

银华恒生港股通中国科技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：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市日期：2022年2月9日

公告日期：2022年1月28日

目 录

一、重要声明与提示	1
二、基金概览	2
三、基金份额的募集与上市交易	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况	7
五、基金主要当事人简介	8
六、基金合同摘要	13
七、基金财务状况	14
八、基金投资组合	16
九、重大事件揭示	19
十、基金管理人承诺	20
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	23
附件：基金合同摘要	24

一、重要声明与提示

《银华恒生港股通中国科技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，银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、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。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅发布在银华基金管理股份有限公司网站（<http://www.yhfund.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

- 1、基金名称：银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金类型：股票型证券投资基金
- 3、基金运作方式：交易型开放式
- 4、基金场内简称：科技30（基金扩位简称：港股科技30ETF）
- 5、二级市场交易代码：513160
- 6、申购、赎回代码：513161
- 7、标的指数简称：恒生港股通中国科技指数
- 8、标的指数代码：HSSCT
- 9、基金份额总额：截至2022年1月26日，本基金的基金份额总额为258189251.00份
- 10、基金份额净值：截至2022年1月26日，本基金的基金份额净值为0.9752元
- 11、本次上市交易的基金份额：258189251.00份
- 12、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 13、上市交易日期：2022年2月9日
- 14、基金管理人：银华基金管理股份有限公司
- 15、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 16、上市推荐人：广发证券股份有限公司
- 17、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 18、申购赎回代理券商（排序不分先后）：
安信证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、兴业证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、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、招商证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司。
若有新增本基金的申购赎回代理券商或上述申购赎回代理券商发生变更，基金管理人将在基金管理人网站公示。

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册文号：中国证监会证监许可【2021】1610号

2、基金合同生效日：2022年1月17日

3、运作方式：交易型开放式

4、基金合同期限：不定期

5、本基金发售日期：2021年11月5日至2022年1月12日

投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。其中，网上现金认购的日期为2022年1月10日至2022年1月12日，通过基金管理人及其指定的发售代理机构进行网下现金认购的日期为2021年11月5日至2022年1月12日。

6、发售价格：1.00元人民币

7、份额发售方式：网上现金认购、网下现金认购

8、发售机构

（1）网上现金发售代理机构：

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

（2）网下现金发售机构（排序不分先后）：

银华基金管理股份有限公司北京直销中心、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、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、中国中金财富证券有限公司、安信证券股份有限公司、中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258,185,000.00

元人民币，认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 46,624.89 元人民币。

截至 2022 年 1 月 17 日止，经登记结算机构确认的本基金募集期间通过网上现金认购的有效认购资金按账户实际适用年利率计算产生利息共计人民币 42,373.89 元，不折算为基金份额，将于最近结息日划入本基金的基金托管人招商银行股份有限公司开立的托管专户。

截至 2022 年 1 月 17 日止，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）确认的本基金募集期间通过网下现金认购的有效认购资金按账户实际适用年利率计算产生利息共计人民币 4,251.00 元，折合为 4,251.00 份基金份额，已于 2022 年 1 月 17 日划入本基金的基金托管人招商银行股份有限公司开立的托管专户。

本次募集有效认购户数为 1383 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 258189251.00 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

本基金募集备案情况：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《银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、招募说明书的有关规定，本基金募集符合有关条件，于 2022 年 1 月 17 日验资完毕，基金管理人于 2022 年 1 月 17 日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2022 年 1 月 17 日获得书面确认，本基金的基金合同自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2022 年 1 月 17 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：258189251.00 份

（二）本基金上市交易的主要内容

1、本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[2022]28号

2、上市交易日期：2022 年 2 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：科技 30

5、基金扩位简称：港股科技30ETF

6、基金二级市场交易代码：513160

7、基金申购、赎回代码：513161

8、本次上市交易份额：258189251.00份

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

10、基金净值信息的披露：在本基金上市交易后或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/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，披露交易/开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一) 基金份额持有情况

截至 2022 年 1 月 26 日, 本基金持有人户数 1, 383 户, 平均每户持有的基金份额为 186, 687. 82 份。

截至 2022 年 1 月 26 日, 基金份额合计为 258, 189, 251. 00 份, 机构投资者持有的基金份额为 221, 004, 251. 00 份, 占基金总份额的比例为 85. 60%; 个人投资者持有的基金份额为 37, 185, 000. 00 份, 占基金总份额的比例为 14. 40%。

