

南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）  
上市交易公告书

南方基金管理股份有限公司

二〇二三年三月三十日

---

## 目录

一、重要声明与提示 .....	3
二、基金概览 .....	4
三、基金的募集与上市交易 .....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	7
五、基金主要当事人简介 .....	8
六、基金合同摘要 .....	16
七、基金财务状况 .....	17
八、基金投资组合 .....	19
九、重大事件揭示 .....	23
十、基金管理人承诺 .....	24
十一、基金托管人承诺 .....	25
十二、基金上市推荐人意见 .....	26
十三、备查文件目录 .....	27
附件：基金合同摘要 .....	28

---

## 一、 重要声明与提示

《南方标普 500 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，南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）管理人南方基金管理股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人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，请投资者阅读 2023 年 1 月 18 日刊登在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）以及南方基金管理股份有限公司网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）上的《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》和《南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要》。

---

## 二、 基金概览

- 1、基金名称：南方标普500交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
- 2、基金二级市场交易简称：标普ETF；标普500ETF基金
- 3、证券代码：513650
- 4、基金申购、赎回简称：标普ETF
- 5、截至公告日前两个工作日即2023年3月28日基金份额总额：420,734,000.00份
- 6、截至公告日前两个工作日即2023年3月28日基金份额净值：1.0003元
- 7、本次上市交易份额：420,734,000.00份
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 9、上市交易日期：2023年4月4日
- 10、基金管理人：南方基金管理股份有限公司
- 11、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 12、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
- 13、上市推荐人：川财证券有限责任公司

14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国中金财富证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、安信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东方证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、华宝证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、方正证券股份有限公司、国金证券股份有限公司（排名不分先后）。

基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

### 三、 基金的募集与上市交易

#### （一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2022 年 8 月 1 日证监许可〔2022〕1698 号文。

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：2023 年 1 月 30 日至 2023 年 3 月 20 日。其中，网下现金发售的日期为 2023 年 1 月 30 日至 2023 年 3 月 20 日，网上现金发售的日期为 2023 年 3 月 16 日至 2023 年 3 月 20 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：网下现金认购 36 个工作日，网上现金认购 3 个工作日。

7、发售方式：网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

8、发售机构：

##### （1）网下现金销售机构

1) 直销机构：南方基金管理股份有限公司

2) 发售代理机构：华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、申万宏源证券有限公司、安信证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、平安证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、长江证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司（排名不分先后）

（2）网上现金销售机构：网上现金发售通过具有基金代销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。

#### （二）基金合同生效

本基金的发售已获中国证监会 2022 年 8 月 1 日证监许可〔2022〕1698 号文注册，自 2023 年 1 月 30 日起公开募集，截至 2023 年 3 月 20 日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 420,734,000.00 元人民币，折合基金份额 420,734,000.00 份；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。募集资金已于 2023 年 3 月 23 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。

本次募集有效认购总户数为 1607 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，募集期募集的基金份额共计 420,734,000.00 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

---

其中本基金管理人南方基金管理股份有限公司基金从业人员认购本基金份额总量为0，本公司高级管理人员、基金投资、研究部门负责人和基金经理认购本基金份额总量的数量区间为0。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。

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《南方标普500交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》、《南方标普500交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2023年3月23日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

### （三）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2023]60号

2、上市交易日期：2023年4月4日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金二级市场交易简称：标普ETF；标普500ETF基金

5、证券代码：513650

投资人在上海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、基金申购、赎回简称：标普ETF

7、本基金管理人自2023年4月4日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资人应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括：华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国中金财富证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、安信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东方证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、华宝证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、方正证券股份有限公司、国金证券股份有限公司。

上述排名不分先后。基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

8、本次上市交易份额：420,734,000.00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。

#### 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 2023 年 3 月 28 日，本基金份额持有人户数为 1607 户，平均每户持有的基金份额为 261,813.32 份。

##### （二）持有人结构

截至 2023 年 3 月 28 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为 226,511,000.00 份，占基金总份额 53.84%；个人投资者持有的基金份额为 194,223,000.00 份，占基金总份额的 46.16%。

