

工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)上市交易公告书

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

注册登记机构：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：2017 年 10 月 13 日

公告时间：2017 年 10 月 10 日 2

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.

.....  
..... 9

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（未经审计）.

.....  
..... 15

八、基金投资组合.

.....  
..... 16

九、重大事件揭示.

.....  
..... 18

十、基金管理人承诺.

.....  
..... 18

十一、基金托管人承诺.

.....  
..... 19

十二、备查文件目录.

.....

..... 19

附件：基金合同摘要.

.....

..... 213

一、重要声明与提示

《工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）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，工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金管理人工银瑞信基金管理有限公司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，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金托管人中信建投证券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。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2017 年 8 月 11 日《上海证券

报》、深圳证券交易所网站（[www.szse.cn](http://www.szse.cn)）和工银瑞信基金管理有限公司网站

（[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)）上的《工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《工

银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）招募说明书》等法律文件。

4

## 二、基金概览

1、基金名称：工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）

2、基金类别：股票型证券投资基金

3、基金运作方式：契约型开放式

4、基金存续期限：不定期

5、基金份额总额：截至 2017 年 9 月 29 日，本基金的基金份额总额为 297,644,248.43

份。

6、基金份额净值：截至 2017 年 9 月 29 日，本基金的基金份额净值为 1.0011 元。

7、本次上市交易的基金份额交易代码：164823

8、本次上市交易的基金份额简称：深成 LOF

9、本次上市交易的基金份额总额：158,274,003.00 份（截至 2017 年 9 月 29 日）

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：2017 年 10 月 13 日

12、基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

13、基金托管人：中信建投证券股份有限公司

14、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司 5

### 三、基金的募集与上市交易

#### （一）上市前募集情况

1、本基金注册申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可

【2015】1566

号

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2017 年 8 月 14 日至 2017 年 9 月 8 日

5、发售面值：1.00 元人民币

6、发售方式：场内、场外认购

7、发售机构：

（1）场内发售机构

本基金的场内销售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体

名单可在深交所网站查询），包括：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富

证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同

证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴

证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金

证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰

长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证

券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证

券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证

券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。具体名单详见深圳证券交易所网站，如有新增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以销售机构的公告为准。（2）场外发售机构 6

中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、中信期货有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、大同证券

有限责任公司、宏信证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、海银基金销售有限公司、上海大智慧财富管理有限公司、上海汇付金融服务有限公司、泛华普益基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、北京虹点基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、深圳富济财富管理有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、北京钱景基金销售有限公司、



奕丰金融服务（深圳）有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京广源达基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、泰诚财富基金销售（大连）有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、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、北京蛋卷基金销售有限公司、华泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、中原银行股份有限公司。

8. 验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

9、认购资金总额及入账情况：

本次认购总金额（不含认购手续费）共 297,644,248.43 元人民币，扣除银行利息部分的

募集资金共 297,575,745.19 元人民币，其中人民币

297,575,745.19 元已折算为基金份额分别计

入各基金份额持有人基金账户，已于 2017 年 9 月 13 日全额划入本基金由基金托管人中信建投

证券股份有限公司开立的基金托管专户；认购资金的银行利息共

68,503.24 元，其中人民币

68,503.24 元已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，已于 2017 年 9 月 21 日全额划入本基金由基金托管人中信建投证券股份有限公司开立的基金托管专户。7

本基金按照每份基金份额 1.00 元计算，募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计 297,644,248.43 份，其中场外认购的基金份额为 139,370,245.43 份；场内认购的基金份额为 158,274,003.00 份。

#### 10、基金备案情况

本基金募集备案情况：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》等相关法律、法规的规定以及《工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，工银瑞信基金管理有限公司（以下简称“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 2017 年 9 月 15 日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2017 年 9 月 15 日。

12、基金合同生效日的基金总份额：297,644,248.43 份

(二) 本基金上市交易的主要内容

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

【2017】636 号

2、上市交易日期：2017 年 10 月 13 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基金简称：深成 LOF

