

**华泰柏瑞中证全指自由现金流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： 华泰柏瑞基金管理有限公司**

**基金托管人： 招商银行股份有限公司**

**上市时间： 2025年4月30日**

**公告日期： 2025年4月25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.....	4
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.....	9
六、基金合同摘要.....	16
七、基金财务状况（未经审计） .....	18
八、基金投资组合.....	20
九、重大事件揭示.....	22
十、基金管理人承诺.....	22
十一、基金托管人承诺.....	24
十二、基金上市推荐人意见.....	25
十三、备查文件目录.....	26
附录：基金合同摘要 .....	27

## 一、重要声明与提示

华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）托管人招商银行股份有限公司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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容，请详细阅读2025年4月9日披露在基金管理人网站([www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com))和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csfc.gov.cn/fund>)上的《华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金二级市场交易简称：现金基金（扩位证券简称：现金流ETF全指）
- 3、二级市场交易代码：563390
- 4、基金申购、赎回简称：现金基金
- 5、申购、赎回代码：563390
- 6、截止公告日前两个工作日即2025年4月23日基金份额总额：  
1,052,844,000.00份
- 7、截止公告日前两个工作日即2025年4月23日基金份额净值：1.0001元
- 8、本次上市交易份额：1,052,844,000.00份
- 9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 10、上市交易日期：2025年4月30日
- 11、基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
- 12、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 13、上市推荐人：华宝证券股份有限公司
- 14、申购赎回代办券商(以下简称“一级交易商”):渤海证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、联储证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股

份有限公司。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

### 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证监许可[2025]660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、发售日期为2025年4月14日至2025年4月18日。网下现金发售的日期为2025年4月14日至2025年4月18日，网上现金发售的日期为2025年4月14日至2025年4月18日，本基金暂不开通网下股票认购。
- 5、发售价格：1.00元人民币。
- 6、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购，本基金暂不开通网下股票认购。

#### 7、发售机构

##### (1) 网上现金发售代理机构

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

##### (2) 网下现金发售直销机构

华泰柏瑞基金管理有限公司

##### (3) 网下现金发售代理机构

序号	机构名称	客服电话	公司网址
1	中信证券股份有限公司	95548	www.cs.ecitic.com
2	中信证券华南股份有限公司	95548	www.gzs.com.cn
3	中信证券(山东)有限责任公司	95548	sd.citics.com
4	招商证券股份有限公司	95565	www.newone.com.cn
5	中信建投证券股份有限公司	95587/4008-888-108	www.csc108.com

#### (二) 基金合同生效

截至2025年4月18日本基金募集工作顺利结束。经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资，本次募集确认的募集金额为1,052,844,000.00元人民币，折合基金份额1,052,844,000.00份；其中募集期间认购资金利息折合基金份额的

共计0.00份。募集资金已于2025年4月23日全额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10,813户，按照每份基金份额初始面值人民币1.00元计算，本次募集期间有效认购份额和利息结转的基金份额合计1,052,844,000.00份，已全部计入相应基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。本基金管理人及本公司的基金从业人员没有认购本基金。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《华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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完毕基金备案手续，并于2025年4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[2025]99号。

2、上市交易日期：2025年4月30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：现金基金（扩位简称：现金流ETF全指）。

5、二级市场交易代码：563390。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本基金的二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：现金基金。

7、申购、赎回代码：563390。

本基金管理人自2025年4月30日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易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：

序号	券商名称	客服电话	公司网址
1	渤海证券股份有限公司	956066	www.ewww.com.cn
2	东北证券股份有限公司	95360	www.nesc.cn
3	东莞证券股份有限公司	95328	www.dgzq.com.cn
4	东海证券股份有限公司	95521	www.gtht.com
5	东吴证券股份有限公司	400-860-1555 或 96288	www.dwzq.com.cn

