

南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金上市交易公告书

南方基金管理有限公司

二一七年八月十日

目录

一、重要声明与提示	3
二、基金概览	4
三、基金的募集与上市交易	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	8
五、基金主要当事人简介	9
六、基金合同摘要	15
七、基金财务状况	16
八、基金投资组合	17
九、重大事件揭示	20
十、基金管理人承诺	21
十一、基金托管人承诺	22
十二、基金上市推荐人意见	23
十三、备查文件目录	24
附件：基金合同摘要	25

一、重要声明与提示

《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金上市交易公告书》（以下简称本公告）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称本基金）管理人南方基金管理有限公司（以下简称本基金管理人）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者阅读刊登在《证券时报》等报刊及南方基金管理有限公司网站（www.nffund.com）上的《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》。

二、基金概览

- 1、基金名称：南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金
- 2、基金二级市场交易简称：恒生联接
- 3、交易代码：501302
- 4、基金简称：恒生联接
- 5、基金份额总额：244,525,121.00份（截止：2017年8月8日）
- 6、基金份额净值：1.0014元（截止：2017年8月8日）
- 7、本次上市交易份额：29,072,176.00份
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

- 9、上市交易日期：2017年8月15日
- 10、基金管理人：南方基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司
- 12、上市推荐人：无

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 2015 年 7 月 22 日证监许可〔2015〕1756 号文。并于 2017 年 3 月 3 日获得证监会延期募集的备案的回函（机构部函〔2017〕574 号）

- 2、基金运作方式：契约型、上市开放式。
- 3、基金合同期限：不定期。
- 4、发售日期：2017 年 4 月 17 日至 2017 年 7 月 14 日。
- 5、发售价格：人民币 1.00 元。
- 6、发售期限：62 个工作日。
- 7、发售方式：场外、场内两种方式公开发售。
- 8、发售机构：

（1）场外销售机构：

1) 直销机构

南方基金管理有限公司

2) 代销机构

中国工商银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、乌鲁木齐银行股份有限公司、江苏江南农村商业银行股份有限公司、泉州银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、光大证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、湘财证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、信达证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、中山证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、中航证券有限公司、国盛证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、大同证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中天证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、联讯证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、泛华普益基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、海银基金

销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海汇付金融服务有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、中信建投期货有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、中信期货有限公司、北京乐融多源投资咨询有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、深圳富济财富管理有限公司、北京唐鼎耀华投资咨询有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司、济安财富（北京）资本管理有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京广源达信投资管理有限公司、上海云湾投资管理有限公司、深圳市金斧子投资咨询有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司。

上述排名不分先后。

（2）场内销售机构

场内代销机构为具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位。

（二）基金合同生效

本基金根据中国证监会 2015 年 7 月 22 日证监许可（2015）1756 号文注册，并于 2017 年 3 月 3 日获得证监会延期募集的备案的回函（机构部函（2017）574 号），自 2017 年 4 月 17 日起公开募集，截止 2017 年 7 月 14 日，基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的募集金额总额为 244,459,370.52 元人民币，折合基金份额 244,459,370.52 份；经基金登记结算机构确认结转为基金份额的募集期间认购资金利息共计 65,750.48 元人民币，折合基金份额 65,750.48 份，归基金份额持有人所有；募集资金已于 2017 年 7 月 19 日划入本基金在基金托管人中国工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 1667 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计 244,525,121.00 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本基金管理人南方基金管理有限公司基金从业人员认购本基金 10031.05 份，本公司高级管理人员、基金投资、研究部门负责人和基金经理认购本基金份额总量的数量区间为 0。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《南方恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2017 年 7 月 21 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（2017）245 号

2、上市交易日期：2017 年 8 月 15 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金简称：恒生联接

5、交易代码：501302

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易

6、基金场内申购、赎回简称：恒生联接

7、场内申购、赎回代码：501302

本基金管理人自 2017 年 8 月 15 日开始办理本基金的申购、赎回业务。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

8、本次上市交易份额：29,072,176.00 份（截至 2017 年 8 月 8 日）

9、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。跨系统转托管业务将于 2017 年 8 月 15 日开通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）场内持有人户数