5、交易代码：164823

6、本次上市交易份额：158,274,003.00 份（截至 2017 年 9 月 29 日）

7、基金资产净值的披露：开放式基金每日收市后对基金资产净值进行估值

基金管理人每个开放日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额

净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过

基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日进行揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额在中国证券登记结算有限责任公司

开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，基金份额持有人将其转托管至

深圳证券交易所场内（即中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统）后即可上市流通。

#### （五）本基金转托管的主要内容

为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算 8 有限责任公司提出申请，为基金份额持有人开通了转托管业务的办理事宜。

基金份额持有人自 2017 年 10 月 13 日起可以通过本基金的销售机构办理本基金转托管业务，转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。9

#### 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 2017 年 9 月 29 日，本基金的基金份额持有人总户数为 3,614 户。本基金的场内基金份额持有人总户数为 1,614 户，平均每户持有的场内基金份额为 98,063.20 份；本基金的场外基金份额持有人总户数为 2,000 户，平均每户持有的场外基金份额为 69,685.12 份。

##### （二）持有人结构

截至 2017 年 9 月 29 日，场内基金份额持有人结构如下：

场内机构投资者持有的本基金场内基金份额为 22,609,256.00 份，占比 14.28%；

场内个人投资者持有的本基金场内基金份额为 135,664,747.00 份，占比 85.72%。

(三) 基金场内份额前十名持有人情况 (截至 2017 年 9 月 29 日)

序号 持有人名称 (全称) 持有基金份额 (份)

占场内基金

总份额的比例 (%)

1

都邦财产保险股份有限公司

20,002,916.00 12.64%

2 周雷 5,000,680.00 3.16%

3 李英 4,000,544.00 2.53%

4 王欢欢 3,300,449.00 2.09%

5 刘智浩 1,600,217.00 1.01%

6 李淑春 1,550,241.00 0.98%

7 翁月清 1,503,204.00 0.95%

8 华忠明 1,250,024.00 0.79%

9 黄浦江 1,012,137.00 0.64%

10 易志安 1,000,145.00 0.63%

11 魏爱平 1,000,145.00 0.63%

## 五、基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

#### 1、基本信息

名称：工银瑞信基金管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、  
甲 5 号 7 层甲 5 号 701、

甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

邮政编码：100033

法定代表人：郭特华

总经理：郭特华

成立日期：2005 年 6 月 21 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]93 号

中国银监会银监复[2005]105 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

营业执照注册号：100000400011263

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

信息披露联系人：朱碧艳

联系电话：400-811-9999

股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的 80%；瑞士信贷银行股份有限公司占公司注册资本的 20%。存续期间：持续经营

## 2、经营概况

公司设立了三个专门机构：执行委员会、风险管理委员会和投资决策委员会。执行委员会负责公司日常经营管理活动中的重要决策，风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

本公司下设二十一个部门和三个分公司，权益投资部、固定收益部、专户投资部、指数

投资中心、FOF 投资部、研究部、中央交易室、营销管理部、战略客户部、养老金投资中

心、互联网金融部、北京分公司、上海分公司、深圳分公司、销售服务部、产品管理部、财

务部、人力资源部、战略发展部、法律合规部、内控稽核部、风险管理部、信息科技部、运

作部。11

权益投资部在投资决策委员会授权范围内负责权益投资组合日常工作。固定收益部在

投资决策委员会授权范围内负责固定收益投资组合日常管理工作。

专户投资部在投资决策委员会授权范围内负责公司旗下专户产品的日常投资管理工作。指数投资中心是公司被动业务的归口管理部门，负责被动业务的投资、销售和服务工作。FOF 投资部在投资决策委员会授权范围内负责公司 FOF 类产品日常投资管理工作。研究部负责对宏观经济、行业、公司及市场进行研究并提出决策意见。中央交易室负责投资指令的交易执行。营销管理部负责公司工行个金渠道代销、结算、资管等业务以及非工行银行、券商渠道代销和直销业务。战略客户部负责公司战略客户业务。养老金投资中心是公司养老金业务的归口管理部门，负责养老金业务的投资、销售、产品开发和服务工作。互联网金融部负责公司互联网金融创新业务。