##### （三）前十名基金份额持有人情况

截至 2023 年 3 月 28 日，前十名基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额的比例（%）
1	法国兴业银行	200,000,000.00	47.54%
2	周全	3,000,000.00	0.71%
3	新余善思投资管理中心(有限合伙) —善思玺德一号私募证券投资基金	3,000,000.00	0.71%
4	深圳市荣保泰资本管理有限公司— 保泰新丝路私募证券投资基金	3,000,000.00	0.71%
5	深圳广源汇富私募证券投资基金管理有 限公司—广源汇富势能转化 8 号私 募证券投资基金	3,000,000.00	0.71%
6	钱末仙	3,000,000.00	0.71%
7	刘昭	3,000,000.00	0.71%
8	刘燕晖	3,000,000.00	0.71%
9	北京昊青财富投资管理有限公司— 昊青佰帝私募证券投资基金	3,000,000.00	0.71%
10	曾媛	2,300,000.00	0.55%

## 五、 基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：南方基金管理股份有限公司
- 2、法定代表人：周易
- 3、总裁：杨小松
- 4、注册资本：3.6172亿元人民币
- 5、住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]4号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码91440300279533137K
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
- 9、股权结构：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。
- 10、内部组织结构及职能：

公司以股东、基金持有人、委托人以及相关受益人利益最大化为目标，构建了一整套赖以指导和控制公司运作的组织运营架构。在董事会和专业委员会管理之下，公司搭建了包括零售群、机构群以及权益投资条线、固定收益投资条线、资产配置条线等为主要结构的矩阵式组织运营架构。各部门主要职责如下：

部门名称	主要职责
宏观策略部	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 负责公司标准化研究资源的整合与共享</li><li>2. 负责宏观研究和大类资产配置策略研究</li><li>3. 为各投研部门、市场部门提供投资决策依据和营销支持</li></ol>
权益投资部	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 负责权益产品的投资管理</li><li>2. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</li><li>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</li></ol>
权益研究部	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 负责股票市场的行业与上市公司研究，提出投资建议并完成研究报告撰写</li><li>2. 及时更新和维护股票池、研究数据以及研究模型</li><li>3. 协助固定收益相关部门开展信用研究及可转债研究，并提出判断和建议</li><li>4. 向销售市场相关部门提供研究支持服务</li></ol>

<b>指数投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责被动指数公募产品的投资管理</li> <li>2. 根据量化模型，完成投资策略研究工作，并提出判断和建议</li> <li>3. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</li> <li>4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</li> </ol>
<b>固定收益投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责固定收益产品的投资管理</li> <li>2. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</li> <li>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</li> </ol>
<b>现金及债券指数投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责货币、短期理财等公募产品的投资管理</li> <li>2. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</li> <li>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</li> </ol>
<b>固定收益研究部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责可转债研究和信用研究，提出投资建议并完成研究报告撰写</li> <li>2. 向全国社保理事会提供支持服务</li> <li>3. 向销售市场相关部门提供研究支持服务</li> </ol>
<b>混合资产投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责“固收+”（固定收益资产投资+其他资产投资统称“固收+”）策略的公募产品和混合策略的非公募产品（包括专户、社保、基本养老、企业年金、职业年金、养老金产品）的投资管理</li> <li>2. 配合做好大类资产配置研究</li> <li>3. 为产品设计与市场营销提供支持</li> </ol>
<b>FOF 投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责 FOF 投资运作管理，包括公募 FOF、养老目标 FOF、专户 FOF</li> <li>2. 负责投顾业务组合运作管理，包括策略开发与组合运作、业务拓展、策略输出、投前投中投后顾问式服务</li> <li>3. 为公司内其他部门提供资产配置、产品布局、业务拓展、基金研究等投研支持与服务</li> </ol>
<b>数量化投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 承担主动量化投资职能的统一归口管理</li> <li>2. 负责主动量化策略产品的投资管理</li> <li>3. 根据量化模型，完成投资策略研究及择时研究工作，并提出判断和建议</li> <li>4. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</li> <li>5. 配合市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</li> </ol>
<b>国际业务部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责海外市场产品的研究、投资管理</li> <li>2. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</li> <li>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</li> </ol>
<b>基础设施基金投资管理部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责公开募集基础设施证券投资基金产品的研究、投资和运营管理工作</li> <li>2. 联合南方资本、产品开发部完成基础设施基金的业务承揽、产品创设等工作</li> <li>3. 配合市场销售相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</li> </ol>
<b>产品开发部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 研究国内外资产管理产品发展动态和创新趋势，进行产品创新、开发及储备，建设和维护公司产品库</li> <li>2. 负责公司创新业务的研究及孵化工作</li> <li>3. 负责零售群、机构群产品的立项、制作、报批、日常管理与维护工作</li> </ol>

