

汇添富恒生科技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：汇添富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

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：2022 年 9 月 13 日

公告日期：2022 年 9 月 7 日

目 录

一、 重要声明与提示	1
二、 基金概览	2
三、 基金的募集与上市交易	3
四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人	6
五、 基金主要当事人简介	7
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	22
十一、 基金托管人承诺	22
十二、 基金上市推荐人意见	23
十三、 备查文件目录	23
附件：基金合同摘要	25

一、 重要声明与提示

《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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,汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)管理人汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在基金管理人网站(www.99fund.com)上的《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”)及其更新、《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)等信息披露文件。

投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:市场风险、流动性风险、特有风险、管理风险、信用风险、操作或技术风险、合规性风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、税负增加风险及其他风险。其中特有风险包括:1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险;2、标的指数波动的风险;3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险及跟踪误差未达约定目标的风险;4、标的指数变更的风险以及指数编制机构停止服务的风险;5、成份股停牌的风险;6、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险;7、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险;8、退市风险;9、投资者申购失败的风险;10、投资者赎回失败的风险;11、代理申赎投资者买券卖券的风险;12、申购赎回清单差错风险;13、第三方机构服务的风险;14、基金投资资产支持证券的风险;15、金融衍生

品投资风险；16、基金参与境内融资与转融通证券出借业务的风险；17、本基金可以投资港股通标的股票的风险；18、存托凭证投资风险；19、正回购/逆回购风险；20、境外证券借贷风险；21、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险。

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要投资于境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、境外证券市场风险等特殊投资风险。

投资者应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

二、 基金概览

（一）基金名称

汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

基金简称：汇添富恒生科技ETF

场内简称：HSTECH

扩位证券简称：恒生科技ETFQD

基金代码：513260

（二）基金份额总额

截至2022年9月5日，本基金份额总额为243,242,980.00份。

（三）基金份额净值

截至2022年9月5日，本基金基金份额净值为0.9937元。

（四）本次上市交易份额

截至2022年9月5日，本次上市交易份额为243,242,980.00份。

（五）上市交易的证券交易所：上海证券交易所

（六）上市交易日期：2022年9月13日

（七）基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

（八）基金托管人：招商银行股份有限公司

（九）登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

（十）上市推荐人：东方证券股份有限公司

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注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2021】3808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：网下现金发售的日期为2022年5月27日至2022年8月26日，网上现金发售的日期为2022年8月24日至2022年8月26日

5、发售价格：人民币1.00元

6、发售期限：网下现金认购发售65个工作日，网上现金认购发售3个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购2种方式。

8、发售机构：

（1）网下现金发售直销机构

汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室

办公地址：上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932893

传真：（021）50199035或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

邮箱：guitai@htffund.com

网址：www.99fund.com

（2）网下现金发售代理机构

1. 公司全称：中信证券股份有限公司

法定代表人：张佑君

注册住址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

客服电话：95548

公司网址：www.citics.com

2. 公司全称：中信证券华南股份有限公司

法定代表人：胡伏云

注册地址：广州市天河区临江大道395号901室(部位:自编01),1001室

办公地址：广州市天河区临江大道395号901室(部位:自编01),1001室

客服电话：95548

公司网站：www.gzs.com.cn

3. 公司全称：中信证券（山东）有限责任公司

法定代表人：冯恩新

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛金融广场1号楼20层2001

（266061）

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场1号楼东5层

客户服务电话：95548

公司网址：sd.citics.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，增加符合要求的网下现金发售代理机构，并及时公告。

（3）网上现金发售代理机构

网上现金发售可通过具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证

券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位办理。具体会员单位名单可在上海证券交易所网站查询。

9、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况

经会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，基金募集期共募集243,242,980.00份基金份额（其中包括利息转份额980.00份），有效认购户数为1,399户。其中，汇添富基金管理股份有限公司运用自有资金认购本基金认购本基金基金份额0.00份（含募集期利息结转的份额），占基金总份额比例0.00%；汇添富基金管理股份有限公司基金从业人员认购本基金基金份额0.00份（含募集期利息结转的份额），占基金总份额比例0.00%。本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

11、本基金募集备案情况

本基金募集资金于2022年8月31日划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户，并于2022年8月31日获中国证监会基金备案手续书面确认。

12、基金合同生效日：2022年8月31日

13、基金合同生效日的基金份额总额：243,242,980.00份

（二）本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[2022] 248号

2、上市交易日期：2022年9月13日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金场内简称及基金代码：