截至 2017 年 8 月 8 日，本基金场内份额持有人户数为 233 户，平均每户持有的基金份额为 124,773.28 份。

（二）场内持有人结构

截至 2017 年 8 月 8 日，本基金场内份额持有人结构如下：

机构投资者持有的场内基金份额为 21,032,782.00 份，占基金场内总份额的 72.35%；个人投资者持有的场内基金份额为 8,039,394.00 份，占基金场内总份额的 27.65%。

（三）前十名场内基金份额持有人情况

截至 2017 年 8 月 8 日，前十名场内基金份额持有人情况如下表。

序号 基金份额持有人名称 持有份额（份） 占基金总份额的比例（%）

1	国泰君安证券股份有限公司	6,999,315.00	24.08%
2	方正证券股份有限公司	6,999,315.00	24.08%
3	广发证券股份有限公司	6,000,350.00	20.64%
4	广州市银国达资产管理有限公司—银国达广州私募证券投资基金	1,023,902.00	3.52%
5	马秀清	630,638.00	2.17%
6	康淑妍	513,977.00	1.77%
7	朱国涛	495,093.00	1.70%
8	邬宁琳	495,071.00	1.70%
9	邬明云	396,057.00	1.36%
10	隋德祥	396,055.00	1.36%
	合计	23,949,773.00	82.38%

供部

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：南方基金管理有限公司
- 2、法定代表人：张海波
- 3、总裁：杨小松
- 4、注册资本：3 亿元人民币
- 5、住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]4 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码 91440300279533137K
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
- 9、股权结构：华泰证券股份有限公司 45%；深圳市投资控股有限公司 30%；厦门国际信托有限公司 15%；兴业证券股份有限公司 10%。
- 10、内部组织结构及职能：

部门名称	主要职责
宏观研究与资产配置部	1.负责集团层面的宏观策略研究及大类资产配置研究
	2.建立研究资源共享平台，将各体系研究成果在集团层面实现共享
	3.整合各研究部门的标准化研究资源，向集团各部门提供研究支持
	4.负责 FOF 产品的投资管理及基金研究

权益投资部 1.负责权益公募产品的投资管理

2.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

3.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

权益研究部 1.负责股票市场的行业与上市公司研究，提出投资建议并完成研究报告撰写

2.及时更新和维护股票池、研究数据以及研究模型

3.协助固定收益相关部门开展信用研究及可转债研究，并提出判断和建议

4.向销售市场相关部门提供研究支持服务

权益专户投资部 1.负责权益专户产品的投资管理

2.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

3.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

数量化投资部 1.负责主动量化策略公募产品的投资管理

2.根据量化模型，完成投资策略研究及择时研究工作，并提出判断和建议

3.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

4.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

指数投资部 1.负责被动指数公募产品的投资管理

2.根据量化模型，完成投资策略研究工作，并提出判断和建议

3.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

4.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

固定收益投资部 1.负责固定收益公募产品的投资管理

2.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

3.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

固定收益专户投资部 1.负责固定收益专户产品的投资管理

2.向全国社保理事会提供支持服务

3.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

4.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

现金投资部 1.负责货币、短期理财等公募产品的投资管理

2.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

3.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

固定收益研究部 1.负责可转债研究和信用研究，提出投资建议并完成研究报告撰写

2.向全国社保理事会提供支持服务

3.向销售市场相关部门提供研究支持服务

国际业务部 1.负责海外市场产品的研究、投资管理；

2.参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作

3.配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作

战略与产品

开发部 1.在战略与产品委员会的指导下，研究资产管理行业的发展战略，完成集团层面的战略规划撰写工作

2.研究国内外资产管理产品发展动态和创新趋势，进行产品创新、开发及储备，建设和维护公司产品库

3.负责公司创新业务的研究及孵化工作

公募产品管理部 1.负责公募业务线产品日常管理与维护工作

2.负责公募业务线产品的立项、制作、报批与管理等

专户产品管理部 1.负责专户产品日常管理与维护工作

2.负责专户业务线产品的立项、制作、报批与管理等

市场管理部 1.负责公募业务线下渠道的整体管理工作，包括线下渠道发展规划、渠道开拓及渠道日常服

务等

- 2.负责线下渠道的营销管理工作，包括渠道营销方案的制定、销售市场情况及销售数据分析等
- 3.负责分公司线下渠道的管理和协调工作，包括销售任务分配、考核指标下达、预算费用管理、交叉销售政策制定、培训支持等

