

# 鑫元中证电池主题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：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：中泰证券股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2026年8月12日

公告日期：2026年8月7日

## 目 录

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 一、重要声明与提示 .....            | 1  |
| 二、基金概览 .....               | 2  |
| 三、基金的募集与上市交易 .....         | 3  |
| 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 ..... | 6  |
| 五、基金主要当事人简介 .....          | 7  |
| 六、基金合同摘要 .....             | 11 |
| 七、基金财务状况 .....             | 12 |
| 八、基金投资组合 .....             | 14 |
| 九、重大事件揭示 .....             | 18 |
| 十、基金管理人承诺 .....            | 19 |
| 十一、基金托管人承诺 .....           | 20 |
| 十二、备查文件目录 .....            | 21 |
| 附件：基金合同摘要 .....            | 22 |

## 一、重要声明与提示

鑫元中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）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，鑫元基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“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。

本基金托管人中泰证券股份有限公司（以下简称“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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和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，投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读发布在本基金管理人网站（<http://www.xyamc.com>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的本基金招募说明书、基金产品资料概要。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：鑫元中证电池主题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、运作方式：交易型开放式
- 4、基金存续期限：不定期
- 5、基金简称：鑫元中证电池主题 ETF
- 6、基金二级市场交易简称及交易代码  
场内简称：电池 ETF 鑫元  
基金代码：159077
- 7、截至公告日前两个工作日的基金份额总额：截至 2026 年 8 月 5 日，本基金的基金份额总额为 208,242,574.00 份。
- 8、截至公告日前两个工作日的基金份额净值：截至 2026 年 8 月 5 日，本基金的基金份额净值为 1.0012 元。
- 9、本次上市交易的基金份额总额：截至 2026 年 8 月 5 日，本次上市交易的基金份额总额为 208,242,574.00 份。
- 10、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 11、上市交易日期：2026 年 8 月 12 日
- 12、基金管理人：鑫元基金管理有限公司
- 13、基金托管人：中泰证券股份有限公司
- 14、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

### 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：中国证监会证监许可〔2026〕1180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：本基金的募集期限为 2026 年 7 月 6 日至 2026 年 7 月 24 日。其中，网上现金认购的日期为 2026 年 7 月 6 日至 2026 年 7 月 24 日，网下现金认购的日期为 2026 年 7 月 6 日至 2026 年 7 月 24 日。

5、发售价格：1.00 元人民币。

6、发售方式：投资者可选择网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

7、发售机构

##### （1）网下现金认购直销机构

投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。

##### （2）网下现金认购发售代理机构

暂无。

##### （3）网上现金认购发售代理机构

投资者可通过以下具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务：爱建证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城国瑞、长城证券、长江证券、诚通证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、东莞证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联民生、国融证券、国盛证券、国泰海通、国投证券、国新证券、国信证券、国元证券、红塔证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华泰证券、华西证券、华源证券、华鑫证券、江海证券、金融街证券、金元证券、开源证券、联储证券、麦高证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源、申万宏源西部、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风

证券、天府证券、万和证券、万联证券、五矿证券、西部证券、西南证券、湘财证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券、甬兴证券（排名不分先后）。

如果会员单位有所增加或减少，请以深圳证券交易所的具体规定为准，基金管理人就不就此事项进行公告。

8、验资机构：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

9、募集资金总额及入账情况

本基金首次募集的网上现金净认购资金为人民币 208,220,000.00 元，无网下现金认购。有效认购资金于初始募集期内产生的利息金额为人民币 23,626.44 元，其中利息折份额金额为人民币 22,574.00 元，剩余人民币 1,052.44 归入基金资产，以上金额共计人民币 208,220,000.00 元已于 2026 年 7 月 29 日划至托管专户，剩余人民币 23,626.44 元将于下一个银行结息日后划入上述基金托管账户。

10、本基金备案情况

本基金于 2026 年 7 月 29 日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕。根据《基金法》及其配套法规和《鑫元中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件，基金合同于 2026 年 7 月 29 日正式生效。