6	东兴证券股份有限公司	400-888-8993	www.dxzq.net
7	方正证券股份有限公司	95584	www.hx168.com.cn
8	光大证券股份有限公司	95525	www.ebscn.com
9	广发证券股份有限公司	95564	www.ykzq.com
10	国金证券股份有限公司	95310	www.gjzq.com
11	国盛证券有限责任公司	956080	www.gszq.com
12	国泰海通证券股份有限公司	95521	www.gtht.com
13	国投证券股份有限公司	400-800-1001	www.essence.com.cn
14	国信证券股份有限公司	95536	www.guosen.com.cn
15	华安证券股份有限公司	400-809-6518	www.hazq.com
16	华创证券有限责任公司	400-866-6689	www.hczq.com
17	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
18	华西证券股份有限公司	95584	www.hx168.com.cn
19	联储证券股份有限公司	0532-80958800	www.lczq.com
20	平安证券股份有限公司	95328	www.dgzq.com.cn
21	申万宏源西部证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
22	申万宏源证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
23	西部证券股份有限公司	95582	www.west95582.com
24	西南证券股份有限公司	95355	www.swsc.com.cn
25	湘财证券股份有限公司	95351	www.xcsc.com
26	兴业证券股份有限公司	95562	www.xyzq.com.cn
27	粤开证券股份有限公司	95564	www.ykzq.com
28	长城证券股份有限公司	400-666-6888	www.cgws.com
29	招商证券股份有限公司	95565	www.newone.com.cn
30	浙商证券股份有限公司	95345	www.stocke.com.cn
31	中国国际金融股份有限公司	400-910-1166	www.cicc.com.cn
32	中国银河证券股份有限公司	400-809-6518 (全国) 96518 (安徽)	www.hazq.com
33	中国中金财富证券有限公司	(0755) 33680000、400-6666-888	www.cgws.com
34	中泰证券股份有限公司	95538	www.zts.com.cn
35	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com
36	中信证券(山东)有限责任公司	95548	sd.citics.com
37	中信证券股份有限公司	95548	www.cs.ecitic.com
38	中信证券华南股份有限公司	95548	www.gzs.com.cn

8、本次上市交易份额：1,052,844,000.00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2025年4月23日，本基金份额持有人户数为10,813户，平均每户持有的基金份额为97,368.35份。

### (二) 持有人结构

截至2025年4月23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89,683,000.00份，占基金总份额的8.52%；个人投资者持有的基金份额为963,161,000.00份，占基金总份额的91.48%。

### (三) 前十名基金份额持有人的情况：

截至2025年4月23日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额 (份)	占总份额比 例 (%)
1	深圳市亿鑫投资有限公司	10,000,000.00	0.95%
2	上海粒子跃动私募基金管理有限公司—粒子希格斯5号私募证券投资基金管理人	6,000,000.00	0.57%
3	楼建纬	5,200,000.00	0.49%
4	刘永志	5,100,000.00	0.48%
5	湛湧	5,000,000.00	0.47%
6	佛山市顺德区盈骏置业有限公司	5,000,000.00	0.47%
7	深圳华尔资本管理有限公司—华尔创新1号私募证券投资基金管理人	4,000,000.00	0.38%
8	廖国礼	3,000,000.00	0.28%
9	蔡振武	3,000,000.00	0.28%
10	王力展	3,000,000.00	0.28%
11	陈拓璞	3,000,000.00	0.28%
12	鲍海丽	3,000,000.00	0.28%
13	深圳福汇资本管理有限公司—福汇资本三号私募证券投资基金管理人	3,000,000.00	0.28%
14	广州市航长投资管理有限公司—航长红棉2号A私募证券投资基金管理人	3,000,000.00	0.28%
15	上海展弘投资管理有限公司—展弘稳泰对冲运作7号私募证券投资基金管理人	3,000,000.00	0.28%

16	国证资管—廖昌清—安信资管创赢 13 号单一资产管理计划	3,000,000.00	0.28%
----	------------------------------	--------------	-------