分公司负责实施区域内渠道代销、机构等业务的营销、拓展、维护和服务等工作。销售服务部负责销售支持和客户服务工作。产品管理部负责产品创新、开发与管理。财务部负责公司财务管理等工作。人力资源部负责公司人力资源招聘、薪酬、考核、培训及行政管理等工作。



战略发展部负责公司发展战略研究、经营分析、品牌管理和媒体关系维护。法律合规部负责公司法律合规工作。内控稽核部负责公司内控稽核工作。风险管理部负责公司投资风险管理、投资合规性监控、组合绩效评估和分析等工作。信息科技部负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。运作部负责公司开放式基金的注册登记、清算、核算和会计工作。

截止到 2017 年 8 月 31 日，我公司共有员工 600 人，其中 70%以上人员具有硕士以上学历。

### 3、本基金基金经理

刘伟琳女士，7 年证券从业经验；中国人民大学金融工程博士；2010 年加入工银瑞信，历任金融工程分析师、投资经理助理、投资经理，现任产品及营销支持部研究负责人、基金经理。2014 年 10 月 17 日至今，担任工银深证 100 指数分级基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银沪深 300 指数基金基金经理；2014 年 10 月 17 日至今，担任工银中证 500 指数分级基金基金经理；2015 年 5 月 21 日至今，担任工银瑞信中证传媒指数分级基金

基金经理；2015 年 7 月 23 日至今，担任工银中证高铁产业指数分级基金基金经理；2017 年 9 月 15 日至今，担任工银瑞信深证成份指数证券投资基金（LOF）基金经理。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：中信建投证券股份有限公司（简称“中信建投证券”）12

住所及办公地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

成立时间：2005 年 11 月 02 日

注册资本：人民币 72.46 亿元

法定代表人：王常青

基金托管业务批准文号：证监许可【2015】219 号

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

联系人：谢小华

联系电话：(010)85159352

### 2、发展概况

中信建投证券成立于 2005 年 11 月 2 日，是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证

券公司。公司注册于北京，注册资本 72.46 亿元，在全国 30 个省、市、自治区设有超过 260

家营业网点，并设有中信建投期货有限公司、中信建投资本管理有限公司、中信建投（国际）金融控股有限公司、中信建投基金管理有限公司等 4 家子公司。自成立以来，中信建投证券各项业务快速发展，在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券金融、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势，并搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险管理、合规管理等专业高效的业务支持体系。凭借高度的敬业精神与突出的专业能力，中信建投证券主要业务指标及盈利能力目前均位居行业前列。

中信建投证券托管部管理团队和业务骨干具有丰富的证券投资基金托管业务运作经验，业务人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，可为托管客户提供个性化产品处理能力。

中信建投证券于 2015 年 2 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，中信建投证券始终遵循“诚信、专注、成长、共赢”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履

行托管人的各项职责，切实维护基金份额持有人的合法权益，为基金份额持有人提供高质量的托管服务。截止 2017 年 6 月末，中信建投证券托管 5 只证券投资基金。

## （二）主要人员情况

王常青先生，董事长、执行董事、执行委员会主任。王先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券股份有限公司，自 2007 年 2 月 16 日起担任执行董事，自 2011 年 9 月起担任董事长、执行委员会主任；自 2011 年 9 月起担任党委书记，并自 2012 年 7 月起兼任中信建投国际董事。王先生目前还担任中国证券业协会投资银行业专业委员会副主任委员、北京证券业协会常务副理事长、上海证券交易所第二届监事会会员监事、深圳证券交易所理事会战略规划委员会委员。王先生自 1984 年 8 月至 1986 年 9 月任职北京冶炼厂，曾任铜粉分厂副厂长；自 1986 年 10 月至 1992 年 11 月任职北京市有色金属工业总公司，曾任生产计划处副处长；自 1992 年 11 月至 1993 年 10 月任职北京凯宝旅游食品公司，任董事、副总经理；自 1993 年