零售服务部	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 根据公司的业务发展需要，负责公司零售业务条线统一规划、部署的推动执行职能，对分公司零售业务工作实施条线垂直管理</li> <li>2. 进行零售业务的合作渠道开发、维护和管理，为分公司提供培训、服务和支持，促进公募基金、零售专户等产品的销售、业务的拓展，保障公司零售客户的资产管理规模持续发展</li> </ol>
机构服务部	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 根据公司的业务发展需要，负责公司机构业务条线统一规划、部署的推动执行职能，对分公司机构业务工作实施条线垂直管理</li> <li>2. 根据公司经营目标和营销战略，进行公司机构客户公募业务、专户业务的营销策划、销售发动、营销支持、营销推动、赋能一线和投后服务等工作</li> <li>3. 提高公司机构客户在公募业务和专户业务的市场份额，完成公司对上述业务下达的经营任务</li> </ol>
证券公司业务部	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 根据公司经营目标，全面负责证券公司客户相关业务的统一规划和部署，实现与证券公司“总部对总部”的对接合作，为证券公司的各项业务需求提供全面综合的服务，并维护与证券公司的良好合作关系</li> <li>2. 根据公司营销战略，针对证券公司的渠道进行开发与服务，开展渠道管理、产品销售与服务、营销策划与支持等各项工作</li> <li>3. 提高公司对证券公司客户的服务质量与效果，提升证券公司渠道的销售规模与市场份额，完成公司对证券公司客户相关业务下达的各项经营任务</li> </ol>
战略客户部	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 根据公司整体经营目标，整合公司资源，针对战略客户提供全面综合的资产管理及研究支持服务</li> <li>2. 开展公募、专户和创新业务的开拓与营销，维护与战略客户的良好合作关系，提高战略客户资产保有规模，完成公司下达的经营任务指标</li> </ol>
养老金业务部	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责专户业务线养老金业务的销售管理、资源共享整合</li> <li>2. 根据公司养老金业务经营目标和战略进行整体营销规划</li> <li>3. 对集团的养老金业务提供专业服务与支持</li> </ol>
北京、上海、深圳、 南京、成都分公司	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责组织完成所辖片区的银行、财务公司、券商、保险、企事业单位及高净值人群的客户销售与拓展</li> <li>2. 开展资产创设业务与另类产品交叉销售工作</li> <li>3. 维护相关政府、监管机构和行业协会关系，提供相关接待及后勤服务</li> <li>4. 完成公司下达的预算指标和利润指标</li> </ol>
合肥分公司 (理财中心)	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 履行理财中心相关职能</li> <li>2. 通过电话、网络等多种服务通道，为客户提供集理财咨询和资讯为一体的专业理财顾问服务</li> <li>3. 合肥理财中心隶属客户关系部</li> </ol>
客户关系部	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 建立客户沟通平台，为客户提供专业理财咨询服务；收集客户需求和建议，处理客户投诉</li> <li>2. 搭建客户分类分级服务体系，进行客户信息分析和挖掘；运用多种服务形式和服务手段，进行客户关系的有效维护</li> </ol>