（二）基金上市交易

1、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（2026）1099 号

2、上市交易日期：2026 年 8 月 12 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基金二级市场交易简称

场内简称：电池 ETF 鑫元

5、基金二级市场交易代码：159077

投资者在深圳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、本基金管理人自 2026 年 8 月 12 日开始办理本基金的申购和赎回业务。投资者应当在本基金指定的申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的申购赎回代理券商包括：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、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、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、江海证券有限公司、平安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司。

本基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

7、本次上市交易的基金份额总额：208,242,574.00 份。

8、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。

9、基金资产净值的披露：在本基金上市交易并开始办理基金份额申购赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网点以及营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在深圳证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### （一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即 2026 年 8 月 5 日，本基金份额持有人户数为 1844 户，平均每户持有的基金份额为 112,929.81 份。

##### （二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2026 年 8 月 5 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 61,274,018.00 份，占基金总份额的 29.42%；  
个人投资者持有的基金份额为 146,968,556.00 份，占基金总份额的 70.58%。

##### （三）前十名基金份额持有人的情况：

截至公告日前两个工作日即 2026 年 8 月 5 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<br>（份） | 占场内总份额比例<br>（%） |
|----|---------------------------------------|---------------|-----------------|
| 1  | 江苏新华日报基金管理有限公司—新华日报·同享2号私募证券投资基金      | 19,999,388.00 | 9.60%           |
| 2  | 乳山海乐水产有限公司                            | 12,001,516.00 | 5.76%           |
| 3  | 方正证券股份有限公司                            | 7,000,136.00  | 3.36%           |
| 4  | 中泰证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户                | 6,411,453.00  | 3.08%           |
| 5  | 刘俊涛                                   | 5,001,069.00  | 2.40%           |
| 6  | 郑兰                                    | 5,000,631.00  | 2.40%           |
| 7  | 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 | 5,000,097.00  | 2.40%           |
| 8  | 李智                                    | 4,300,510.00  | 2.07%           |
| 9  | 山东黑石澜山投资控股有限公司                        | 3,000,437.00  | 1.44%           |
| 10 | 彭燕萍                                   | 2,337,318.00  | 1.12%           |

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人概况

#### 1、基本情况

（1）名称：鑫元基金管理有限公司（以下简称“公司”或“鑫元基金”）

（2）住所：上海市静安区中山北路909号12层

（3）办公地址：上海市静安区中山北路909号12层

（4）法定代表人：龙艺

（5）总经理：于景亮

（6）信息披露负责人：李晓燕

（7）设立日期：2013年8月29日

（8）批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2013] 1115号

（9）组织形式：有限责任公司

（10）注册资本：人民币17亿元

（11）存续期限：持续经营

（12）联系电话：021-20892000

（13）工商登记注册的统一社会信用代码：9131000007649377XX

（14）经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### （15）股权结构：

| 股东名称       | 出资比例 |
|------------|------|
| 南京银行股份有限公司 | 80%  |
| 南京高科股份有限公司 | 20%  |
| 合计         | 100% |

#### 2、内部组织结构及职能

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，建立了由股东会、董事会和经理层组成的权责明确、运作顺畅、制衡有效的治理架构，能够切实维护基金投资者的合法权益。

股东会作为公司的权力机构，公司章程规定，股东通过股东会依法行使权利，承诺不越过股东会、董事会直接或间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作，切实维护公司经营的独立性和完整性。

董事会向股东会负责，由3名董事及3名独立董事组成，秉持基金份额持有人利益优先原则，进行战略性指导和科学决策。董事会下设三个委员会，分别为风控与合规委员会、提名与薪酬委员会、审计委员会，以增强决策的专业性、独立性和审慎性，不干预经营管理层的具体经营活动。

