅。

- (一) 中国证监会准予本基金募集注册的文件
- (二) 《天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (四) 《天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数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

天弘基金管理有限公司

二〇二一年八月四日

## 附件：基金合同内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利和义务

### 1、基金管理人的权利和义务

(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、法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、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

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、法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、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

回等的业务规则；

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、赎回的对价，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；

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。

## 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

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、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和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) 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。

### 3、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) 依法并按照基金合同和招募说明书的规定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) 交纳基金认购款项或认购股票、申购对价、现金差额及法律法规和《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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

在本基金成功募集并运作之后,如基金管理人管理本基金的联接基金的:

鉴于本基金和本基金联接基金的相关性,本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金联接基金的基金份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时,本基金联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金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,本基金联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金联接基金份额占本基金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。

本基金联接基金的基金管理人不应以本基金联接基金的名义代表本基金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,但可接受本基金联接基金的特定基金份额持有人的委托以本基金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。

本基金联接基金的基金管理人代表本基金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,须先遵照本基金联接基金基金合同的约定召开本基金联接基金的基金份额持有人大会,本基金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,由本基金联接基金的基金管理人代表本基金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。

### 1、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》，但基金合同另有约定的除外；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- 5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但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，但基金合同另有约定的除外；
- 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、调低赎回费率或变更收费方式；
- 3) 因相应的法律法规、相关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变化；

5) 基金推出新业务或服务;

6) 调整本基金份额类别的设置;

7) 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、基金交易、非交易过户等业务规则(包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整等);

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。

## 2、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。

### 3、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书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### 4、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)；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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。

## 5、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 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次



基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人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。

## 6、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。除基金合同另有规定外，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。

## 7、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。

## 8、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。

9、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。

### （三）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

#### 1、《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，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### 2、《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）出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求以及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

（4）《基金合同》约定的其他情形；

（5）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### 3、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《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。

#### 4、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。

#### 5、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。

#### 6、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。

## 7、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。

### （四）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。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方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》受中国法律管辖。

### （五）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。