(二) 基金份额前十名持有人情况

截至 2022 年 1 月 26 日, 本次上市交易的银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有份额	份额占比 (%)
1	华泰证券股份有限公司	20,000,000.00	7.75%
2	中信信托有限责任公司—中信信托成泉汇涌八期金融投资集合资金信托计划	15,000,000.00	5.81%
3	长江财产保险股份有限公司—委托民生银行组合	10,001,333.00	3.87%
4	中信信托有限责任公司—中信信托鑫涌成泉金融投资集合资金信托计划	10,000,000.00	3.87%
5	深圳竹芒科技有限公司	10,000,000.00	3.87%
6	方正中期期货有限公司	10,000,000.00	3.87%
7	第一创业证券股份有限公司	8,001,066.00	3.10%
8	中国国际金融股份有限公司	8,000,000.00	3.10%
9	华宝证券股份有限公司	8,000,000.00	3.10%
10	长城证券股份有限公司	8,000,000.00	3.10%
11	首创证券股份有限公司	8,000,000.00	3.10%
12	金元顺安基金—南京银行—海通证券股份有限公司	8,000,000.00	3.10%
合计		123,002,399.00	47.64%

注: 以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因, 占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

名称：银华基金管理股份有限公司

法定代表人：王珠林

总经理：王立新

设立日期：2001年5月28日

注册资本：2.222亿元人民币

住所：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦19层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2001]7号

统一社会信用代码：914403007109283569

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

股东及其出资比例：

持股单位	占总股本比例
西南证券股份有限公司	44.10%
第一创业证券股份有限公司	26.10%
东北证券股份有限公司	18.90%
山西海鑫实业有限公司	0.90%
珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）	3.57%
珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）	3.20%
珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）	3.22%

联系人：冯晶

电话：010-58163000

传真：010-58163090

2、经营概况

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日，是经中国证监会批准（证监基金字[2001]7号文）设立的全国性资产管理公司，注册资本为2.222亿元人民币。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“战略委员会”、“风险控制委员会”、“薪酬与提名委员会”、“审计委员会”四个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由4位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理一部、多资产投资管理部、投资管理三部、量化投资部、境外投资部、FOF投资管理部、研究部、营销管理与服务部、渠道业务总部、机构业务总部、养老金业务总部、交易管理部、风险管理部、产品开发部、运作保障部、信息技术部、互联网金融部、战略发展部、投资银行部、监察稽核部、内部审计部、人力资源部、公司办公室、财务行政部、深圳管理部等25个职能部门，并设有北京分公司、青岛分公司和上海分公司。此外，公司设立投资决策委员会作为公司投资业务的最高决策机构，同时下设“主动型A股投资决策、固定收益投资决策、量化和境外投资决策、养老金投资决策、基金中基金投资决策及基金投资顾问投资决策”六个专门委员会。公司投资决策委员会负责确定公司投资业务理念、投资政策及投资决策流程和风险管理。

各部门主要职能如下：

投资管理一部、多资产投资管理部：根据主动型A股投资决策委员会制定的原则进行投资。

投资管理三部：主要负责固定收益产品的投资、研究工作。

量化投资部：基金的投资管理（包括指数基金、ETF及主动量化基金的管理）、数量化投资策略和模型研究与开发、量化产品的设计和创新、为其他部门提供金融工程支持。

研究部：负责宏观策略、行业和公司研究。

营销管理与服务部：研究制定公司整体营销策略和营销政策、建立与完善公

司客户服务体系、公司各类产品及业务的营销支持以及营销数据的分析与整理工作。

机构业务总部：银行、保险公司、信托、财务公司、企业集团等各类型机构客户的开发、营销与服务工作。

渠道业务总部：开发和推动银行和券商渠道的产品销售，渠道总对总业务开拓与维护，渠道一线销售工作。

产品开发部：负责新产品开发、现有产品管理、产品管理规划等工作。

境外投资部：负责公司QDII产品的投资、研究工作，并协助QDII产品的设计、发行等工作。

FOF 投资管理部：负责基金中基金（FOF）及其他资产配置型投资管理业务，探索并开发各类资管领域的新型业务等。

交易管理部：负责公司所有产品的交易管理工作。

养老金业务总部：全国社保基金、企业年金、职业年金、养老保险公司及第三支柱养老业务的开发、维护和服务工作。

风险管理部：负责公司风险管理体系的建设及风险监控工作。

运作保障部：负责公司基金的注册登记、资金清算、会计核算、估值。

信息技术部：负责信息系统规划、系统开发、维护及后台运作支持工作。

互联网金融部：负责线上业务，包括产品的线上直销、智能投顾、理财服务及金融科技创新。

投资银行部：负责公司的资本运作，以及与并购、融资等投资银行业务相关的一二级市场产品设计与实施。

公司办公室：负责公司董事会相关工作，负责文档、印鉴管理，公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。

