

华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金
(FOF-LOF) A 类基金份额
上市交易公告书

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2022 年 1 月 14 日

公告日期：2022 年 1 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.....	5
五、基金主要当事人简介	6
六、基金合同摘要	9
七、基金财务状况	9
八、基金投资组合	11
九、重大事件揭示	16
十、基金管理人承诺.....	16
十一、基金托管人承诺	16
十二、基金上市推荐人意见.....	16
十三、备查文件目录.....	16
附件：基金合同摘要.....	18

一、重要声明与提示

《华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）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〉》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）（以下简称“本基金”）基金管理人华夏基金管理有限公司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。本基金托管人中国工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、深圳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，请投资者详细查阅本基金招募说明书及其更新。

二、基金概览

- 1、基金名称：华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）。
- 2、基金简称：华夏优选配置一年封闭股票（FOF-LOF）。
- 3、A类基金份额二级市场交易简称：优选配置FOF-LOF
- 4、A类基金份额二级市场交易代码：160326。
- 5、截至公告日前两个工作日即2022年1月7日基金份额数额：本基金总份额为535,585,582.83份，其中A类基金份额为510,479,079.28份（A类场内基金份额为223,830,608份），C类基金份额为25,106,503.55份。
- 6、截至公告日前两个工作日即 2022 年 1 月 7 日基金份额净值：0.9825 元（A 类）；0.9824 元（C 类）。
- 7、本次上市交易的份额为A类场内基金份额，截至2022年1月7日上市交易的A类场内基金份额数为：223,830,608份。
- 8、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
- 9、上市交易日期：2022年1月14日。
- 10、基金管理人：华夏基金管理有限公司。

11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。

12、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：中国证监会2021年9月30日证监许可[2021]3177号文。

2、基金运作方式：契约型开放式，自基金合同生效日起封闭运作一年。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2021年12月8日至2021年12月24日（含）。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售方式：本基金通过场内和场外两种方式公开发售。

（1）场内基金份额发售机构

场内发售通过具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位办理，具体名单如下：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、网信证券、五矿证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）等。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算

有限责任公司认可的深圳证券交易所会员可通过深交所交易系统办理本基金的场内认购业务。

（2）场外基金份额发售机构

中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、鼎信汇金（北京）投资管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、腾安基金销售（深圳）有限公司、北京度小满基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海长量基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、乾道基金销售有限公司、北京创金启富基金销售有限公司、泛华普益基金销售有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、浦领基金销售有限公司、通华财富（上海）基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司、海银基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、济安财富（北京）基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海中正达广基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、中证金牛（北京）基金销售有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、大连网金基金销售有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、北京雪球基金销售有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、万家财富基金销售（天津）有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、中信期货有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、东北证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、国都

证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中泰证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、五矿证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、东方财富证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、爱建证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、中天证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、阳光人寿保险股份有限公司等。

7、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

8、募集资金总额及入账情况：经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集期间净认购金额为 535,435,916.75 元人民币，认购资金在募集期间产生的利息为 150,224.22 元人民币。募集资金于 2021 年 12 月 29 日划入本基金托管账户。

9、基金备案情况：本公司募集结束后向中国证监会办理基金备案手续，并于 2021 年 12 月 30 日获中国证监会书面确认。

10、基金合同生效日：2021年12月30日。

11、基金合同生效日的基金份额总额：按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集及利息结转的基金份额共计535,585,582.83份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

（二）本基金A类基金份额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：深证上[2022]35号。

2、上市交易日期：2022年1月14日。

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

4、A类基金份额二级市场交易简称：优选配置FOF-LOF

5、A类基金份额二级市场交易代码：160326。

投资者在深圳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、截至2022年1月7日本次A类基金上市交易份额：223,830,608份。

7、未上市交易 A 类基金份额的流通规定：未上市交易的 A 类基金份额托管在场外，持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。本基金 A 类基金份额的跨系统转托管业务将自 2022 年 1 月 14 日起开通办理。

8、基金资产净值的披露：本基金 A 类基金份额上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额

净值和基金份额累计净值，并在深圳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 2022 年 1 月 7 日，本基金基金份额持有人总户数为 6,817 户，平均每户持有的基金份额为 78,566.17 份。本基金 A 类场内基金份额持有人户数为 1,601 户，平均每户持有的基金份额为 139,806.75 份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2022 年 1 月 7 日，机构投资者持有本基金 A 类场内基金份额 111,154,083 份，占场内基金总份额的 49.66%；个人投资者持有本基金 A 类场内基金份额 112,676,525 份，占场内基金总份额的 50.34%。