## 五、基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

- 1、名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
- 2、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层
- 3、法定代表人：贾波
- 4、总经理：韩勇
- 5、成立日期：2004 年 11 月 18 日
- 6、批准设立机关：中国证券监督管理委员会
- 7、批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号
- 8、工商登记注册的法人营业执照文号：913100007178517770
- 9、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
- 10、组织形式：有限责任公司
- 11、注册资本：贰亿元人民币
- 12、存续期间：持续经营
- 13、信息披露负责人：刘万方  
联系电话：400-888-0001，（021）38601777
- 14、股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

### 15、内部组织结构及职能：

公司设立了权益投资决策委员会、固定收益投资决策委员会、专户投资决策委员会、基金中基金（FOF）投资决策委员会、基金投资顾问业务投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。权益投资决策委员会、固定收益投资决策委员会、专户投资决策委员会、基金中基金（FOF）投资决策委员会、基金投资顾问业务投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

目前，公司下设 33 个部门，并在北京、深圳分别设立了分公司。

**投资一部：**负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

**投资二部：**负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

**投资三部：**负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

**投资四部：**负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

**专户投资部：**负责公司权益专户投资相关业务。

**研究部：**负责权益类基金的股票研究。

**固定收益部：**负责公司固定收益的投资管理。

**机构投资管理部：**负责专户的理财管理，对内管理服务机构销售人员。

**指数投资部：**负责指数研究、设计和开发工作，以及进行指数产品的投资管理。

**量化与海外投资部：**负责量化和海外 QDII 产品的投资管理。

**资产配置部：**负责基金投资顾问业务、FOF 业务。

**交易部：**负责根据投资决策委员会制定的原则进行交易指令执行与监督。

**华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心（深圳分公司）、华北营销中心（北京分公司）、西南营销中心：**负责基金销售。

**机构业务部（北京）、机构业务部（上海）、机构业务部（深圳）：**负责机构客户的业务拓展。

**券商业务部：**负责券商客户的业务拓展。

**市场营销部：**负责公司品牌、基金产品的市场推广服务。

**销售管理部：**负责对外开拓维护渠道总部，对内管理服务渠道销售人员。

**客户服务部：**负责公司的客户服务。

**产品与业务发展部：**负责基金产品研发等新业务拓展。

**基金事务部：**负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

**信息技术部：**负责公司信息系统的日常运行与开发。

**电子商务部：**负责线上营销业务的业务开展。

**合规法律部：**负责内部法律事务咨询，处理外部法律事务，检查公司管理及

基金运作符合国家法律法规规定的情况，负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。

**风险管理部：**负责投资、交易环节风险提示及控制，研究公司风险管理政策与方针，协调各部门处理公司层面风险事项。

**人力资源部：**负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。

**综合管理部：**负责公司后勤服务、公文档案管理。

**财务部：**负责公司财务事项。

#### 16、人员情况：

截至 2025 年 4 月 22 日，本公司共有员工 319 人。其中，投资研究团队共有人员 93 名，全公司取得基金从业资格的有 310 人。公司高级管理人员和从事研究、投资、估值、营销、监察稽核等业务的主要业务人员都已取得基金从业资格。在所有公司人员中，研究生及以上学历共有 246 人，占 77%；本科学历 65 人，占 20%。

#### 17、基金管理业务情况简介：

截至 2025 年 3 月 31 日，公司旗下管理 171 只开放式基金，其中包括 63 只股票型基金、61 只混合型基金、25 只债券型基金、3 只货币型基金、14 只 QDII 基金、2 只另类投资基金、3 只基金中基金。公司管理的基金资产规模为 6500.88 亿元，总份额规模为 3793.15 亿份。

#### 18、本基金基金经理：

胡亦清先生，硕士毕业于美国东北大学应用数学专业。2014 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任风险分析员、高级风险分析师、指数投资部高级研究员、总监助理兼投资经理。2025 年 1 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞北证 50 成份指数量型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

### （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：4006195555

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张姗

## 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2024年9月30日，本集团总资产116,547.63亿元人民币，高级法下资本充足率18.67%，权重法下资本充足率15.33%。