机构业务部 1.负责专户业务线机构业务的销售管理、资源共享整合

- 2.根据公司机构业务经营目标和战略进行整体营销规划
- 3.对集团的机构业务提供专业服务与支持

养老金业务部 1.负责专户业务线养老金业务的销售管理、资源共享整合

- 2.根据公司养老金业务经营目标和战略进行整体营销规划
- 3.对集团的养老金业务提供专业服务与支持

北京、上海、深圳、南京、成都分公司

- 1.负责组织完成所辖片区的银行、财务公司、券商、保险、企事业单位及高净值人群的客户销售与拓展
- 2.开展资产创设业务与另类产品交叉销售工作
- 3.维护相关政府、监管机构和行业协会关系，提供相关接待及后勤服务
- 4.完成公司下达的预算指标和利润指标

合肥分公司

（理财中心） 1.履行理财中心相关职能

- 2.通过电话、网络等多种服务通道，为客户提供集理财咨询和资讯为一体的专业理财顾问服务

互联网金融部 1.负责公募业务线上渠道的整体管理工作，包括线上渠道发展规划、平台和网站建设及维护等

- 2.负责线上渠道的营销管理工作，包括线上渠道推广、线上渠道营销方案的制定、线上销售市场情况及销售数据分析等

企划部 1.负责集团品牌形象规划与实施

- 2.负责销售、宣传、活动等创意策划
- 3.为集团销售前台做好营销支持，提高公司的公众认知度和美誉度

客户关系部 1.建立客户沟通平台，为客户提供专业理财咨询服务；收集客户需求和反馈，处理客户投诉；

- 2.搭建客户分类分级服务体系，进行客户信息分析和挖掘；运用多种服务形式和服务手段，进行客户关系的有效维护

监察稽核部 1.统筹集团层面的内控体系规划，建设并完善集团法律合规和监察稽核体系

- 2.负责合规及运作风险的识别、评估、控制和应急处理，确保公司各项业务合规稳健运行
- 3.监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制情况、委员会的运作情况
- 4.为公司各项业务发展提供法律支持

风险管理部 1.统筹集团层面的风险管理规划，建设并完善集团风险管理系统和投资监控体系

- 2.负责操作风险管理：进行风险预防、评估、监控、报告，对风险处置情况进行持续跟踪
- 3.负责投资风险的识别、评估、控制、应急处理及产品业绩归因分析，为公司风险管理决策提供专业支持