<p><b>网络金融部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责公募业务线上渠道的整体管理工作，包括线上渠道发展规划、平台和网站建设及维护等</li> <li>负责线上渠道的营销管理工作，包括线上渠道推广、线上渠道营销方案的制定、线上销售市场情况及销售数据分析等</li> </ol>
<p><b>可持续发展部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责公司企业文化建设、ESG 等可持续发展事务的研究与推广</li> <li>负责公司品牌形象规划与实施，打造品牌的可持续发展性</li> <li>负责销售、宣传、活动等创意策划</li> <li>为公司销售前台做好营销支持，提高公司的公众认知度和美誉度</li> </ol>
<p><b>监察稽核部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>统筹集团层面的内控体系规划，建设并完善集团法律合规和监察稽核体系</li> <li>负责合规风险和除投研交易外的其他业务操作风险的组织协调与管理</li> <li>监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制情况、委员会的运作情况</li> <li>为公司各项业务发展提供法律支持</li> </ol>
<p><b>风险管理部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>统筹集团层面的风险管理规划，建设并完善集团风险管理系统和投资监控体系</li> <li>负责市场风险、投研交易类操作风险、信用风险、流动性风险等风险的组织协调与管理，进行风险预防、评估、监控、报告，对风险处置情况进行持续跟踪</li> <li>提供风险管理金融工程方面的支持及产品业绩归因分析，为公司风险管理决策提供专业支持</li> </ol>
<p><b>交易管理部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责组合交易和交易执行等策略的研究和制定</li> <li>负责交易实施，降低交易成本、获得交易收益、防范交易过程中的风险</li> <li>负责交易分析和新产品持续研究，提供相关交易支持</li> </ol>
<p><b>数智科技部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>根据集团业务发展战略要求，完成集团信息系统的规划</li> <li>负责集团信息系统的建设和应用开发，持续完善集团信息化建设</li> <li>负责集团信息系统的运行维护，提升运营效率，支持集团业务发展</li> </ol>
<p><b>运作保障部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>统筹集团层面的基金运营管理，搭建集团层面的统一运营服务平台</li> <li>负责基金的投资清算、会计与估值、信息披露等基金会计工作</li> <li>负责基金的注册登记、清算交收、数据统计及费用核算等工作</li> </ol>
<p><b>人力资源部 党委组织部</b></p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>统筹集团层面的人力资源规划，制定集团人力资源政策</li> <li>负责人力资源体系建设，实施人才招聘、培养、激励与保留，提供相关人力资源服务，支持公司业务发展</li> <li>人力资源部与党委组织部合署办公，协助党委开展党员干部的选拔任用、管理监督、调整配备工作</li> </ol>

<b>办公室 党委办公室</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 统筹集团层面的战略规划、检查督办、制度梳理、流程管理和文件归档工作</li> <li>2. 负责公司公文流转、办公文秘、公司会议组织及会议事项督办等工作</li> <li>3. 负责行政后勤、招投标采购管理、基建管理、办公安全等保障类工作</li> <li>4. 负责董事会办公室、工会、公益事业等日常事务工作</li> <li>5. 办公室与党委办公室合署办公，协助党委领导处理日常党务工作，贯彻并跟进党委会决议执行情况，开展党员发展培养和党员先进性教育等工作</li> </ol>
<b>财务部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 负责集团预算管理工作</li> <li>2. 执行集团财务规划、资本优化以及财务风险预警管理，对公司财务状况进行监控和分析</li> <li>3. 负责资金管理、会计核算、财务信息披露及税务管理，支持公司业务发展</li> </ol>

#### 11、人员情况：

截止到 2023 年 2 月，我公司共有员工 908 人，博士 27 人、硕士 675 人、本科 195 人、其他 11 人。

#### 12、信息披露负责人：常克川

咨询电话：400-889-8899

#### 13、基金管理业务情况简介：

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。南方基金总部设在深圳，北京、上海、深圳、南京、成都、合肥六地设有分公司，在深圳和香港设有子公司——南方资本管理有限公司（深圳子公司）和南方东英资产管理有限公司（香港子公司）。南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构；南方资本下设南方股权子公司，主要从事私募股权投资业务。

截至 2022 年 12 月 31 日，南方基金母子公司合并资产管理规模 18425 亿元。其中南方基金母公司规模 17295 亿元，位居行业前列。南方基金公募基金规模 10585 亿元，客户数量 1.87 亿，累计向客户分红 1689 亿元，管理公募基金共 317 只，产品涵盖股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、QDII 型、FOF 型等。南方基金非公募业务规模 6710 亿元，在行业中持续保持优势地位。南方资本子公司规模 249 亿元，南方东英子公司规模 881 亿元。南方基金已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 14、本基金基金经理简介

李佳亮先生，美国南加州大学金融工程硕士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2012 年 8 月加入南方基金，任数量化投资部研究员；2015 年 5 月 28 日至 2016 年 8 月 5 日，任投资经理助理；2017 年 4 月 13 日至 2018 年 9 月 4 日，任南方荣优基金经理；2016 年 8 月 5 日至 2019 年 1 月 18 日，任南方消费基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2019 年 6 月 28