10 月至 1999 年 9 月任职日本大和证券集团北京代表处，曾任股票承销部负责人；自 1999

年 10 月至 2005 年 11 月任职中信证券，曾任上海投资银行部总经理、投资银行总部副总经

理、投资银行业务行政负责人、董事总经理并兼任企业融资委员会副主任；自 2005 年 11

月至 2011 年 9 月曾任中信建投证券股份有限公司副总经理、总经理、执行委员会委员。王

先生于 1984 年 7 月自中国东北工学院（现东北大学）取得工学学士学位，于 2002 年 1 月自

中国人民大学取得经济学硕士学位。

齐亮先生，执行董事、总经理、执行委员会委员。齐先生于 2012 年 3 月 20 日加入中信

建投证券股份有限公司并自此担任执行董事、总经理、执行委员会委员，自 2013 年 7 月起

担任党委副书记，并自 2013 年 1 月起兼任中信建投国际董事长，自 2013 年 1 月起担任中关

村股权交易服务集团有限公司董事。齐先生目前还担任中国证券业协会经纪业专业委员会副

主任委员、中国银行间市场交易商协会债券市场专业委员会委员、中国金融学会绿色金融专

业委员会理事、全国金融系统青年联合会常委。齐先生自 1992 年 8 月至 1993 年 6 月任中国工商银行北京分行职员；自 1993 年 6 月至 2005 年 11 月任职华夏证券，曾任交易部业务副经理、北京东四营业部总经理助理、湖南营业部副总经理、哈尔滨营业部副总经理、客户资产管理中心副总经理、研究发展部副总经理及总经理、研究所所长、公司总裁助理；自 2005 年 9 月至 2007 年 8 月任中信建投证券股份有限公司副总经理；自 2007 年 9 月至 2012 年 2 月任中国银河证券股份有限公司副总裁。齐先生于 1992 年 6 月自中国金融学院取得经济学学士学位，于 1999 年 6 月自中国中央财经大学取得经济学硕士学位，于 2001 年 4 月自中国北京大学取得高层管理工商管理硕士学位。

朱志明先生，托管部行政负责人。朱先生 2014 年 8 月起任中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人；2007 年 9 月至 2014 年 8 月，历任中信建投证券股份有限公司经纪业务管理部高级副总裁，机构管理部总监，网点管理部总监、执行董事；2006 年 1 月至 2007 年

8 月，任中信建投证券股份有限公司计划财务部总经理助理。朱先生 1990 年毕业于武汉大学审计系，获得学士学位，2002 年于中国人民大学财政金融学院获硕士学位。14

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2017 年 6 月 30 日，中信建投证券股份有限公司累计托管 5 只证券投资基金。此外，中信建投证券股份有限公司还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、私募投资基金等产品。

### （四）托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律、法规、监管规则和公司内部规章制度，防范和化解基金托管业务经营风险，确保托管资产的完整和安全，切实保护基金份额持有人权益，确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律、法规、监管规则及相关合同、协议的规定，查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证托管业务安全、有效、稳健运行。

#### 2、内部控制组织结构

中信建投证券设有风险管理委员会，负责全公司风险管理与内部控制工作，对托管业务

风险控制工作进行检查指导。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

中信建投证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保障托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。



## 2、监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

注册登记业务办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-50938856

传真：010-50938907

联系人：崔威

#### （四）会计师事务所及经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

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

经办注册会计师：单峰、朱宏宇

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：朱宏宇

#### 六、基金合同摘要

本基金基金合同的内容摘要请见附件。 七、基金财务状况（未经审计）

深圳证券交易所所在本基金成立后至上市交易公告书公告前未收取任何费用。

本基金成立后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

本基金截至 2017 年 9 月 29 日的资产负债表如下：16

单位：人民币元

资产：期末数 负债：期末数

银行存款 297,674,543.90 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 114,214.46