经理层由董事会聘任，负责公司的日常经营管理和投资运作。经理层在职责范围内独立、自主地开展工作，构建了清晰、完整的内部责任体系和报告路径，确保公司高效、合规运营。

在内部管理方面，公司持续完善内部控制体系，确保规范稳健运营。公司目前设置二十个一级部门，即固定收益部、权益投资部、量化投资部、多元资产投资部、市场研究部、交易部、机构销售部、渠道销售部、电商销售部、客户服务部、产品研发部、风险管理部、法律合规部、审计部、基金运营部、信息技术部、战略与品宣部、人力资源部、财务会计部、办公室。公司相继在北京、广州、海南设立分公司，从事区域市场营销和客户服务等工作。此外，鑫元基金还设立子公司鑫沅资产管理有限公司及孙公司上海鑫沅股权投资管理有限公司。

### 3、人员情况

截至2026年6月30日，公司共有员工222人，其中69%以上具有硕士及以上学历。

### 4、基金管理业务情况

截至2026年6月30日，公司旗下共管理111只公开募集证券投资基金，形成了覆盖不同产品类型和不同风险偏好的多层次产品体系。

### 5、本基金基金经理

莫志刚先生，学历：计算机技术硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任万家基金管理有限公司量化研究员，南华基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，西藏东财基金管理有限公司基金经理，华夏理财有限责任公司投资经理。2025年5月加入鑫元基金管理有限公司，历任基金经理助理，

现任基金经理。

现任鑫元中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、鑫元中证 800 自由现金流指数型证券投资基金、鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、鑫元中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、鑫元国证石油天然气指数型发起式证券投资基金、鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金、鑫元中证畜牧养殖产业交易型开放式指数证券投资基金、鑫元中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

## （二）基金托管人情况

### 1、基金托管人情况

名称：中泰证券股份有限公司（以下简称“中泰证券”）

住所：济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼

办公地址：山东省济南市经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼 35 层

法定代表人：王洪

成立时间：2001 年 05 月 15 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：791834.0996 万人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2015]3037 号

联系人：邵东

电话：0531-68889184

中泰证券股份有限公司（原名齐鲁证券有限公司）成立于 2001 年 5 月，是全国大型综合类上市券商（股票代码：600918），在全国 28 个省市自治区设有 45 家分公司、近 270 家营业部，员工 9000 多人，控股中泰期货、中泰资本、中泰国际、中泰资管、中泰创投、齐鲁股交、万家基金、中泰物业，形成了证券、期货、基金、投资等各项业务齐头并进的发展格局。

中泰证券主要经营证券经纪、承销与保荐、投资咨询、证券自营、财务顾问、融资融券、基金与金融产品代销、基金托管、股票期权做市等业务。截至 2025 年 6 月 30 日，公司服务财富管理客户超过 1030 万户，管理客户资产 1.41 万亿元。

公司连续 4 年股权承销单数保持市场前 10 位，是全市场投行业务质量、债券业务执业质量同时获得 A 类评价的 8 家券商之一。

## 2、主要人员情况

截至 2026 年 7 月 30 日，中泰证券托管部根据业务发展需要共设置了五个业务中心（产品管理中心、客户服务中心、托管服务中心、外包服务中心、营销服务中心）、四个业务团队（技术支持团队、内控管理团队、研究发展团队和综合管理团队），部门人员共计 96 人。其中，主要负责基金托管业务相关环节的是托管服务中心，托管服务中心目前员工 29 人，设置了估值核算岗、信息披露岗、投资监督岗、账户管理岗、资金交收岗、投资清算岗等岗位，对重要岗位建立了轮岗与备岗机制。

## 3、证券投资基金托管情况

中泰证券股份有限公司于 2015 年 12 月 24 日正式获得公募基金托管资格。中泰证券在获得公募基金托管资格后，稳步有序地开展了基金托管业务，在营业收入的同时也积累了业务经验，不断完善业务流程，为公募基金托管业务的上线夯实业务基础，并顺利开展了多只公募基金托管业务和商业银行理财产品托管业务。现托管产品类型已包括公募基金、银行理财、券商资管、期货资管、基金专户、私募证券投资基金、私募股权投资基金等。

### （三）基金验资机构

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01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