---

日，任大数据 100、大数据 300 基金经理；2016 年 11 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方中证 500 增强基金经理；2017 年 11 月 9 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方量化成长基金经理；2020 年 4 月 23 日至 2021 年 11 月 12 日，任南方上证 50 增强基金经理；2016 年 12 月 30 日至今，任南方绝对收益基金经理；2021 年 10 月 29 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 基金经理；2022 年 1 月 10 日至今，任南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接基金经理；2022 年 11 月 21 日至今，兼任投资经理；2022 年 12 月 16 日至今，任南方基金南方东英银河联昌富时亚太低碳精选 ETF（QDII）基金经理；2022 年 12 月 23 日至今，任南方北证 50 成份指数发起基金经理；2023 年 3 月 3 日至今，任南方中证主要消费 ETF 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：王良

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、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。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。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，本公司执行董事、党委书记、行长，兼任财务负责人、董事会秘书。中国人民大学硕士研究生学历，高级经济师。1995 年 6 月加入本公司北京分行，自 2001 年 10 月起历任本公司北京分行行长助理、副行长、行长，2012 年 6 月任本公司行长助理兼任北京分行行长，2013 年 11 月不再兼任本公司北京分行行长，2015 年 1 月任本公司副行长，2016

---

年 11 月至 2019 年 4 月兼任本公司董事会秘书, 2019 年 4 月起兼任本公司财务负责人, 2021 年 8 月起任本公司常务副行长兼任董事会秘书、公司秘书及香港上市相关事宜之授权代表, 2022 年 4 月 18 日起全面主持本公司工作, 2022 年 5 月 19 日起任本公司党委书记, 2022 年 6 月 15 日起任本公司行长。兼任中国支付清算协会副会长、中国银保监会数据治理高层指导协调委员会委员、中国银行业协会中间业务专业委员会第四届主任、中国金融会计学会第六届常务理事。

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总经理, 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 9 月 30 日, 招商银行股份有限公司累计托管 1129 只证券投资基金。

#### (三) 上市推荐人

公司名称: 川财证券有限责任公司

注册地址: 中国(四川)自由贸易试验区成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 楼

法定代表人: 崔秀红

联系人: 匡婷

联系电话: 028-86583053

客服电话: 028-86585518

公司网站: [www.cczq.com](http://www.cczq.com)

#### (四) 一级交易商

华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国中金财富证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、安信证券股份有限公司、中信证券(山东)

---

有限责任公司、东方证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、华宝证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、方正证券股份有限公司、国金证券股份有限公司（排名不分先后）

（五）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

办公地址：上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈薇瑶

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：张振波、陈薇瑶

---

## 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

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。各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取。

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。

南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 2023 年 3 月 28 日资产负债表 (未经审计) 如下:

资产	本期末 2023 年 3 月 28 日
资产:	
银行存款	369,568,881.74
结算备付金	-
存出保证金	4,812,430.00
交易性金融资产	46,512,750.72
其中: 股票投资	46,512,750.72
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	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	-
应收股利	991.98
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	420,895,054.44
负债和净资产	本期末 2023 年 3 月 28 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	-

应付赎回款	-
应付管理人报酬	34,578.05
应付托管费	8,644.50
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	1,161.96
负债合计	44,384.51
净资产：	
实收基金	420,734,000.00
其他综合收益	-
未分配利润	116,669.93
净资产合计	420,850,669.93
负债和净资产总计	420,895,054.44

注：报告截止日 2023 年 3 月 28 日，基金份额净值 1.0003 元，基金份额总额 420,734,000.00 份。

## 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 2023 年 3 月 28 日，南方标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的投资组合如下：

### 8.1 基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	46,512,750.72	11.05
	其中：普通股	45,377,896.73	10.78
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	1,134,853.99	0.27
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	369,568,881.74	87.81
8	其他资产	4,813,421.98	1.14
9	合计	420,895,054.44	100.00

### 8.2 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（%）
美国	46,512,750.72	11.05
合计	46,512,750.72	11.05

### 8.3 按行业分类的股票及存托凭证投资组合

### 8.3.1 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（%）
能源	2,254,703.97	0.54
材料	1,230,684.24	0.29
工业	3,840,293.36	0.91
非必需消费品	4,503,909.29	1.07
必需消费品	3,399,738.64	0.81
医疗保健	6,721,006.38	1.60
金融	4,484,937.87	1.07
科技	13,625,261.84	3.24
通讯	3,942,500.54	0.94
公用事业	1,344,743.04	0.32
房地产	1,164,971.55	0.28
政府	-	-
合计	46,512,750.72	11.05