场内简称：HSTECH；扩位证券简称：恒生科技ETFQD；基金代码（二级市场交易代码）：513260

5、本次上市交易份额为243,242,980.00份。

6、基金净值的披露：基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。用于基金信息披露的基金

份额净值、基金份额累计净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。

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2022年9月5日，本基金份额持有人户数为1,399户，平均每户持有的基金份额为173,869.18份。

（二）持有人结构

截至2022年9月5日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的本基金份额161,901,980.00份，占基金总份额的66.56%；个人投资者持有的本基金份额为81,341,000.00份，占基金总份额的33.44%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至2022年9月5日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内基金总份额比例（%）
1	上海证券—国泰君安证券股份有限公司—上海证券正和2号 FOF 单一资产管理计划	30,000,000.00	12.33
2	UBS AG	20,000,000.00	8.22
3	上海东证期货有限公司	20,000,000.00	8.22
4	王惠星	12,000,000.00	4.93
5	上海申九资产管理有限公司—申九稳健回报3号私募证券投资基金	10,000,000.00	4.11
6	长城证券股份有限公司	8,000,000.00	3.29
7	中国国际金融股份有限公司	8,000,000.00	3.29
8	信达证券股份有限公司	7,000,245.00	2.88
9	川财证券有限责任公司	7,000,000.00	2.88
10	郭玉燕	7,000,000.00	2.88
11	西南证券股份有限公司	7,000,000.00	2.88
12	兴证证券资管—中泰证券股份有限公司—兴证资管—兴泰多策略1号单一资产管理计划	7,000,000.00	2.88
13	中国银河证券股份有限公司	7,000,000.00	2.88
合计		150,000,245.00	61.67

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司上海分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

1、公司概况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市黄浦区外马路 728 号

法定代表人：李文

总经理：张晖

成立时间：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2005]5 号

工商登记注册的法人营业执照文号：91310000771813093L

经营范围：基金募集，基金销售，资产管理，经中国证监会许可的其他业务。

（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

注册资本：人民币 13272.4224 万元

联系人：李鹏

联系电话：（021）28932888

股东名称及其出资比例：

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

2、内部组织结构及职能

汇添富基金自成立以来，按照法律法规要求健全公司治理结构，建立权责清晰的经营组织架构，不断完善公司内部控制管理，确保公司规范稳健运营，有效

维护基金份额持有人的合法权益。公司目前设置投资研究总部、指数与量化投资部、投资理财总部、机构理财总部、互联网金融总部、投资顾问部、产品创新服务中心、基金营运部、信息技术部、合规稽核部、风险管理部、战略投资部、国际业务部、综合办公室等部门，负责投资研究交易管理、销售营销管理、基金投资顾问（试点）、产品管理、基金运营管理、信息技术管理、合规及风险管理等工作。公司相继在北京、广州、成都、上海、南京、深圳设立分公司，从事区域市场营销和客户服务等工作。此外，公司还设立了三个子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司(China Universal Asset Management (HongKong) Company Limited)、汇添富资本管理有限公司和汇添富资产管理（美国）控股有限公司。其中，汇添富资产管理(香港)有限公司负责证券交易、就证券提供意见和提供资产管理；汇添富资本管理有限公司负责经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务；汇添富资产管理（美国）控股有限公司通过其全资子公司汇添富资产管理（美国）有限责任公司（China Universal Asset Management (USA), LLC）在美国开展资产管理相关业务，为客户提供资产管理和投资建议服务。

3、基金管理业务情况

汇添富基金及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。汇添富基金及旗下子公司现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

截至 2022 年 7 月末，公司管理 258 只开放式证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

4、人员情况

截至2022年7月31日，基金管理人正式员工865人，硕士及以上学历人员占比78.15%，其中645人具有硕士研究生学历，31人具有博士研究生学历。

5、信息披露负责人：李鹏

电话：021-28932888

6、本基金基金经理

乐无穹，国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014年7月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019年4月15日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019年7月26日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年10月8日至今任中证800交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年4月29日至今任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年7月8日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年7月27日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月27日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年9月29日至今任汇添富中证800交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021年9月29日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021年10月26日至今任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021年10月29日至今任汇添富MSCI中国A50互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年12月28日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022年1月11日至今任汇添富MSCI中国A50互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年3月29日至今任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年6月13日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022年7月29日至今任汇添富中证1000交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年8月31日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。