截至公告日前两个工作日即 2022 年 1 月 7 日，本基金管理人的从业人员未持有本基金场内基金份额，本基金管理人的从业人员持有本基金场外基金份额 10,010.44 份，占本基金总份额的 0.00%。本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基金基金份额。

（三）前十名持有人

截至公告日前两个工作日即 2022 年 1 月 7 日，本基金 A 类基金份额前十名场内基金份额持有人情况如下：

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	华夏基金管理有限公司	50,002,430.00	22.34%
2	国投安信期货有限公司	40,001,944.00	17.87%
3	银河期货有限公司	9,999,194.00	4.47%
3	中信证券股份有限公司	8,000,155.00	3.57%
5	谭晓欢	4,360,296.00	1.95%
6	刘闯	3,521,068.00	1.57%
7	王洋	2,050,179.00	0.92%
7	杜聿晦	2,000,369.00	0.89%

7	曾维云	2,000,311.00	0.89%
10	刘海冰	2,000,136.00	0.89%

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：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：杨明辉

总经理：李一梅

信息披露负责人：李彬

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

注册资本：23800万元

设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]16号

工商登记注册的法人营业执照文号：911100006336940653

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）从事特定客户资产管理业务；（五）中国证监会核准的其他业务。

2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
POWER CORPORATION OF CANADA	13.9%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	13.9%
天津海鹏科技咨询有限公司	10%
合计	100%

3、内部组织结构与人员情况

公司设置了合理的组织结构，并根据业务需要进行了合理的人员配置。

公司业务部门主要分为投研部门、风险控制部门、营销部门、后台运作部门等。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；风险控制部门主要负责投资的事

前、事中、事后风险合规监控等工作；营销部门主要负责营销和市场推广等工作；后台运作部门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。

4、基金管理业务情况

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。近 24 年来，公司秉承“为信任奉献回报”的企业宗旨，坚持以专业、严谨的投资研究为基础，为投资人提供优质的基金产品和理财服务。凭借规范的经营管理和良好的品牌声誉，公司多次荣获境内外权威奖项。

截至目前，公司旗下管理 300 只开放式基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、QDII、FOF、MOM、公募 REITs 等不同类型，建立了覆盖高中低风险等级的公募基金产品线，为各类风险偏好投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

5、本基金基金经理简介

李晓易先生，硕士。曾任中信期货有限公司资产管理部研究员、投资经理。2015年4月加入华夏基金管理有限公司，曾任资产配置部研究员，现任华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）基金经理（2019年1月24日起任职）、华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）基金经理（2021年12月30日起任职）。

郑铮先生，硕士。曾任国泰君安证券有限公司分析师、通联万达科技有限公司财务总监、长盛基金管理有限公司基金经理助理、阳光资产管理股份有限公司宏观研究员等。2014年2月加入华夏基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、基金经理助理，资产配置部研究员，华夏聚丰稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）基金经理（2018年10月23日至2021年2月9日期间）等，现任华夏聚惠稳健目标风险混合型基金中基金（FOF）基金经理（2017年11月3日起任职）、华夏养老目标日期2050五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基

金经理（2020年10月19日起任职）、华夏聚丰稳健目标风险混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理（2021年2月10日起任职）、华夏稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理（2021年3月29日起任职）、华夏博锐一年持有期混合型管理人中管理人（MOM）发起式证券投资基金基金经理（2021年9月23日起任职）、华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）基金经理（2021年12月30日起任职）。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

基金托管部门负责人：刘彤

2、基金托管部门及主要人员情况

截至 2021 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 214 人，平均年龄 34 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、证券投资基金托管情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2021 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1288 只。自 2003

年以来，本行连续十八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 80 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

法定代表人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

经办注册会计师：王珊珊、马剑英

联系人：王珊珊

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，不从基金财产中列支。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

截至公告前两个工作日即 2022 年 1 月 7 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资产	2022 年 1 月 7 日
资产：	
银行存款	44,369,522.68

结算备付金	2,251,407.47
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	329,544,364.41
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	149,983,643.85
应收证券清算款	24,534.23
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	148,653.46
资产总计	526,322,126.10
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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	77,750.45
应付托管费	19,741.82
应付销售服务费	1,918.04