本基金对以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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。

### 8.3.2 积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有积极投资的股票及存托凭证。

## 8.4 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

### 8.4.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票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	Apple Inc	苹果公 司	AAPL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	3,036	3,290,501.76	0.78
2	Microsoft Corp	微软公 司	MSFT UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,519	2,874,219.49	0.68
3	Amazon.c om Inc	亚马逊 公司	AMZN UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,820	1,216,697.80	0.29
4	NVIDIA	英伟达	NVDA	纳斯达	美国	502	911,461.87	0.22

	Corp		UW	克证券 交易所				
5	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,216	844,598.51	0.20
			GOOG UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	1,060	738,650.26	0.18
6	Berkshire Hathaway Inc	伯克希 尔哈撒 韦公司	BRK/B UN	纽约证 券交易 所	美国	368	764,858.47	0.18
7	Tesla Inc	特斯拉 公司	TSLA UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	549	714,063.62	0.17
8	Meta Platforms Inc	Meta 平 台股份 有限公 司	META UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	454	626,363.34	0.15
9	UnitedHe alth Group Inc	联合健 康集团	UNH UN	纽约证 券交易 所	美国	191	620,547.59	0.15
10	Exxon Mobil Corp	埃克森 美孚石 油公司	XOM UN	纽约证 券交易 所	美国	841	619,345.44	0.15

注：本基金对以上证券代码采用当地市场代码。

#### 8.4.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有积极投资的股票及存托凭证。

#### 8.5 按债券信用等级分类的债券投资组合

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有债券投资。

#### 8.6 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

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有债券投资。

#### 8.7 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

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有资产支持证券。

#### 8.8 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

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有金融衍生品。

## 8.9 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

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有基金投资。

## 8.10 投资组合报告附注

### 8.10.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.10.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 8.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,812,430.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	991.98
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,813,421.98

### 8.10.4 持有的处于转股期的可转换债券明细

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.10.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.10.5.2 积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截止 2023 年 3 月 28 日，本基金未持有积极投资的股票。

---

## 九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间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、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》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、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、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

---

## 十二、 基金上市推荐人意见

上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

- 1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的  
相关条件；
- 2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核  
实。

---

### 十三、 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予本基金注册的文件；
- (二) 《南方标普500交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》
- (三) 《南方标普500交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》
- (四) 《南方标普500交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照

风险提示：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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

南方基金管理股份有限公司

二〇二三年三月三十日

---

## 附件：基金合同摘要

### 一、基金合同当事人的权利、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、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券、境外证券出借等业务；
- （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、赎回和非交易过户等业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金相关费率结构和收费方式；
- （17）在遵守届时有效的法律法规和监管规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利

---

影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人在必要限度内以基金资产作为质押进行融资；

(18) 选择、增加、更换或撤销境外投资顾问（如有）；

(19) 自行或委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 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、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并披露基金净值信息，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，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(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不少于法律法规规定的最低年限；

---

(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前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束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) 基金管理人应按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务，包括但不限于委托人身份识别、委托人身份和交易资料留存、资金来源和用途合法性审查、可疑交易报告、制裁筛查等，并为托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外；

(28) 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者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户和期货结算账户等投资所需

---

账户，为基金办理证券、期货等交易资金清算；

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 选择、更换或撤销境外托管人并为之签署有关协议；
- (8) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、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，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法律法规规定的最低年限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；

(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、《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业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；在决定境外托管人是否存在过错、疏忽等不当行为，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议适用法律及当地的法律法规、证券市场规则与惯例决定；但基金托管人已按照谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，且境外托管人已按照当地法律法规的要求托管资产的前提下，对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人不承担责任，法律法规另有规定的除外；
- (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) 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；
- (25) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
- (26) 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法律法规规定的最低期限；
- (27) 及时将境外公司行为信息通知基金管理人，按照当地市场规则和市场惯例收取应得收入；
- (28) 法律法规、中国证监会、外管局规定的和《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。

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) 缴纳基金认购款项、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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除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。

若以本基金为目标 ETF 的联接基金的基金合同生效后，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金的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，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比