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，现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队10个职能团队，现有员工249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管理业务资格，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之一，拥有证券投资基金管理资格、基本养老保险基金托管机构资格、受托投资管理托管业务托管资格、保险资金托管业务资格、企业年金基金托管业务资格、合格境外机构投资者托管（QFII）资格、

合格境内机构投资者托管（QDII）资格、私募基金业务外包服务资格、存托凭证试点存托业务等业务资格。

招商银行资产托管结合自身在托管行业深耕 22 年的专业能力和创新精神，推出“招商银行托管+”服务品牌，以“践行价值银行战略，致力于成为服务更佳、科技更强、协同更好的客户首选全球托管银行”品牌愿景为指引，以“值得信赖的专家、贴心服务的管家、让价值持续增加、客户的体验更佳”的“4+目标”，以创新的“服务产品化”为方法论，全方位助力资管机构实现可持续的高质量发展。招商银行资产托管围绕资管全场景，打造了“如风运营”“大观投研”“见微数据”三个服务子品牌，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“6S”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，近年来获得业内各类奖项荣誉。2016 年 5 月“托管通”荣获《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；6 月荣获《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；7 月荣获中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”、《21 世纪经济报道》“2016 最佳资产托管银行”。2017 年 5 月荣获《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；6 月荣获《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”。2018 年 1 月荣获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；同月，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 月荣获《中国基金报》“最佳基金托管银行”奖；5 月荣获国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣获 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，荣获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》“中国境内最佳托管机构”“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》第二届中国公募基金英华奖“2019年度最佳基金托管银行”奖。2021年1月，荣获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；同月荣获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，《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”奖项；9月荣获《财资》“中国最佳托管银行”“最佳公募基金托管银行”“最佳理财托管银行”三项大奖；12月荣获《证券时报》“2022年度杰出资产托管银行天玑奖”；2023年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2022年度优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司“2022年度优秀托管机构”、全国银行间同业拆借中心“2022年度银行间本币市场托管业务市场创新奖”三项大奖；2023年4月，荣获《中国基金报》第二届中国基金业创新英华奖“托管创新奖”；2023年9月，荣获《中国基金报》中国基金业英华奖“公募基金25年基金托管示范银行（全国性股份行）”；2023年12月，荣获《东方财富风云榜》“2023年度托管银行风云奖”。2024年1月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2023年度优秀资产托管机构”、“2023年度估值业务杰出机构”、“2023年度债市领军机构”、“2023年度中债绿债指数优秀承销机构”四项大奖；2024年2月，荣获泰康养老保险股份有限公司“2023年度最佳年金托管合作伙伴”奖。2024年4月，荣获中国基金报“中国基金业英华奖-ETF20周年特别评选“优秀ETF托管人””奖。2024年6月，荣获上海清算所“2023年度优秀托管机构”奖。2024年8月，在《21世纪经济报道》主办的2024资产管理年会暨十七届21世纪【金贝】资产管理竞争力研究案例发布盛典上，“招商银行托管+”荣获“2024卓越影响力品牌”奖项；2024年9月，在2024财联社中国金融业“拓扑奖”评选中，荣获银行业务类奖项“2024年资产托管银行‘拓扑奖’”。