法定代表人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：许培菁

经办注册会计师：许培菁、李莉

## 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

基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

截至公告日前两个工作日即 2026 年 8 月 5 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2026 年 8 月 5 日 |
|-------------|-----------------------|
| <b>资 产：</b> |                       |
| 货币资金        | 531,312.82            |
| 结算备付金       | -                     |
| 存出保证金       | -                     |
| 交易性金融资产     | 20,910,452.77         |
| 其中：股票投资     | 20,910,452.77         |
| 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    | 187,000,000.00        |
| 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        | -                     |
| 应收申购款       | -                     |
| 递延所得税资产     | -                     |
| 其他资产        | 80,549.48             |

|               |                  |
|---------------|------------------|
|               |                  |
| 资产总计          | 208,522,315.07   |
| <b>负债和净资产</b> | 本期末<br>2026年8月5日 |
| <b>负 债：</b>   |                  |
| 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       | 14,267.88        |
| 应付托管费         | 2,853.58         |
| 应付销售服务费       | -                |
| 应付投资顾问费       | -                |
| 应交税费          | 1,437.08         |
| 应付利润          | -                |
| 递延所得税负债       | -                |
| 其他负债          | 7,487.20         |
| 负债合计          | 26,045.74        |
| <b>净资产：</b>   |                  |
| 实收基金          | 208,242,574.00   |
| 其他综合收益        | -                |
| 未分配利润         | 253,695.33       |
| 净资产合计         | 208,496,269.33   |
| 负债和净资产总计      | 208,522,315.07   |

注：截至2026年8月5日，基金份额净值1.0012元，基金份额总额208,242,574.00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。

截至公告日前两个工作日即2026年8月5日，本基金的投资组合情况如下：

### （一）报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 20,910,452.77  | 10.03            |
|    | 其中：股票             | 20,910,452.77  | 10.03            |
| 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          | 187,000,000.00 | 89.68            |
|    | 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      | 531,312.82     | 0.25             |
| 8  | 其他各项资产            | 80,549.48      | 0.04             |
| 9  | 合计                | 208,522,315.07 | 100.00           |

## （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1、报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 20,436,633.41 | 9.80         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 185,904.00    | 0.09         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| 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  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 164,260.00    | 0.08         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 123,655.36    | 0.06         |
| 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               | 20,910,452.77 | 10.03        |

### 2、报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

### 3、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## （三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1、报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 6,000  | 2,431,200.00 | 1.17         |
| 2  | 300274 | 阳光电源 | 16,400 | 1,775,300.00 | 0.85         |
| 3  | 002050 | 三花智控 | 33,600 | 1,324,176.00 | 0.64         |
| 4  | 300014 | 亿纬锂能 | 22,900 | 1,278,049.00 | 0.61         |
| 5  | 002709 | 天赐材料 | 21,400 | 835,670.00   | 0.40         |
| 6  | 605117 | 德业股份 | 7,700  | 644,952.00   | 0.31         |
| 7  | 002407 | 多氟多  | 17,700 | 580,737.00   | 0.28         |
| 8  | 300450 | 先导智能 | 16,400 | 576,952.00   | 0.28         |
| 9  | 002850 | 科达利  | 2,900  | 533,484.00   | 0.26         |
| 10 | 300037 | 新宙邦  | 7,900  | 529,300.00   | 0.25         |

2、报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

（四）报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未持有股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

3、其他资产构成如下：

| 序号 | 名称      | 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  | 其他应收款   | 23,626.44 |
| 7  | 待摊费用    | 56,923.04 |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 80,549.48 |

4、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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。

## 九、重大事件揭示

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

## 十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行基金管理人职责做出以下承诺：

（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

基金托管人就本基金上市交易后履行托管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、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产。

（二）根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、备查文件目录

(一)中国证监会准予鑫元中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件

(二)《鑫元中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《鑫元中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四)《鑫元中证电池主题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

(八)中国证监会要求的其他文件

存放地点：备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

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。

鑫元基金管理有限公司

2026年8月7日

## 附件：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

#### （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：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、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；若本基金采用证券经纪机构交易结算模式，基金管理人有权选择代表本基金进行场内交易、作为结算参与人代理本基金进行结算的证券经纪机构，并签订证券经纪服务协议；本基金管理人亦有权决定本基金证券交易模式的转换；