基金投资 应付托管费

17,132.16

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 438,567.89 应付利息

应收股利 应付利润

应收申购款 其他负债 21,867.69

其他资产 负债合计 153,214.31

所有者权益：

实收基金 297,644,248.43

未分配利润 315,649.05

所有者权益合计 297,959,897.48

资产合计 298,113,111.79

负债与持有人权

益总计

298, 113, 111. 79

## 八、基金投资组合

工银瑞信深证成份指数证券投资基金的投资组合如下：

(一) 截至 2017 年 9 月 29 日，基金资产组合情况 17

金额单位：人民币元

序号 项目 金额（元）

占基金总资产的

比例（%）

1 权益投资

其中：股票

2 基金投资

3 固定收益投资

其中：债券

资产支持证券

4 贵金属投资

5 金融衍生品投资

6 买入返售金融资产

其中：买断式回购的买入返售金融资产

7 银行存款和结算备付金合计 297, 674, 543. 90 99. 85

8 其他资产 438, 567. 89 0. 15

9 合计 298, 113, 111. 79 100. 00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

（二）按行业分类的股票投资组合

1、截至 2017 年 9 月 29 日，按行业分类的股票投资组合

截至 2017 年 9 月 29 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

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金未持有股票。

（四）截至 2017 年 9 月 29 日，按券种分类的债券投资组合

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金未持有债券。

（五）截至 2017 年 9 月 29 日，按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金未持有债券。

（六）报告期末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 9 月 29 日，本基金未持有资产支持证券。18

（七）报告期末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 9 月 29 日，本基金未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金投资的前十名证券的发行主体未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、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

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  
438,567.89

5 应收申购款 - 6 其他应收款 - 7 待摊费用 - 8 其他 - 9 合计  
438,567.89

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2017 年 9 月 29 日，本基金未持有股票。 九、重大事件揭示  
本基金成立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：19

（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》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二) 根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金

管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。 十二、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

(一)中国证监会准予工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)募集注册的文件

(二)关于申请募集工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)之法律意见书

(三)基金管理人业务资格批件和营业执照 (四)基金托管人业务资格批件和营业执照

(五)《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》

(六)《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)托管协议》

(七)《工银瑞信深证成份指数证券投资基金(LOF)招募说明书》

(八)中国证监会规定的其他文件 20

工银瑞信基金管理有限公司

二〇一七年十月十日 21

附件:基金合同摘要

一、基金管理人



### （一）基金管理人简况

名称：工银瑞信基金管理有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、  
甲 5 号 7 层甲 5 号 701、  
甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901

法定代表人：郭特华

设立日期：2005 年 6 月 21 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2005】93  
号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：400-811-9999 二、基金合同当事人的权利及义务

### （二）基金托管人简况

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字[2005]112 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 72.46 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号： 证监许可【2015】219 号

### （三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资

者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，

直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基

金合同》上书面签章或签字为必要条件。22

## 二、基金合同当事人的权利及义务

### （一）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金

财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费

用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律规定的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的规定，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》及有关法律规定的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、赎回或转换申请；

(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) 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；

(14) 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的外部机构；

(15) 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、转换和收益分配等的业务规则；

(16) 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：23

(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；

(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者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，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 24

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。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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；

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

会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户及其他投资所需账户，为基金办理证券、

期货交易资金清算； 25

(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；

(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； 26

(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及义务

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) 根据基金合同的约定，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。

27

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。

### 三、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。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

#### (一)、召开事由

1、除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的以外，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) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的

除外；

- (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； 28
- (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，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的外；

(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、在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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、基金托管费及其他应由基金承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规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情况下调整本基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；

(4) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或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；

