

银华中证 2000 增强策略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：中信证券股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市日期：2023 年 12 月 12 日

公告日期：2023 年 12 月 7 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.....	6
五、基金主要当事人简介.....	7
六、基金合同摘要.....	14
七、基金财务状况.....	15
八、基金投资组合.....	17
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.....	23
十二、备查文件目录.....	24
附件：基金合同摘要.....	25

一、重要声明与提示

《银华中证 2000 增强策略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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，银华中证 2000 增强策略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、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅发布在本公司网站（<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《银华中证 2000 增强策略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：银华中证2000增强策略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：2000增强ETF
- 5、基金代码：159555
- 6、标的指数简称：中证2000
- 7、标的指数代码：932000
- 8、基金份额总额：截至2023年12月5日，本基金的基金份额总额为223,462,705.00份
- 9、基金份额净值：截至2023年12月5日，本基金的基金份额净值为0.9975元
- 10、本次上市交易的基金份额：223,462,705.00份
- 11、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 12、上市交易日期：2023年12月12日
- 13、基金管理人：银华基金管理股份有限公司
- 14、基金托管人：中信证券股份有限公司
- 15、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
- 16、申购赎回代理券商（排序不分先后）：

光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、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、中泰证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、申万宏源

证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、国金证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司

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[2023]2223号

2、基金合同生效日：2023年12月1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：2023年11月22日至2023年11月28日。

本基金自2023年11月22日至2023年11月28日通过本公司的直销中心和发售代理机构公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。其中，网上现金认购、通过基金管理人进行网下现金认购和网下股票认购的日期均为2023年11月22日至2023年11月28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、网下现金认购和网下股票认购

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深圳证券交易所会员单位办理。

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

（2）网下现金及网下股票发售直销机构：银华基金管理股份有限公司北京直销中心。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

10、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223,454,000.00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8,705.00元人民币。

本次募集有效认购户数为2,178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223,462,705.00份，

已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

11、基金备案情况

本基金募集备案情况：根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《银华中证2000增强策略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2023年12月1日验资完毕，2023年12月1日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2023年12月1日获得书面确认，本基金的基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2023年12月1日

13、基金合同生效日的基金份额总额：223,462,705.00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：深圳证券交易所，深证上[2023]1111号

2、上市交易日期：2023年12月12日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基金场内简称：2000增强ETF

5、基金交易代码：159555

6、本次上市交易份额：223,462,705.00份

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

8、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约定。

9、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2023年12月5日，本基金持有人户数为2,178户，平均每户持有的基金份额为102,599.96份。

截至2023年12月5日，基金份额合计为223,462,705.00份，机构投资者持有的基金份额为100,711,074.00份，占基金总份额的比例为45.07%；个人投资者持有的基金份额为122,751,631.00份，占基金总份额的比例为54.93%。

(二) 基金份额前十名持有人情况

截至2023年12月5日，本次上市交易的银华中证2000增强策略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	基金份额持有人名称	持有 2000 增强 ETF 份额	占 2000 增强 ETF 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	30,000,874.00	13.43
2	西南证券股份有限公司	7,000,136.00	3.13
3	山西证券股份有限公司	7,000,136.00	3.13
4	上海麦迪生利私募基金管理有限公司—麦迪生路遥 4 号私募证券投资基金	7,000,136.00	3.13
5	国信证券股份有限公司	7,000,136.00	3.13
6	长江证券股份有限公司	6,900,134.00	3.09
7	广发证券股份有限公司	6,000,116.00	2.69
8	谷岭	5,500,427.00	2.46
9	上海思懿投资管理有限公司—思懿投资安欣八号私募证券投资基金	4,000,077.00	1.79
10	黄良驹	3,300,096.00	1.48

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：兰健

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、固定收益及资产配置部、养老金投资管理部、量化投资部、境外投资部、FOF投资管理部、研究部、产品开发与管理部、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、指数业务部、交易管理部、风险管理部、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、基础设施投资部、监察稽核部、内部审计部、党委办公室（党群工作部）、人力资源部、公司办公室、财务行政部、深圳管理部等职能部门，并设有北京分公司、青岛分公司、上海分公司三家分公司。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。