### （三）上市推荐人

华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

法定代表人：刘加海

客服电话：021-68777222

公司网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

#### （四）一级交易商

序号	券商名称	客服电话	公司网址
1	渤海证券股份有限公司	956066	<a href="http://www.ewww.com.cn">www.ewww.com.cn</a>
2	东北证券股份有限公司	95360	<a href="http://www.nesc.cn">www.nesc.cn</a>
3	东莞证券股份有限公司	95328	<a href="http://www.dgzq.com.cn">www.dgzq.com.cn</a>
4	东海证券股份有限公司	95521	<a href="http://www.gtht.com">www.gtht.com</a>
5	东吴证券股份有限公司	400-860-1555 或 96288	<a href="http://www.dwzq.com.cn">www.dwzq.com.cn</a>
6	东兴证券股份有限公司	400-888-8993	<a href="http://www.dxzq.net">www.dxzq.net</a>
7	方正证券股份有限公司	95584	<a href="http://www.hx168.com.cn">www.hx168.com.cn</a>
8	光大证券股份有限公司	95525	<a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>
9	广发证券股份有限公司	95564	<a href="http://www.ykzq.com">www.ykzq.com</a>
10	国金证券股份有限公司	95310	<a href="http://www.gjzq.com">www.gjzq.com</a>
11	国盛证券有限责任公司	956080	<a href="http://www.gszq.com">www.gszq.com</a>
12	国泰海通证券股份有限公司	95521	<a href="http://www.gtht.com">www.gtht.com</a>
13	国投证券股份有限公司	400-800-1001	<a href="http://www.essence.com.cn">www.essence.com.cn</a>
14	国信证券股份有限公司	95536	<a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>
15	华安证券股份有限公司	400-809-6518	<a href="http://www.hazq.com">www.hazq.com</a>
16	华创证券有限责任公司	400-866-6689	<a href="http://www.hczq.com">www.hczq.com</a>
17	华泰证券股份有限公司	95597	<a href="http://www.htsc.com.cn">www.htsc.com.cn</a>
18	华西证券股份有限公司	95584	<a href="http://www.hx168.com.cn">www.hx168.com.cn</a>
19	联储证券股份有限公司	0532-80958800	<a href="http://www.lczq.com">www.lczq.com</a>
20	平安证券股份有限公司	95328	<a href="http://www.dgzq.com.cn">www.dgzq.com.cn</a>
21	申万宏源西部证券有限公司	95523 或 4008895523	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>
22	申万宏源证券有限公司	95523 或 4008895523	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>
23	西部证券股份有限公司	95582	<a href="http://www.west95582.com">www.west95582.com</a>
24	西南证券股份有限公司	95355	<a href="http://www.swsc.com.cn">www.swsc.com.cn</a>
25	湘财证券股份有限公司	95351	<a href="http://www.xcsc.com">www.xcsc.com</a>
26	兴业证券股份有限公司	95562	<a href="http://www.xyzq.com.cn">www.xyzq.com.cn</a>
27	粤开证券股份有限公司	95564	<a href="http://www.ykzq.com">www.ykzq.com</a>
28	长城证券股份有限公司	400-666-6888	<a href="http://www.cgws.com">www.cgws.com</a>
29	招商证券股份有限公司	95565	<a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a>
30	浙商证券股份有限公司	95345	<a href="http://www.stocke.com.cn">www.stocke.com.cn</a>
31	中国国际金融股份有限公司	400-910-1166	<a href="http://www.cicc.com.cn">www.cicc.com.cn</a>
32	中国银河证券股份有限公司	400-809-6518 (全国) 96518 (安徽)	<a href="http://www.hazq.com">www.hazq.com</a>
33	中国中金财富证券有限公司	(0755) 33680000、400-6666-888	<a href="http://www.cgws.com">www.cgws.com</a>
34	中泰证券股份有限公司	95538	<a href="http://www.zts.com.cn">www.zts.com.cn</a>

35	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com
36	中信证券(山东)有限责任公司	95548	sd.citics.com
37	中信证券股份有限公司	95548	www.cs.ecitic.com
38	中信证券华南股份有限公司	95548	www.gzs.com.cn

### (五) 基金验资机构

机构名称： 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址： 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

经办注册会计师： 许培菁、张亚旎

联系人： 许培菁

联系电话： 010-58153000

传真： 010-85188298

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

## 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从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

### (二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至本公告书公告前无重要财务事项发生。

### (三) 基金资产负债表

本基金截至2025年4月23日的资产负债表如下：

资产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资产：		负债：	
银行存款	1,052,854,235.98	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	
基金投资		应付托管费	
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息		应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	1,052.81
其他资产	53,678.64	负债合计	1,052.81
		所有者权益：	
		实收基金	1,052,844,000.00
		未分配利润	62,861.81
		所有者权益合计	1,052,906,861.81
资产合计：	1,052,907,914.62	负债与持有人权益总计：	1,052,907,914.62