(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；

(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：

(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，但应监管机构、司法机关等有权机关或审计、法律等外部专业顾问要求提供的情况除外；

(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或监管机关规定的最低期限；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期满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后30日内退还基金认购人；投资者以股票认购的，相关股票的解冻按照《业务规则》的规定处理；

- (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：

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户和期货结算账户等投资所需账户，为基金办理场外证券/期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 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：

(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、证券账户和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，但应监管机构、司法机关等有权机关或审计、法律等外部专业顾问要求提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金净值信息、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或监管机关规定的最低期限；

(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，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：

- (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：

- (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认购股票、应付申购对价、现金差额及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金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。本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

ETF联接基金的基金合同生效后，鉴于本基金和ETF联接基金的相关性，ETF联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的ETF联接基金的基金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，ETF联接基金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，ETF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ETF联接基金份额占ETF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。

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

ETF联接基金的基金管理人代表ETF联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，须先遵照ETF联接基金基金合同的约定召开ETF联接基金的基金份额持有人大会，ETF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基金份额持有人大会的，由ETF联接基金的基金管理人代表ETF联

接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

(一) 召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (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) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；

(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或变更收费方式；

(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重大变化；

(5) 调整有关认购、申购、赎回、基金交易、非交易过户等业务规则；

(6) 调整基金的申购赎回方式：调整申购对价、赎回对价组成，调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(7) 基金管理人在履行适当程序后，推出新业务或服务；

(8) 增加、减少或调整基金份额类别，或调整基金份额分类办法及规则；

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

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

5、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30

日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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。通讯开会是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或系统。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、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行；基金份额持有人可以采用书面、网络、电话或其他方式进行表决或授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### (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依照《信息披露办法》的有关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。

（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）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

#### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金可供分配利润进行评价，当收益评价日核定的基金相对业绩比较基准的超额收益率或者基金可供分配利润金额大于0时，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式采用现金分红；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补浮动亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，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不能低于面值；

5、法律法规、监管机关、登记机构、深圳证券交易所另有规定的，从其规

定。

在不违反法律法规的规定、《基金合同》的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （五）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。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、公证费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货、期权交易或结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金相关账户的开户及维护费用；
- 9、基金上市初费及年费、登记结算费用、IOPV计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 10、因参与融资及转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由双方核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起前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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由双方核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月首日起前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第3-11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

#### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### （三）投资限制

## 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；

(2) 本基金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%；

(3) 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%；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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；

(7) 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；

(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；

(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) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

(11) 本基金参与融资业务的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

(12) 本基金投资股指期货的，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%；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%；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%；本基金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；

（13）本基金投资国债期货的，在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

（14）在本基金投资期货的任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（15）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

1）出借证券资产不得超过基金资产净值的30%，出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限资产的范围；

2）参与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；

5）因证券市场波动、证券发行人合并、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本条上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（16）本基金投资股票期权的，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%；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；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；

（17）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，法律法规或监管部门另有要求的除外；

(18) 每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和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；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(6)、(8)、(9)、(15)条约定以外，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。

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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，在基金管理人履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照变更后的规定执行。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （二）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值

进行调整并确定公允价值。

### （三）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等，另有规定的除外），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如有充足证据（最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的）表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价。交易所已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价；

（3）交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价；

（4）本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市值（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值；

（3）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按发行价估值；

（4）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股

票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价。对银行间市场上含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。

4、对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

5、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、本基金投资国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

9、本基金投资股票期权合约，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

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

11、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

12、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即

通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计主责任方由基金管理人担任，基金托管人承担复核责任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前且未上市交易的，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回或上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

### 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或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。

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。

#### （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个工作日内成立基金财产清算小组，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财产；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

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

### （四）清算费用

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

### （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并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规或监管机关规定的最低期限。

### 八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商或者调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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（为基金合同之目的，在此不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《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，但应以基金合同的正本为准。