（二）基金托管人

1. 基金托管人概况

（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：王良（拟任）

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）发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2022 年 3 月 31 日，本集团总资产 94,153.79 亿元人民币，高级法下资本充足率 17.29%，权重法下资本充足率 14.50%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、基金券商产品团队、银保信托产品团队、养老金团队、交易与清算团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、系统与数据团队 9 个职能团队，现有员工 117 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12 月荣获 2019 东方财富风云榜“2019 年度最佳托管银行”奖。2020 年 1 月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2019 年度优秀资产托管机构”奖项；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；

10 月荣获《中国基金报》“2019 年度最佳基金托管银行”奖。2021 年 1 月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2020 年度优秀资产托管机构”奖项；1 月荣获 2020 东方财富风云榜“2020 年度最受欢迎托管银行”奖项；2021 年 10 月，荣获国新投资有限公司“2021 年度优秀托管银行奖”和《证券时报》“2021 年度杰出资产托管银行天玑奖”；2021 年 12 月，荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖“2020 年度最佳基金托管银行”；2022 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2021 年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构”。

2. 主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020 年 9 月起担任本行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。十九届中央候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王良先生，本行党委书记、拟任本公司行长，兼任财务负责人、董事会秘书。中国人民大学货币银行学硕士，高级经济师。1995 年 6 月加入本行，2001 年 10 月起历任本行北京分行行长助理、副行长、行长，2012 年 6 月起任本行行长助理兼北京分行行长，2013 年 11 月起不再兼任本行北京分行行长，2015 年 1 月起任本行副行长，2016 年 11 月起兼任本行董事会秘书，2019 年 4 月起兼任本行财务负责人并不再兼任本行董事会秘书，2019 年 8 月起担任本行执行董事。2021 年 8 月起任本行常务副行长兼财务负责人、董事会秘书。2022 年 4 月 18 日起全面主持本行工作。

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

本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

孙乐女士，招商银行资产托管部主要负责人，硕士研究生毕业，2001年8月加入招商银行至今，历任招商银行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长，具有20余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

3. 基金托管业务经营情况

截至2022年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管1051只证券投资基金。

4. 托管人的内部控制制度

（1）内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，坚持守法经营、规范运作的经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

（2）内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内部控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

（3）内部控制原则

1) 全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位，并由全部人员参与。

2) 审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求。

3) 独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

4) 有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险，且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格有效执行。

5) 适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

6) 防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与我行其他业务场地隔离，办公网和业务网物理分离，部门业务网和全行业务网防火墙策略分离，以达到风险防范的目的。

7) 重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务重要事项和高风险环节。

8) 制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置、权责分配及业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

（4）内部控制措施

1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

2) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

3) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中获取的客户资料严格保密，除法律法规和其他有关规定、监管机构及审计要求外，不向任何机构、部门或个人泄露。

4) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统机房、权限管理实行双人双岗双责，电脑机房 24 小时值班并设置门禁，所有电脑设置密码及相应权限。业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

5) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

5. 基金托管人对基金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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

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，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。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，基金托管人应报告中国证监会。

（三）上市推荐人

东方证券股份有限公司

法定代表人：金文忠

注册地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦

办公地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦

联系人：龚玉君

联系电话：021-63325888-2103

客户服务热线：95503

网址：www.dfzq.com.cn

（四）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

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

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

业务联系人：许培菁

经办会计师：许培菁、韩云

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要请见附件。

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，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书及相关公告设定的费率收取认购费。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金募集结束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2022年9月5日资产负债表如下：

单位：人民币元

资 产	2022年9月5日
资 产：	
银行存款	227,294,442.40
结算备付金	15,353,197.90
存出保证金	-
交易性金融资产	90,409,437.01

其中：股票投资	90,409,437.01
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	333,057,077.31
负债和净资产	2022 年 9 月 5 日
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	-
应付清算款	91,327,635.02
应付赎回款	-
应付管理人报酬	4,982.77
应付托管费	1,660.93
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	5,853.66
负债合计	91,340,132.38
净资产：	
实收基金	243,242,980.00
未分配利润	-1,526,035.07
净资产合计	241,716,944.93
负债和净资产总计	333,057,077.31

八、 基金投资组合

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。

截止到 2022 年 9 月 5 日，本基金的投资组合如下：

（一） 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	90,409,437.01	27.15
	其中：普通股	90,409,437.01	27.15
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	242,647,640.30	72.85
8	其他资产	-	-
9	合计	333,057,077.31	100

注：基金管理人将在上市前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。

（二） 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	90,409,437.01	37.40

合计	90,409,437.01	37.40
----	---------------	-------

注：按公允价值占基金资产净值比例从大到小排序；国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；此处股票包括普通股和优先股；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