---

例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

(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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- (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) 终止基金上市，但本基金合同另有约定的除外；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式；
- (3) 基金管理人、相关证券交易所、登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户、收益分配、信息披露等业务的规则，基金推出新业务或服务；
- (4) 增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；
- (5) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

---

(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) 在不违反法律法规规定且在不影响现有基金份额持有人利益的前提下，开通或终止人民币以外的其他币种的申购、赎回及相应业务规则调整；

(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。

## (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) 授权委托书证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

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

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

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

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

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

---

提示性公告：

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

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规或监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人

---

授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有同等表决权。

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、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

在符合上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持

---

有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 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，基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金收益分配原则、执行方式

### (一) 基金收益分配原则

1、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，方可进行收益分配；基金管理人对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）的计算方法参见《招募说明书》；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次；若《基

---

金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、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基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

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另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定及基金合同约定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和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会审议。

#### （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，在 2 日内在规定媒介公告。

### 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，含境外投资顾问的投资顾问费（如有）；
- 2、基金托管人的托管费（含境外托管人的托管费）；
- 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、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/期权交易费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等实际发生的费用；
- 7、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、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）（简称“税收”）；
- 11、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
- 12、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；

---

13、更换基金管理人、更换基金托管人、更换境外托管人及基金资产由原基金托管人、境外托管人转移新基金托管人、境外托管人所引起的费用，但因基金管理人或基金托管人、境外托管人自身原因导致被更换的情形除外；

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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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前 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、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

本基金的管理费的具体使用由基金管理人支配；如果委托境外投资顾问，基金的管理费可以部分作为境外投资顾问的费用，具体支付由基金管理人与境外投资顾问在有关协议中进行约定。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外托管人，其中可以部分作境外托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外托管人在有关协议中进行约定。

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。

## 五、基金财产的投资范围和投资限制

### （一）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（包括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、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证等（下同）），与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金（含

---

ETF，下同）、中国证监会允许投资的结构性产品及金融衍生产品等。此外，为更好地实现投资目标，本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。

境内市场投资工具包括少量非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票以及存托凭证（下同）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含ETF）；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、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；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；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；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。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、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%。

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。

## （二）投资限制

### 1、本基金境内投资应遵循以下限制：

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

（2）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（3）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

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

---

月内予以全部卖出；

(6) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(7) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(8) 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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(9) 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；

(10) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(11) 本基金参与股指期货、股票期权交易，每个交易日日终，在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金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；

(12) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，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；

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%；

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；

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%；

(13) 本基金参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

1) 基金因未平仓的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%；

2) 开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，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；

3) 未平仓的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内地上市交易的股票执行；

除上述第（5）、（8）、（9）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、

---

基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

2、本基金境外投资应遵循以下限制：

(1) 投资比例限制

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

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

3) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 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) 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%，临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准；

5) 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%。持有货币市场基金可以不受上述限制；

6) 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%；

(2) 金融衍生品投资

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

1) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

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

3) 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

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

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

③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%；

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

5) 基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品；

---

(3) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

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

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

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

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：①现金；②存款证明；③商业票据；④政府债券；⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证；

5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任；

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

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

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

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

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

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

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

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

若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓，以符合投资比例限制要求。

3、本基金境内外投资均应遵循以下限制：

本基金投资于标的指数成份股、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%。

若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓，以符合投资比例限制要求。

4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

基金管理人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。期间，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基金合同生效之日起开始。

如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。

## （二）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金境内投资不得参与下列投资或者活动：

- （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）依照法律法规有关规定，由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，本基金境外投资不得参与下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）购买不动产；
- （5）购买房地产抵押按揭；
- （6）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （7）购买实物商品；
- （8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%；
- （9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （10）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （11）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- （12）直接投资与实物商品相关的衍生品；
- （13）向其基金管理人、基金托管人出资；

(14) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(15) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，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、行政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。

## 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。

基金管理人应每个估值日后一工作日内计算该估值日的基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

2、基金管理人应每个估值日后一工作日内对该估值日的基金资产估值。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。

## 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《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）聘请符合《证券法》规定的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。

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金财产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

### （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 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不少于法律法规规定的最低年限。

### 八、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，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市，仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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、澳门特别行政区及台湾地区法律）管辖并从其解释。

### 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或签章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。