人力资源部：负责人力资源规划、公司组织管理与发展等。

财务行政部：负责公司财务管理、会计核算，行政、后勤等相关工作。

深圳管理部：负责公司财务管理、会计核算、税务报送，与主管机关及相关单位的联络沟通，以及其他行政工作等。

监察稽核部：负责对公司各项业务进行合规性审查，对公司经营管理和基金运作的合规性进行检查并出具合规意见，处理日常法律事务、信息披露事务等。

战略发展部：以战略发展为导向，负责国内外资管行业新动向、行业政策、

市场供求、竞争对手等的调查研究；负责拟定战略发展规划和实施方案供决策层讨论和决策；负责战略发展相关方案的落地及实施。

内部审计部：根据监管规范和公司要求，负责公司各项审计工作。

北京分公司：负责所辖区域内的行政管理。

青岛分公司：负责青岛地区市场业务及所辖区域内的行政管理。

上海分公司：负责上海地区市场业务及所辖区域内的行政管理。

信息披露负责人及咨询电话：杨文辉；010-58163096。

截至2021年11月30日，我司共有员工567人，其中已通过高管资格培训和考试的共6人，已通过基金从业资格考试（含通过高管资格考试）的共529人。

3、本基金基金经理

李宜璇女士：博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014年12月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2017年12月25日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自2018年3月7日至2020年12月31日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2021年1月13日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2021年2月25日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2018年3月7日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年9月29日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自2020年10月29日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2021年1月1日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自2021年1月5日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月4日起兼任银华中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月9日起兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月10日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年5月25日起兼任银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年6月24日至2021年12月21日兼任银华中证800汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年10月26日起兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自

2022年1月17日起兼任银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、基金托管业务经营情况

截至2021年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管922只证券投资基金。

（三）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）

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼

法定代表人：李丹

经办注册会计师：薛竞、周祎

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：周祎

六、基金合同摘要

基金合同摘要见附件。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支。

本基金基金合同生效后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

本基金 2022 年 1 月 26 日资产负债表（未经审计）如下：

银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金	
2022 年 1 月 26 日资产负债表	
(除特别注明外，金额单位为人民币元)	
资产	
银行存款	29,589,602.16
结算备付金	25,274,107.67
存出保证金	7,894,780.89
交易性金融资产	226,921,002.57
其中：股票投资	226,921,002.57
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	
应收股利	
应收利息	
应收申购款	
其他资产	42,373.89
资产总计	289,721,867.18
负债及所有者权益	
负债	
应付证券清算款	37,706,794.92
应付管理人报酬	31,740.27
应付托管费	6,348.05
应付交易费用	186,243.97
应付税费	
应付赎回款	
其他负债	1,719.20

负债合计	37,932,846.41
所有者权益	
实收基金	258,189,251.00
未分配利润	-6,400,230.23
所有者权益合计	251,789,020.77
负债及所有者权益总计	
	289,721,867.18
截至 2022 年 1 月 26 日，银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值为 0.9752 元。	

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2022 年 1 月 26 日，银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的投资组合如下。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。

（一）基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	226,921,002.57	78.32%
债券		
权证		
资产支持证券		
买入返售金融资产		
银行存款和清算备付金合计	54,863,709.83	18.94%
应收申购款		
其他资产	7,937,154.78	2.74%
合计	289,721,867.18	100.00%

注：由于四舍五入的原因，“占基金总资产的比例”分项之和与合计可能有尾差。

（二）按行业分类的股票投资组合

1、2022 年 1 月 26 日指数投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有指数投资境内股票。

2、2022 年 1 月 26 日积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

3、2022 年 1 月 26 日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		
消费者非必需品	26,777,277.82	10.63%
消费者常用品		
能源		
金融	1,699,990.80	0.68%
医疗保健		
工业		
信息技术	154,099,875.63	61.20%
电信服务	44,343,858.32	17.61%

公用事业		
地产建筑业		
合计	226,921,002.57	90.12%

(三) 2022年1月26日按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

1、2022年1月26日指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	00700	腾讯控股	65,800.00	25,314,230.68	10.05%
2	03690	美团-W	127,400.00	23,285,152.80	9.25%
3	01810	小米集团-W	1,570,800.00	22,253,304.94	8.84%
4	00981	中芯国际	1,408,000.00	21,776,934.50	8.65%
5	02382	舜宇光学科技	128,400.00	21,486,188.93	8.53%
6	00992	联想集团	2,616,000.00	17,871,494.90	7.10%
7	00268	金蝶国际	881,000.00	16,316,909.38	6.48%
8	00788	中国铁塔	16,056,000.00	12,390,479.42	4.92%
9	03888	金山软件	324,600.00	9,347,423.10	3.71%
10	01347	华虹半导体	212,000.00	6,854,031.23	2.72%