（三）报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	34,915,793.5	14.44
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	1,112,536.59	0.46
45 信息技术	25,371,700.69	10.50
50 电信服务	29,009,406.23	12.00
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	90,409,437.01	37.40

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有积极投资。

（四）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及存托凭证投资明细

4.1 报告期末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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	26,500.00	7,430,711.04	3.07%

2	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港联合交易所	中国香港	125,900.00	7,265,312.12	3.01%
3	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港联合交易所	中国香港	34,650.00	7,212,382.53	2.98%
4	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港联合交易所	中国香港	755,000.00	7,207,266.69	2.98%
5	Meituan	美团-W	3690 HK	香港联合交易所	中国香港	46,300.00	7,065,201.10	2.92%
6	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	89,900.00	6,993,535.41	2.89%
7	NetEase Inc	网易	9999 HK	香港联合交易所	中国香港	48,300.00	5,867,444.49	2.43%
8	Baidu Inc	百度	9888 HK	香港联合交易所	中国香港	39,450.00	4,754,209.09	1.97%
9	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	2382 HK	香港联合交易所	中国香港	48,100.00	4,291,458.67	1.78%
10	Semiconductor Manufacturing International Corp	中芯国际	981 HK	香港联合交易所	中国香港	301,500.00	4,012,425.74	1.66%

4.2 报告期末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及存托凭证投资明细

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有积极投资的股票及存托凭证。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有债券。

（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五名债券投资明细

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有债券。

（七）报告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

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有资产支持证券。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品

投资明细

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有金融衍生品。

（九）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

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有基金。

（十）投资组合报告附注

10.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股、美团-W 出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

10.3 其他资产构成

注：本基金 2022 年 9 月 5 日无其他资产构成。

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金 2022 年 9 月 5 日未持有处于转股期的可转换债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金 2022 年 9 月 5 日前十名股票中不存在流通受限情况。

九、 重大事件揭示

本基金以下信息披露事项已通过中国证监会规定报刊以及基金管理人的公司网站（www.99fund.com）进行公开披露。

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）发行文件	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022-05-23
2	关于汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加网下现金发售代理机构的公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022-05-27
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下的上海证券交易所 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基	2022-06-20

		金电子披露网站	
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022-06-21
5	关于汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加网下现金发售代理机构的公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022-08-16
6	关于汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）增加网下现金发售代理机构的公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022-08-18
7	汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上网发售提示性公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022-08-24
8	汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同生效公告	上交所,上证报,公司网站,中国证监会基金电子披露网站	2022-09-01

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《中华人民共和国证券投资基金法》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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《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》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《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》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《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》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

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）本基金上市符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《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

（一）本基金备查文件包括下列文件：

1、中国证监会准予汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的文件；

2、《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

3、《汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、注册登记协议；

8、中国证监会要求的其他文件。

（二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

风险揭示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资

者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

汇添富基金管理股份有限公司

2022年9月7日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金份额持有人的权利、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、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）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；

（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不少于法定最低期限；
- （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、中国证监会及外管局规定的和《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/期货结算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）选择、更换或撤销境外托管人；

（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/期货结算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；

（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）保存基金管理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；保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法定最低期限；

（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）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；

（23）保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

（24）安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

（25）每月结束后 7 个工作日内，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；

（26）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；

（27）法律法规、中国证监会及外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

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。

（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：

- （1）终止《基金合同》，但基金合同另有约定除外；
- （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除外；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规或中国证监会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）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；

（9）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

（10）变更基金份额持有人大会程序；

（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）变更本基金收费方式；

（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以及中国证监会的相关规定发生变动，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认购、申购、赎回、交易、非交易过户、质押等业务的规则；

（6）基金推出新业务或服务；

（7）基金管理人调整基金收益分配原则；

（8）调整基金的申购赎回方式；

（9）募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市或开通跨系统转托管业务或增加场外申购赎回业务；

（10）按照本基金合同的约定，将本基金变更为跟踪标的指数的非上市的开

放式指数基金；

（11）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- （1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合

同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具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，本基金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。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人也可以采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

（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 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。

（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《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一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两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异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）本部分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，报监管机关并提前公告后，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、基金份额收益原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

- 1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配采用现金分红；
- 3、每一基金份额享有同等分配权；
- 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、法律法规或监管机构另有规定的，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原则进行调整，无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，在 2 日内在规定媒介公告。

（四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、基金费用与税收

（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（含境外托管人收取的费用）；
- 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、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货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（out-of-pocket fees）；