(5) 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；

(6) 在不损害已有基金份额持有人权益的情况下增加、取消或调整基金份额类别设置；

(7) 在符合有关法律法规的前提下，经中国证监会允许，基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规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；

(8) 在法律法规或中国证监会允许的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下推出新业务或服务；

(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以外的其他情形。

## (二)、会议召集人及召集方式 29

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六

十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 30

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。

(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或监管机构允许的

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书委派代表出席，

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书符合法律法规、《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书面形式或大会 31

公告载明的其他方式在表决截至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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权；在会议召开方式上，本基金亦

可采用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基金份额持有人大会，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，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。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。33

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

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。

## （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书面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。<sup>34</sup>

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）、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。

#### 四、基金的收益与分配

##### （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，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基

金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，

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分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将

现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现

金分红；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份

额进行再投资；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，登记机构将以投资者最后一

次选择的分红方式为准；登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，

只能选择现金分红的方式。具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登

记结算有限责任公司的相关规定； 35

3、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；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、

分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （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，在 2 日内在指定媒介公

告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过

15 个工作日。

#### （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。当投资者的现金

红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持

有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照

《业务规则》执行。

## 五、基金的费用与税收

### （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、标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、基金上市费用； 36
- 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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### （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 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人  
与基金托管人双

方核对无误后，基金托管人于次月前 3 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

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

下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管  
理人与基金托管人双

方核对无误后，基金托管人于次月前 3 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

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用  
许可协议的约定向中



证指数有限公司支付指数许可使用费。标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的

0.02%的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

本基金标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的

的，根据实际天数按比例计算。37

标的指数许可使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。标的

指数许可使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后，于

每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的

费率、支付方式执行，此项无需召开基金份额持有人大会。

上述“一、基金费用的种类中第 4—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。

4、证券账户开户费用：证券账户开户费由基金管理人垫付，运作后由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### （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、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。

### （五）、基金管理费和基金托管费的调整

在法律法规允许的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金

托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实

施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

## 六、基金财产的投资范围和投资限制

### （一）、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，包括深证成份指数的成份股及其备选

成份股（包括但不限于中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市

的股票）、债券（包括

国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易

可转债、短期融资券（含

超短期融资券）等债券）、资产支持证券、债券回购、股指期货、

权证、银行存款以及经中 38

国证监会允许基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的规

定。

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：本基金的股票资产投资比例不低于基金资

产的 90%，其中投

资于深证成份指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资

产的 80%，任何交易日

日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不  
低于基金资产净值的 5%。股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或中国证监会允许，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。

## （二）、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于深证成份指数成

份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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，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）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但标的指数成份股票及其备选成份股票不受此限；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，

但标的指数成份股票及其备选成份股票不受此限；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

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

(9) 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%；

(10) 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 39 证券规模的 10%；

(11) 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%；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；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%，本基金进入全国银行间同业市场进

行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净

值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得

超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府

债券）、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，持有的卖出股指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个交易日基金资产净值的

20%；在任何交易日终，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）

不低于基金资产的 90%；

（16）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。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等

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。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。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。法律法规或监管部门另有规定

的，从其规定。

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 40

易的，应当符合本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对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的，本基金应当按照

法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制、投资禁

止性规定，且该等调整或修改属于非强制性的，在不违背法律法规

和基金合同的约定，以及

对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人有权在履行适当程序后按照

法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并应向投资者履行信息披露义务，但无需基

金份额持有人大会审议决定。



## 七、基金的财产

### （一）、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

### （二）、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。

### （三）、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算

的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固

有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不 41

得相互抵销。

## 八、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须报中国证监会备案，自表决通

过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （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、连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000

万元情形的，则直接终止基金合同并进入基金财产的清算程序，无须召开基金份额持有人大

会审议；

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、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤

勉、尽责地履行本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。

4、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。

5、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。

6、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四)、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用

由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

(五)、基金财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经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。

#### 九、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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进

行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁

决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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》受中国法律管辖。

#### 十、基金合同的存放及查阅方式 43

《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。