2、2022年1月26日积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	09618	京东集团-SW	1,038.00	240,139.99	0.10%

2022年1月26日,本基金仅持有上述积极投资股票。

(四) 期末按债券品种分类的债券投资组合

2022年1月26日,本基金未持有债券。

(五) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

2022年1月26日,本基金未持有债券。

(六) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

2022年1月26日,本基金未持有资产支持证券。

(七) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

2022年1月26日,本基金未持有权证。

(八) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

2022年1月26日，本基金未持有股指期货。

2022年1月26日，本基金本报告期内未进行股指期货交易。

（九）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体中，美团由于涉嫌违反《中华人民共和国反垄断法》，于2021年4月26日收到了国家市场监督管理总局的调查通知。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

截至2022年1月26日，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、自基金合同生效日至2022年1月26日，本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、其他资产构成如下：

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	7,894,780.89
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	
5	应收申购款	
6	其它应收款	42,373.89
7	待摊费用	
8	其它	
合计		7,937,154.78

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

2022年1月26日，本基金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

2022年1月26日，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（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、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》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

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

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

（二）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

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

（一）中国证监会关于准予银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件；

（二）《银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（三）《银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

（四）《银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（五）《关于申请募集注册银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金的法律意见》；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

银华基金管理股份有限公司

2022年1月28日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，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人的利益；
- （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/期货所产生的权利；
- （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及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、赎回等业务规则，开通人民币之外的其他销售币种基金份额的申购、赎回等业务；

(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) 在法律法规和基金合同规定的范围内决定调整基金费率结构和收费方式；

(19) 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/期货投资；

(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法律法规或监管机构另有规定或要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(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的规定；

(17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人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活期存款利息(税后)在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资人的利益;

(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法律法规或监管机构另有规定或要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(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；

(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，保存期限不低于法律法规的规定；

(12) 保存基金份额持有人名册，保存期限不低于法律法规的规定；

(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；

(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) 基金份额持有人的权利与义务

基金投资人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，基金投资人自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金的基金份额持有人和《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、应付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) 向基金管理人和监管机构提供依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

(10) 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；

(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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 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开时，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。

（二）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、表决意见提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。

（三）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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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。

（四）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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率（经估值汇率调整）达到 1%以上时，可进行收益分配，基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率（经估值汇率调整）的计算公式参见《招募说明书》；

2、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（经估值汇率调整）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；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采取现金分红方式；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可按照监管部门要求履行适当程序并与基金托管人协商一致后，酌情调整以上基金收益分配原则和支付方式，并于变更实施日前在规定媒介上公告，且

不需召开基金份额持有人大会。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

四、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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费和诉讼费、仲裁费等费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货、股票期权交易结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市初费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 9、证券、期货账户开户费、银行账户维护费；
- 10、本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产中扣除；
- 11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 12、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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 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、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 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 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。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—12 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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

同时，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包括主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票、港股通标的股票）、债券资产（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换公司债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、中期票据、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券等）、银行存款（包括银行定期存款、协议存款及其他银行存款）、资产支持证券、债券回购、同业存单、现金、金融衍生工具（包括股指期货、股

票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

本基金可以根据相关法律法规,参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资原则及投资比例限制按法律法规或监管机构的相关规定执行。

(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) 在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;

(2) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%,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;

(3) 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;

(4) 本基金总资产不超过净资产的 140%;

(5) 本基金参与股指期货,遵循以下中国证监会规定的投资限制: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;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%;基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;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%;

(6) 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%;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%,中国证监会规定的特殊品种除外;

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 本基金参与融资的，每个交易日日终，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%；

(12) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 参与转融通证券出借业务的资产，不得超过基金资产净值的 30%，其中，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与转融通证券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 个月内基金日均资产净值不得低于 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；

(13) 本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：

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；

(14) 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；

(15) 每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

(16) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

除上述(8)、(9)、(10)、(12)、(15)项情形之外，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或价格变化、标的指数成份股流动性限制或港股通额度已满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，基金管理人应当在可调整之日起 10 个港股通交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(12)项的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或

者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，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以变更后的规则为准。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将拟公告的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按约定对外公布。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

（一）基金合同的终止事由

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。

（二）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：基金合同终止事由出现后，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。

(三) 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剩余财产中支付。

(四) 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。

(五) 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，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告，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。

(六) 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，保存期限不少于法律法规的规定。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。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进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同约定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本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，并按其解释。

九、基金合同存放地和投资人取得合同的方式

基金合同正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

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