7、基金的上市费；

8、基金的开户费用、账户维护费用；

9、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；

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、除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；

12、基金依照有关法律规定应当缴纳的，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）；

13、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

14、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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、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、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、公休日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—14 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、基金的指数许可使用费（该费用由基金管理人承担）；
- 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

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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、基金的投资

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（二）投资范围

本基金投资于标的指数的成份股、备选成份股和其他香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）。此外，本基金还可投资于以下金融产品或工具：

针对境外投资，本基金可投资于银行存款、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；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；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、全球存托凭证、房地产信托凭证；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公募基金；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权证、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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票（包含主板、创业板、其他依法上市的股票、存托凭证），衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等），债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等资产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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于境外外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。

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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股和备选成份股、跟踪同一标的指数的基金、期货期权等相关衍生工具的合约市值的比例不得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。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适

当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票的比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股和备选成份股、跟踪同一标的指数的基金、期货期权等相关衍生工具的合约市值的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（3）本基金的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最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

8）本基金参与股指期货和国债期货交易的，应当遵守下列要求：

8.1）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%；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%；

8.2）本基金在任何交易日日终，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；

8.3）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%；持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

8.4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；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；

8.5）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%；

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

9）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；

10）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%；

11）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；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归为流动性受限资产；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%；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；

12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值

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；

13) 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方开展逆回购交易的，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；

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；

(4) 本基金的境外投资应遵循以下限制：

1) 本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中境外银行中，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。在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

2) 本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) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 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) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制；

5) 同一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%；

7) 本基金投资境外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：

7.1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

7.2) 本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%；

7.3) 本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：

7.3.1) 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；

7.3.2) 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；

7.3.3) 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%；

7.4) 基金管理人应当在本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；

8) 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：

8.1) 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；

8.2) 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%；

8.3) 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；

8.4) 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：

8.4.1) 现金；

8.4.2) 存款证明；

8.4.3) 商业票据；

8.4.4) 政府债券；

8.4.5) 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；

8.5) 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；

8.6) 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；

9) 基金可以根据正常市场惯例参与境外正回购交易、逆回购交易，并且应

当遵守下列规定：

9.1) 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；

9.2) 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；

9.3) 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；

9.4) 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；

9.5) 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；

10) 基金参与境外证券借贷交易、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；

(5) 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，针对上述组合限制（1）-（3）项，除上述第（3）项的 5）、11）、12）、13）点以外，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，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第（3）项的第 11）项规定的，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。针对境外投资部分，第（4）项 1）-5）点，基金管理人应当在 30 个工作日内进行调整，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。

法律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按变更后的规定执行。

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境内投资或者活动：

- （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，但是法律法规或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。

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境外投资或者活动：

- （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）购买不动产；
- （7）购买房地产抵押按揭；
- （8）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （9）购买实物商品；
- （10）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- （11）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （12）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （13）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；

（14）直接投资与实物商品相关的衍生品；

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

如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行。

六、基金资产净值的计算方式和公告方式

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、权证、REITs、存托凭证、上市流通的基金、衍生品等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（5）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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的

情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

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、债券和权证，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）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、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

6、本基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

7、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

8、因持有股票而享有的配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，若配股权证可以在交易所交易，则按照 1 中确定的方法进行估值；不能在交易所交易

的配股权证，如果收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，如果收盘价低于或等于配股价，则估值为零。

9、衍生工具估值方法

（1）上市流通衍生工具按估值日当日其所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；

（2）未上市衍生工具按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

10、开放式基金（基金合同另有约定除外）的估值以其在估值日公布的净值进行估值，开放式基金未公布估值日的净值的，以估值日前最新的净值进行估值。若基金价格无法通过公开信息取得，参照最近一个交易日可取得的主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

11、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

12、外汇汇率

（1）估值计算中涉及美元、港币、日元、欧元、英镑等五种主要货币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与主要货币的中间价；

（2）其他货币采用美元作为中间货币进行换算，与美元的汇率则以估值日彭博（伦敦时间）16:00 报价数据为准。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。

13、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会计处理。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税

务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。

14、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价格估值。

15、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，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

（二）估值程序

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。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个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，由基金管理人按规定对外公布。

（三）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回且未上市交易前，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。

在开始办理基金份额申购或者赎回或基金上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，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/交易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次日，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、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的情形除外）、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。

（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《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、

估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法定最低期限。

八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交深圳国际仲裁院，根据当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为深圳市，仲裁裁决是终局，对仲裁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，相关各方当事人应恪守各自职责，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（不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一式一份外，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。

5、《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。