应付交易费用	8,802.95
应交税费	1,398.73
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	3,260.32
负债合计	112,872.31
所有者权益：	
实收基金	535,585,582.83
未分配利润	-9,376,329.04
所有者权益合计	526,209,253.79
负债和所有者权益总计	526,322,126.10

注：截至 2022 年 1 月 7 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9825 元，C 类基金份额净值为 0.9824 元，基金份额总额为 535,585,582.83 份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2022 年 1 月 7 日（本基金合同自 2021 年 12 月 30 日起生效，本报告期自 2021 年 12 月 30 日至 2022 年 1 月 7 日），本基金的投资组合情况如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

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	-	-
2	基金投资	329,544,364.41	62.61
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	149,983,643.85	28.50
	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	46,620,930.15	8.86
8	其他各项资产	173,187.69	0.03
9	合计	526,322,126.10	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

（三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、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

本基金本报告期末未持有股票。

（四）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）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）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）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）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）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

（十一）投资组合报告附注

1、报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

2、基金投资的前十名股票未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	-
2	应收证券清算款	24,534.23
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	148,653.46
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,187.69

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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、基金中基金

（一）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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	512560	易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	107,186,400.00	84,462,883.20	16.05	否
2	512200	南方中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	63,854,400.00	53,318,424.00	10.13	否
3	159996	国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	38,899,000.00	51,074,387.00	9.71	否
4	512810	华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	32,760,500.00	48,649,342.50	9.25	否
5	515060	华夏中证全指房地产交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	26,000,000.00	27,534,000.00	5.23	是
6	515790	华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券	交易型开放式	16,372,800.00	25,115,875.20	4.77	否

		投资基金					
7	159827	银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	23,545,402.00	24,840,399.11	4.72	否
8	159805	鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式	12,520,700.00	14,549,053.40	2.76	否
9	-	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-	-

（二）当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	1,815.22	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	25,187.80	2,931.23
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	5,255.39	586.25
当期交易基金产生的交易费（元）	22,493.77	9,999.51

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，

其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

（三）本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

十、重大事件揭示

（一）2021年12月31日发布华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）基金合同生效公告。

十一、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

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

十二、基金托管人承诺

本基金基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

严格遵守《基金法》等相关法规以及《华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》、《华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）托管协议》的约定履行相关职责。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会准予华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）注册的批复

2、《华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》

- 3、《华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）托管协议》
- 4、《华夏优选配置一年封闭运作股票型基金中基金（FOF-LOF）招募说明书》及其更新
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二二年一月十一日

附件：基金合同摘要

第一部分 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

一、基金管理人

（一）基金管理人简况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲 3 号院

法定代表人：杨明辉

设立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元人民币

存续期限：100 年

联系电话：400-818-6666

（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。

（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、转换和非交易过户的业务规则。

（17）基金管理人有权根据反洗钱法律法规的相关规定，结合基金份额持有人洗钱风险状况，采取相应合理的控制措施。

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

（2）办理基金备案手续。

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产。

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产。

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资。

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产。

（7）依法接受基金托管人的监督。

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格。

- （9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。
- （10）编制季度、中期和年度报告。
- （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，因监管机构、司法机关等有权机关的要求以及向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外。
- （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、足额支付赎回款项。
- （15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会。
- （16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上。
- （17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，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，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同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

（一）基金托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

存续期间：持续经营

（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，因监管机构、司法机关等有权机关的要求以及向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外。

（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、赎回价格。

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项。

（10）对基金财务会计报告、季度报告、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。

（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款项。

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会。

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作。

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人。

（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除。

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿。

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议。

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《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。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别的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、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用。
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任。
- （6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动。
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议。
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利。
- （9）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，以及不时地更新和补充，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。

第二部分 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。基金份额持有人大会不设立日常机构。

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，法律法规、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。
- （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）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）增加、减少、调整本基金份额类别设置或调整本基金的申购费率、调低销售服务费率、赎回费率或调整收费方式。
- （3）基金管理人、登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则。
- （4）履行适当程序后，基金推出新业务或服务。
- （5）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改。
- （6）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。
- （7）在遵循本基金份额持有人利益优先原则的前提下，基金管理人应当代表本基金份额持有人的利益参与本基金持有的其他基金的基金份额持有人大会并行使相关的投票权利。但基金中基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

- （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。

3、当封闭运作期届满后，本基金将转为“华夏优选配置股票型基金中基金(FOF-LOF)”，不再以封闭方式运作，无需召开基金份额持有人大会。

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。

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会议公告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