交易管理部 1.负责组合交易和交易执行等策略的研究和制定

- 2.负责交易实施，降低交易成本、获得交易收益、防范交易过程中的风险
- 3.负责交易分析和新产品持续研究，提供相关交易支持

信息技术部 1.根据集团业务发展战略要求，完成集团信息系统的规划

- 2.负责集团信息系统的建设和应用开发，持续完善集团信息化建设
- 3.负责集团信息系统的运行维护，提升运营效率，支持集团业务发展

运作保障部 1.统筹集团层面的基金运营管理，搭建集团层面的统一运营服务平台

- 2.负责基金的投资清算、会计与估值、信息披露等基金会计工作

3.负责基金的注册登记、清算交收、数据统计及费用核算等工作

人力资源部

党委组织部 1.统筹集团层面的人力资源规划，制定集团人力资源政策

2.负责人力资源体系建设，实施人才招聘、培养、激励与保留，提供相关人力资源服务，支持公司业务发展

3.人力资源部与党委组织部合署办公，协助党委开展党员干部的选拔任用、管理监督、调整配备工作

党委办公室 1.统筹集团层面的制度梳理、流程管理和文件归档工作

2.负责公司公文流转、办公文秘、公司会议组织及会议事项督办等工作

3.负责行政后勤、招投标采购管理、基建管理、办公安全等保障类工作

4.负责董事会办公室、工会、公益事业等日常事务工作

5.办公室与党委办公室合署办公，协助党委领导处理日常党务工作，贯彻并跟进党委会决议执行情况，开展党员发展培养和党员先进性教育等工作

财务部 1.负责集团预算管理工作

2.执行集团财务规划、资本优化以及财务风险预警管理，对公司财务状况进行监控和分析

3.负责资金管理、会计核算、财务信息披露及税务管理，支持公司业务发展

11、人员情况：

截止到 2017 年 6 月，我公司共有员工 553 人，博士 14 人、硕士 369 人、本科 153 人、其他 17 人。

12、信息披露负责人：鲍文革

咨询电话：400-889-8899

13、基金管理业务情况简介：

截至 2017 年 6 月，南方基金管理有限公司旗下共管理 134 只开放式基金及多只专户产品、社保投资组合和企业年金投资组合，管理总资产规模约 6586 亿元人民币，旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南稳贰号、南方绩优、南方成份、南方多利、南方全球、南方隆元、南方盛元、南方价值、南方恒元、南方 300 联接、南方 500、深成 ETF、南方深成、南方策略、小康 ETF、南方小康、南方广利、南方金砖、南方成长、南方 10 年国债、南方保本、380ETF、南方 380、南方香港、南方消费、南方金利、南方润元、南方理财 14 天、南方高端装备、南方理财 60 天、南方安心、南方收益宝、500ETF、300ETF、南方永利、南方中票、南方稳利、南方丰元、南方聚利、南方医保、南方现金通、南方新优享、南方通利、中国梦基金、南方薪金宝、南方天元、南方启元、500 医药、南方绝对收益、理财金、恒指 ETF、南方产业活力、南方二元、南方创新经济、500 工业、500 原料、南方利淘、大数据 100、南方改革机遇、南方利鑫、南方利众、南方丰合、改革基金、高铁基金、大数据 300、500 信息、南方量化成长、互联基金、南方利达、南方消费活力、南方国策动力、南方香港成长、南方顺达、南方利安、南方荣光、南方顺康、南方弘利、南方瑞利保本、南方沪港深价值、南方益和保本、南方君选、南方日添益、亚洲美元债、南方驱动混合、南方安享绝对收益、南方新兴混合、南方卓享绝对收益、创业板 EF、南方创业板、南方原油、南方甄智混合、南方品质混合、南方荣毅、南方荣欢、南方荣冠、500 信息联接、南方转型混合、南方安泰养老、南方颐元、南方多元、1000ETF、南方天天利、南方荣发、南方卓元、南方安裕养老、南方荣安、南方中证 500 增强、南方宣利、南方安颐养老、南方睿见混合、南方和利、南方教育股票、南方宏元、南方军工混合、南方全指证券联接、证券投资基金、南方荣优、南方智慧混合、国企精明、南方和元、南方文旅混合、南方荣尊、南方纯元、南方荣知、南方高元、南方安康混合、银行基金、南方银行联接；以及多个专户产品、全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

7、本基金基金经理简介

罗文杰女士，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾

先后任职于美国 OpenLinkFinancial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金量化投资部基金经理助理，现任指数投资部、量化投资部负责人；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2016 年 12 月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2017 年 7 月至今，任恒生联接基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称中国工商银行）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

首次注册登记日期：1984 年 1 月 1 日

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

法定代表人：易会满

托管部门信息披露联系人：洪渊

传真：（010）66105798

中国工商银行客服电话：95588

2、基金托管部门及主要人员情况

截至 2016 年 12 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 207 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、证券投资基金托管情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承诚实信用、勤勉尽责的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 681 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 51 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）上市推荐人

无

（四）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：薛竞、陈熹

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一) 基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

(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

本基金 2017 年 8 月 8 日资产负债表如下:

单位: 人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
----	------	----------	------

资产: 负债:

银行存款 872,213.71 短期借款

结算备付金 1,778,095.24 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 26,823.80

基金投资 应付托管费 5,364.77

衍生金融资产 应付销售服务费

买入返售金融资产 241,700,000.00 应付交易费用

应收证券清算款 438,706.57 应付税费

应收利息 66,958.73 应付利息

应收股利 应付利润

应收申购款 其他负债 20,853.64

其他资产 65,750.48 负债合计 53,042.21

所有者权益:

实收基金 244,525,121.00

未分配利润 343,561.52

所有者权益合计 244,868,682.52

资产合计: 244,921,724.73 负债与持有人权益总计: 244,921,724.73

八、基金投资组合

截止到 2017 年 8 月 8 日, 本基金的投资组合如下:

(一) 基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号 项目 金额 占基金总资产的比例 (%)

1	权益投资	--	
	其中：股票	--	
2	固定收益投资	--	
	其中：债券	--	
	资产支持证券	--	
3	贵金属投资	--	
4	金融衍生品投资	--	
5	买入返售金融资产	241,700,000.00	98.69
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	
6	银行存款和结算备付金合计	2,650,308.95	1.08
7	其他各项资产	571,415.78	0.23
8	合计	244,921,724.73	100.00

(二) 按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码 行业类别 公允价值 占基金资产净值比例(%)

A	农、林、牧、渔业	--	
B	采矿业	--	
C	制造业	--	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	
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	--	
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	--	
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	--	

(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

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有股票。

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

截至 2017 年 08 月 08 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

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有债券。

(六) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有贵金属。

(八) 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

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有权证。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有股指期货。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有国债期货。

(十一) 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本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、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、其他各项资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金

2 应收证券清算款 438,706.57

3 应收股利

4 应收利息 66,958.73

5 应收申购款

6 其他应收款 65,750.48

7 待摊费用

8 其他

9 合计 571,415.78

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2017 年 08 月 08 日，本基金未持有可转换债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于 2017 年 08 月 08 日，前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。

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

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

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

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

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

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

二一七年八月十日

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。

同一类别的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）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- （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；
- （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及债权人权利，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；

(14) 在遵守届时有效的法律法规和监管规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人在必要限度内以基金资产作为质押进行融资；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 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、转换和定投等业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费率、托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；

(18) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(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、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(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、半年度和年度基金报告；

(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，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(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 15 年以上；

(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内发出，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在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货等交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货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，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(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、半年度和年度基金报告出具意见，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 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规、《基金合同》和《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。

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。本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定的除外：

(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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 终止基金上市，但被上海证券交易所决定终止上市的除外；

(11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、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) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取和其他应由基金承担的费用；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(4) 在不违反法律法规、《基金合同》的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(5) 在不违反法律法规、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情况下，增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；

(6) 在不违反法律法规的情况下，调整基金份额净值的计算和公告时间或频率；

- (7) 本基金采取其他方式参与目标 ETF 的申购赎回；
- (8) 由于目标 ETF 交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (10) 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；
- (11) 当法律法规或中国证监会的相关规定变更时，本基金在履行相关程序后可对资产配置比例进行适当调整；
- (12) 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，在指定媒介公告。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和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

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

4、在不与法律法规冲突的前提下，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、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

(2) 通讯开会

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

(六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有同等表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资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。

(七) 计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。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）鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标基金份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金份额折算为目标 ETF 后的每一参会份额和目标 ETF 的每一参会份额拥有平等的投票权。

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。

十、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的部分，如将来法律法规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

在存续期内，本基金不进行收益分配。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、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

本基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \times \text{当年天数}$

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计算，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、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \times \text{当年天数}$

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扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计算，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。

3、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。指数许可使用费的费率、具体计算方法及支付方式见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

其中投资于目标 ETF 基金份额的比例不少于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内），每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

（三）投资策略

本基金为完全被动式指数基金，以恒指 ETF 作为其主要投资标的。本基金并不参与恒指 ETF 的管理。

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数。为了更好地

实现投资目标，基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回、股指期货之间的套利，以追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，增强基金收益。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金将通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，如果未来出现由于港股通额度受限、业务规则发生重大变更等影响投资运作的情形时，为了更好的保护投资人的利益，实现投资目标，在法律法规允许且操作可行的条件下，本基金将可以直接委托香港的经纪商投资标的指数的成份股、备选成份股。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，在履行适当程序后，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内）；
- （2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- （3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （6）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%；
- （7）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%；
- （8）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%；
- （9）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）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；
- （12）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （13）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 95%，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）、权证、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，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；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；
- （14）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；
- （15）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（10）项另有约定外，因证券或期货市场波动、上市公司合并、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、目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，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) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 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，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

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 2 个工作日内在指定媒介公告。

(二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、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。

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

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经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。

（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 15 年以上。

八、争议解决方式争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》是约定基金合同当事人之间、基金与基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章并在募

集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

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

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

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。