固定收益及资产配置部：现金管理、纯债（含利率债、信用债等）、固收+等投资管理工作，以及固定收益领域研究、交易等工作。

养老金投资管理部：社保、企业年金、职业年金、养老金产品、部分债券专户、部分股债混合和权益产品的投资管理工作。

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。

产品开发与管理部：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。

基础设施投资部：公募REITs项目开发，公募REITs基金设立、发行及运营，公募REITs市场及相关行业研究。

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。

指数业务部：公司指数类产品（含ETF）的研究与开发、协同指数投资管理、营销策划、后台运营及销售等工作。

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。

党委办公室（党群工作部）：统筹协调公司党委的各项日常工作及党建活动

等。

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）58163000。

截至2023年9月30日，我司共有员工676人，其中已通过高管资格培训和考试的共9人，已通过基金从业资格考试（含通过高管资格考试）的共620人。

3、本基金基金经理

张凯先生：硕士学位，毕业于清华大学。2009年7月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监、基金经理。自2012年11月14日至2020年11月25日担任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理，自2013年11月5日至2019年9月26日兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日至2018年4月2日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2016年4月7日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自2016年4月25日至2018年11月30日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2020年11月29日兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理，自2019年6月28日至2021年7月23日兼任银华深证100交易型开放式指

数证券投资基金基金经理，自2019年8月29日至2020年12月31日兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，自2019年12月6日至2021年9月17日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年11月26日至2022年7月28日兼任银华中证等权重90指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2020年11月30日起兼任银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年1月1日起兼任银华深证100指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年2月3日至2022年2月23日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2021年5月13日至2022年6月17日兼任银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年7月29日至2023年7月28日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年9月22日至2023年7月28日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年9月28日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、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2021年11月19日起兼任银华华证ESG领先指数证券投资基金基金经理，自2021年12月20日至2023年7月28日兼任银华中证内地低碳经济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27日至2023年7月28日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年3月7日至2023年9月8日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年11月24日起兼任银华中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年8月23日起兼任银华中证800增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年12月1日起兼任银华中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

张亦驰先生：硕士学位。曾就职于中国工商银行北京市分行电子银行中心。2015年10月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2021年5月25日至2023年9月27日担任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金、银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年5月25日起兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2021年11月23日起兼任银华华证ESG领先指数证券投资基金基金经理，自2022年6月20日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数

证券投资基金、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2022年6月20日至2023年9月27日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2022年11月21日起兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年4月7日起兼任银华中证500价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年7月11日起兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年9月6日起兼任银华上证科创板100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。自2023年12月1日起兼任银华中证2000增强策略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：中信证券股份有限公司（简称：中信证券）

注册地址：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

法定代表人：张佑君

成立日期：1995年10月25日

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：14,820,546,829元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：95548-3

信息披露负责人：杨军智

2、基金托管业务经营情况

中信证券于2014年10月经中国证监会核准获批证券投资基金托管资格。中信证券自取得证券投资基金托管资格以来，秉承“忠于所托，信于所管”的宗旨，严格遵守国家的有关法律法规和监管机构的有关规定，依靠科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的运营系统和专业的服务团队，切实履行资产托管人职责，为基金管理人和投资者提供安全、高效、专业的托管服务。

（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：陈熹、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 2023 年 12 月 5 日资产负债表（未经审计）如下：

银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金	
2023 年 12 月 5 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	201,338,171.81
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	31,459,864.53
其中：股票投资	31,459,864.53
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	
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	8,705.00
资产总计	232,806,741.34

负债和净资产	
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	9,869,963.59
应付赎回款	
应付管理人报酬	12,243.98
应付托管费	2,448.79
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	11,068.42
负债合计	9,895,724.78
净 资 产：	
实收基金	223,462,705.00
其他综合收益	
未分配利润	-551,688.44
净资产合计	222,911,016.56
负债和净资产总计	232,806,741.34
截至 2023 年 12 月 5 日，银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值为 0.9975 元。	

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。

截至公告前两个工作日即 2023 年 12 月 5 日，银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金：

（一）基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	31,459,864.53	13.51
	其中：股票	31,459,864.53	13.51
2	基金投资		
3	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
4	贵金属投资		
5	金融衍生品投资		
6	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	201,338,171.81	86.48
8	其他各项资产	8,705.00	0.00
9	合计	232,806,741.34	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、2023 年 12 月 5 日指数投资按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业分类	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	200,955.00	0.09%
B	采矿业		
C	制造业	21,276,334.02	9.54%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	180,441.00	0.08%
E	建筑业	240,848.00	0.11%
F	批发和零售业	1,050,592.00	0.47%
G	交通运输、仓储和邮政业	272,558.00	0.12%
H	住宿和餐饮业	83,590.00	0.04%
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,846,794.05	1.73%
J	金融业		
K	房地产业	372,746.00	0.17%

L	租赁和商务服务业	323,639.00	0.15%
M	科学研究和技术服务业	1,213,636.16	0.54%
N	水利、环境和公共设施管理业	213,424.00	0.10%
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育	106,228.00	0.05%
Q	卫生和社会工作	119,298.00	0.05%
R	文化、体育和娱乐业	531,346.00	0.24%
S	综合	61,614.00	0.03%
	合计	30,094,043.23	13.50%