会议公告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，监管机构另有规定的除外。

（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。

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，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。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。

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、基金合

同和中国证监会另有规定的除外）、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。

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、短信或其他方式进行表决，或者采用网络、电话、短信或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式在会议通知中列明。

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、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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督

的，不影响计票和表决结果。

八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内按照法律法规和中国证监会相关规定的要求在规定媒介上公告。

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。

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，基金管理人经与基金托管人协商一致，并履行适当程序和提前公告后，可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。

九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

- 1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10% 以上（含 10%）；
- 2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；
- 3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；
- 4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；
- 5、现场开会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；

6、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；

7、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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分相关约定。

十、基金管理人代表本基金出席本基金投资的基金的基金份额持有人大会并参与表决的特别约定

本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时，基金管理人应当代表本基金份额持有人的利益参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

十一、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

第三部分 基金收益分配原则、执行方式

一、基金收益分配原则

1、由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

2、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

3、本基金场外份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红。本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红，具体权益分派程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

5、法律法规或监管机关另有规定的，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，基金管理人可与基金托管人协商一致后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止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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

第四部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取、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。
- 3、销售服务费。
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费。
- 6、基金份额持有人大会费用。
- 7、基金的证券交易费用。
- 8、投资其他基金的费用。
- 9、基金的银行汇划费用、银行账户维护费用。
- 10、基金上市初费及年费。
- 11、基金的开户费用。
- 12、因投资港股通标的股票而产生的各项费用。
- 13、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扣除基金中本基金管理人管理的基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.80% 年费率计提。基金管理人不得对本基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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扣除基金中本基金管理人管理的基金份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 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扣除基金中本基金托管人托管的基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.20% 年费率计提。基金托管人不得对本基金财产中持有的自身托管的基金部分收取托管费。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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扣除基金中本基金托管人托管的基金份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费计算公式具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支

付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4-13 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

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的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、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、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

第五部分 基金财产的投资方向和投资限制

一、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的交易型开放式指数证券投资基金、黄金交易型开放式证券投资基金、商品期货交易型开放式证券投资基金、境内上市的定期开放式基金、封闭式基金、国内依法发行上市的股票（含创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、资产支持证券、银行存款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。

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

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票型交易型开放式指数证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票投资比例不超过股票的 50%。在封闭运作期届满

并转为开放式运作后，每个交易日日终基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人在依法履行适当程序后，可对本基金的投资比例做相应调整。

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）本基金投资于股票型交易型开放式指数证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票投资比例不超过股票的 50%。

（2）本基金持有单只基金的市值，不得高于本基金资产净值的 20%。

（3）除 ETF 联接基金外，本基金管理人管理的全部基金持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。

（4）本基金不得持有其他基金中基金。

（5）本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，中国证监会另行规定的除外。

（6）本基金投资其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于一年、最近定期报告披露的基金净资产应当不低于 1 亿元。

（7）在封闭运作期届满并转为开放式运作后，每个交易日日终基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

（8）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。

（9）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

（10）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。

（11）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%。

（12）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%。

（13）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%。

（14）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。

（15）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。

（16）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。

（17）封闭运作期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值 200%；除封闭运作期外，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%。

（18）本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的比例不得超过本基金基金资产净值的 10%。

（19）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%。

（20）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%。

（21）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。

（22）投资于货币市场基金的比例不得超过基金资产的 15%。

（23）本基金投资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。

（24）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。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外因素致使基金投资不符合前款第（2）、（3）、（4）项约定的投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

除上述（2）、（3）、（7）、（14）、（21）情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、港股通额度不足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。

本基金在封闭期届满并转为开放式运作后，基金管理人应当自转型之日起 3 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。

如果法律法规或监管部门对上述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，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定。

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）向其基金管理人、基金托管人出资。
- （5）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。
- （6）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。

本基金投资基金管理人或基金管理人关联方或基金托管人关联方管理基金的情况，不属于前述重大关联交易，但是应当按照法律法规或监管规定的要求履行信息披露义务。

法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定的，如适用于本基金，则本基金投资不再受上述相关限制，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定。

第六部分 基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后，在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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日各类基金份额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次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

第七部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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表决通过之日起生效，自决议生效后两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 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财

产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金。

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认。

（3）对基金财产进行估值和变现。

（4）制作清算报告。

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书。

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，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《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由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。

第八部分 争议解决方式

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，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则按照普通程序进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，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，各自继续忠实、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（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

第九部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》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。