注：1、截至2025年4月23日，基金份额净值1.0001元，基金份额总额1,052,844,000.00份。

2、本报告期自2025年4月23日起至2025年4月23日止。本基金合同于2025年4

月23日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

## 八、基金投资组合

截至2025年4月23日，本基金的投资组合情况如下：

### (一) 基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例（%）
权益投资		
其中：股票		
固定收益投资		
其中：债券		
资产支持证券		
金融衍生品投资		
买入返售金融资产		
其中：买断式回购的买入返售金融资产		
银行存款和结算备付金合计	1,052,854,235.98	99.99
其他各项资产	53,678.64	0.01
合计	1,052,907,914.62	100.00

### (二) 按行业分类的股票投资组合

截止2025年4月23日，本基金未持有股票。

### (三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

截止2025年4月23日，本基金未持有股票。

### (四) 按债券品种分类的债券投资组合

截止2025年4月23日，本基金未持有债券。

### (五) 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2025年4月23日，本基金未持有债券。

### (六) 投资组合报告附注

1、自本基金合同生效日至2025年4月23日，本基金前十名证券的发行主体中无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易

所公开谴责、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	应收股利	
2	应收利息	
3	其他资产	53,678.64
	合计	53,678.64

4、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细  
截止2025年4月23日，本基金未持有资产支持证券。

5、本报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

截止2025年4月23日，本基金未持有可转换债券。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差

7、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。

## 九、重大事件揭示

本基金自基金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

基金管理人就本基金上市交易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、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

基金托管人就华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

在本基金上市后，我行承诺严格遵照《基金法》等相关法规以及《华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的约定履行相应职责。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人华宝证券股份有限公司。上市推荐人就本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》和《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) 《华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《华泰柏瑞中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 法律意见书。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

风险提示：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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2025年4月25日

## 附录：基金合同摘要

### （一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、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、非交易过户、转托管等业务规则；
- (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、申购和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需要提供的情况除外；

(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，同时将已冻结的股票解冻；

(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。

3、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，如发现基金管理人有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，有权呈报中国证监会，并可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和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。

4、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需要提供的情况除外；

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

(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；如果基金管理人有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) 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。

5、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。

6、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购、申购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) 遵守基金管理人、销售机构、证券交易所和登记机构的相关交易及业务规则；
- (10) 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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，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，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，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。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表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，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以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。

联接基金的基金管理人代表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，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，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，由联接基金的基金管理人代表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。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

### 1、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、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

- 1) 终止基金合同；
- 2) 更换基金管理人；
- 3) 更换基金托管人；
- 4) 转换基金运作方式；
- 5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 6) 变更基金类别；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- 9) 变更基金份额持有人大会程序；
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- 13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- 1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 2) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率或收费方式、调整基金份额类别；
- 3) 因相应的法律法规、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；
- 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变化；

- 5) 在法律法规和中国证监会允许范围内，调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 6) 基金管理人履行适当程序后，基金推出新业务或服务；
- 7) 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。

## 2、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。

## 3、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。

#### 4、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大会公告载明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大会公告载明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少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的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) 在法律法规及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、电话或其他监管机构允许的方式进行表决,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,授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式,具体方式在会议通知中列明。

## 5、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7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。

## 6、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、中国证监会另有规定或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。

## 7、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

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

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

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

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

## (2) 通讯开会

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

## 8、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按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。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。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，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) 《基金合同》解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### 1、基金合同的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意并履行适当程序后变更并公告。

(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，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 2、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。

## 3、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。

## 4、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。

## 5、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。

#### 6、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。

#### 7、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，保存期限不低于法律法规的规定。

#### （四）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，应通过友好协商解决。各方当事人不愿通过协商解决或者协商不成的，任何一方当事人均应将争议提交深圳国际仲裁院，根据深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为深圳市，仲裁裁决是终局性的，并对相关各方当事人都具有约束力。仲裁费用、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，各方当事人应恪守各自的职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本合同适用中华人民共和国法律（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区的有关规定）并从其解释。

#### （五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

基金合同可印制成为册，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。