2、2023年12月5日积极投资按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业分类	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	902,437.80	0.40%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业	23,540.00	0.01%
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业	298,525.30	0.13%
J	金融业		
K	房地产业	70,325.00	0.03%
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业	70,993.20	0.03%
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	1,365,821.30	0.61%

3、2023年12月5日按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金2023年12月5日未持有港股通股票投资。

(三) 2023年12月5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、2023年12月5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	300292	吴通控股	79,500.00	314,025.00	0.14%
2	600609	金杯汽车	45,900.00	238,680.00	0.11%
3	688697	纽威数控	11,430.00	223,799.40	0.10%
4	002198	嘉应制药	27,100.00	203,792.00	0.09%
5	600757	长江传媒	22,200.00	177,378.00	0.08%
6	000823	超声电子	18,700.00	175,780.00	0.08%
7	300380	安硕信息	6,800.00	175,576.00	0.08%
8	002296	辉煌科技	20,900.00	173,470.00	0.08%
9	688509	正元地信	33,494.00	167,470.00	0.08%
10	605366	宏柏新材	20,300.00	164,633.00	0.07%

2、2023年12月5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	300454	深信服	900.00	74,430.00	0.03%
2	002645	华宏科技	6,700.00	73,834.00	0.03%
3	688353	华盛锂电	2,493.00	72,396.72	0.03%
4	688426	康为世纪	2,383.00	72,228.73	0.03%
5	300709	精研科技	2,300.00	71,737.00	0.03%

（四）2023年12月5日按债券品种分类的债券投资组合

2023年12月5日，本基金未持有债券。

（五）2023年12月5日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

2023年12月5日，本基金未持有债券。

（六）2023年12月5日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

2023年12月5日，本基金未持有资产支持证券。

（七）2023年12月5日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

2023年12月5日，本基金未持有权证。

（八）2023年12月5日本基金投资的股指期货交易情况说明

2023年12月5日，本基金未持有股指期货。

本基金自基金合同生效日至2023年12月5日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自基金合同生效日至 2023 年 12 月 5 日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。

2、自基金合同生效日至 2023 年 12 月 5 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	
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	8,705.00
7	待摊费用	
8	其它	
合计		8,705.00

4、2023 年 12 月 5 日持有的处于转股期的可转换债券明细

2023 年 12 月 5 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、2023 年 12 月 5 日前十名股票中存在流通受限情况的说明

2023 年 12 月 5 日，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

2023 年 12 月 5 日，本基金积极投资的前五名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金管理人于2023年11月29日发布《银华基金管理股份有限公司关于银华中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金可投资科创板股票的公告》，本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

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、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、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、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价的计算、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、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中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件；

（二）《银华中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（三）《银华中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

（四）《银华中证2000增强策略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中证2000增强策略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

2023年12月7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；

(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，但向监管机构、司法机关提供或因审计、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(税后)在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人,募集期间网下股票认购所冻结的股票应予以解冻;

(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》、《托管协议》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》、《托管协议》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》、《托管协议》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》、《托管协议》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》、《托管协议》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，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、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) 从基金管理人处接收并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》、《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(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) 交纳基金认购款项或股票、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) 遵守中华人民共和国反洗钱法律法规，配合基金管理人、基金托管人履行反洗钱职责；

(12) 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。

（二）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（但本基金合同另有约定的除外）。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在基金份额持有人大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。

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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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。

（三）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。除法律法规、监管机构另有规定或本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、深圳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，基金管理人在与基金托管人协商一致后可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、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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

（二）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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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。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（含主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、地方政府债券、政府支持机构债券、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）、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、衍生工具（股指期货、股票期权）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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或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，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例，新纳入的投资品种的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。

建仓完成后，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规或中国证监会变更相关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或按变更后的规定执行。

（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) 建仓完成后，本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照指数的构成比例进行投资的基金品种不受前述限制；

(3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(4) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(5) 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；

(6) 本基金资产总值不超过本基金资产净值的 140%；

(7) 本基金参与股指期货交易的，需遵循以下投资比例限制：

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%；

(8) 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；

(9) 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%；

(10) 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；

(11) 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以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；

(12) 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；

(13) 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%；

(14) 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 个月内日均基金资产净值不得低于 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；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(18) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

除上述(10)、(11)、(12)、(14)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 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。本基金参与转融通证券出借业务，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(14)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。

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或按变更后的规定执行。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后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。若法律法规发生变化，则以变化后的规定为准。

（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、基金发生《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市情形的；

5、连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的；

6、基金合同约定的其他情形；

7、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：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。

(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剩余财产中支付。

(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，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。

(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。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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、律师费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，基金管理人和基金托管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

基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构两份外，基金管理人、基金托管人各持有两份，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。