

易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数 证券投资基金（QDII）上市交易公告书

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市日期：2019 年 6 月 25 日

公告日期：2019 年 6 月 20 日

目录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览	3
三、基金的募集与上市交易.....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	5
五、基金主要当事人简介	6
六、基金合同摘要.....	15
七、基金财务状况.....	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、基金上市推荐人意见.....	19
十三、备查文件目录.....	19
附件：基金合同摘要.....	21

一、重要声明与提示

易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）上市交易公告书（以下简称“本报告”）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，易方达基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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报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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本报告未涉及的有关内容，请详细阅读 2019 年 5 月 25 日刊登在《中国证券报》以及基金管理人网站（www.efunds.com.cn）上的《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）。

二、基金概览

- 1、基金二级市场交易简称：225ETF。
- 2、二级市场交易代码：513000。
- 3、基金申购、赎回简称：225ETF。
- 4、申购、赎回代码：513001。
- 5、2019 年 6 月 18 日基金份额总额：508,411,379.00 份。
- 6、2019 年 6 月 18 日基金份额净值：1.0002 元。
- 7、本次上市交易份额：508,411,379.00 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：2019 年 6 月 25 日。
- 10、基金管理人：易方达基金管理有限公司。
- 11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。
- 12、基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司。
- 13、上市推荐人：广发证券股份有限公司。
- 14、目前，本基金的申购赎回代办券商为：广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司。若有新增本基金的申购赎回代办券商，基金管理人将另行公告。

基金管理人可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：2019年5月22日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》（证监许可[2019]922号）。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售方式：投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。

5、发售日期：本基金自2019年5月28日至2019年6月5日进行发售。其中网下现金认购的日期为2019年5月28日至2019年6月5日，网上现金认购的日期为2019年6月3日至2019年6月5日。

6、发售价格：1.00元人民币。

7、发售期限：网下现金认购发售7个工作日，网上现金认购发售3个工作日。

8、发售机构

（1）直销机构

投资者可通过基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。

（2）非直销销售机构

本基金的网上现金认购发售代理机构：具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

本基金网下现金认购发售代理机构为：长江证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司。

9、验资机构：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

（二）基金合同生效

本基金根据2019年5月22日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》（证监许可[2019]922号）进行募集，自2019年5月28日起向全社会公开募集，截至2019年6月5日，募集工作已经顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为508,402,500.00元人民币，有效净认购金额产生的利息共计8,879.00元人民币。本次募集所有资金已于2019年6月12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。

本次募集有效认购户数为 2,721 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，募集期间募集及利息结转的基金份额共计 508,411,379.00 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。在基金募集期内，基金管理人的基金从业人员认购基金份额 0.00 份，占基金份额总量的 0.0000%。基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。易方达基金管理有限公司有效参与本基金的份额为 50,006,000.00 份，占有效参与份额总额的 9.8357%。

本基金于 2019 年 6 月 12 日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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 2019 年 6 月 12 日正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人正式开始管理本基金。

（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[2019]110 号。

2、上市交易日期：2019 年 6 月 25 日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：225ETF。

5、二级市场交易代码：513000。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：225ETF。

7、申购、赎回代码：513001。

投资者应当在本基金指定的申购赎回代办券商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按申购赎回代办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办券商为广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司。若有新增本基金的申购赎回代办券商，基金管理人将另行公告。

基金管理人可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

8、本次上市交易份额：508,411,379.00 份。

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

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2019 年 6 月 18 日，本基金份额持有人户数为 2,721 户，平均每户持有的基金份额为 186,847.25 份。

（二）持有人结构

截至 2019 年 6 月 18 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 209,520,379.00 份，占基金总份额的 41.21%；个人投资者持有的基金份额为 298,891,000.00 份，占基金总份额的 58.79%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至 2019 年 6 月 18 日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额(份)	占基金总份额比例
1	易方达基金管理有限公司	50,006,000.00	9.84%
2	夏多香	12,000,000.00	2.36%
3	蒋娜	11,000,000.00	2.16%
4	广州腾昱投资合伙企业（有限合伙）	10,000,000.00	1.97%
5	财富证券有限责任公司	8,000,960.00	1.57%
6	财富证券—广州农商行—财富证券畅盈 9 号集合资产管理计划	8,000,960.00	1.57%
7	东兴证券股份有限公司	8,000,459.00	1.57%
8	中信证券股份有限公司	8,000,000.00	1.57%
9	恒泰证券股份有限公司	8,000,000.00	1.57%
10	东北证券股份有限公司	8,000,000.00	1.57%
11	金元顺安基金—南京银行—海通证券股份有限公司	8,000,000.00	1.57%
12	王贺	8,000,000.00	1.57%
13	中信建投证券股份有限公司	8,000,000.00	1.57%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分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

1. 名称：易方达基金管理有限公司
2. 法定代表人：刘晓艳
3. 总裁：刘晓艳

4. 注册资本：12,000 万元人民币

5. 注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-42891（集中办公区）

6. 办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

7. 设立批准文号：证监基金字[2001]4 号

8. 工商登记注册的法人营业执照文号：91440000727878666D

9. 经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理

10. 股权结构：广东粤财信托有限公司，持有股份 25%；广发证券股份有限公司，持有股份 25%；盈峰投资控股集团有限公司，持有股份 25%；广东省广晟资产经营有限公司，持有股份 16.67%；广州市广永国有资产经营有限公司，持有股份 8.33%。

11. 内部组织结构及职能

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，保持公司规范运作，维护基金份额持有人的利益。

公司下设 44 个部门：权益投资管理部、投资一部、投资二部、投资三部、研究部、固定收益投资部、现金管理部、固定收益组合管理部、固定收益研究部、固定收益交易部、混合资产投资部、年金投资部、指数管理总部、量化投资部、国际投资部、多资产投资部、机构客户总部、渠道与营销管理总部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、大连分公司、互联网金融部、客户服务与销售支持总部、全球投资客户部、养老金部、实体经济服务部、投资风险管理部、监察与合规管理总部、公司法律事务部、综合管理部、公司财务中心、技术运营部、系统研发部、系统规划架构部、金融科技部、核算部、集中交易室、数据信息支持部、宣传策划部、注册登记部、投资发展部、人力资源部。

- 1) 权益投资管理部负责主动权益类投资产品的管理工作。
- 2) 投资一部以团队形式负责所辖资产的投资管理工作。
- 3) 投资二部以团队形式负责所辖资产的投资管理工作。
- 4) 投资三部以专注于“长期投资有持续内生增长能力的价值型个股”的投资策略，以紧密团队合作的形式，负责该种策略下各类产品的投资管理工作。
- 5) 研究部负责对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种的研究。
- 6) 固定收益投资部负责纯债类基金、专户的投资管理工作。
- 7) 现金管理部负责货币类以及短期理财类基金的投资管理工作。
- 8) 固定收益组合管理部负责固定收益纯债类组合、混合多策略组合、现金管理类组合

的账户运作支持工作。

- 9) 固定收益研究部负责固定收益类投资品种的研究。
- 10) 固定收益交易部负责固定收益类投资品种的交易。
- 11) 混合资产投资部负责混合策略类基金、专户的投资管理工作。
- 12) 年金投资部负责企业年金、职业年金的投资管理工作。
- 13) 指数管理总部下设指数投资部、解决方案部，负责指数及 SmartBeta 产品的投资、研究、推广、运作及风险管理相关工作。
- 14) 量化投资部负责量化类公募基金及专户的投资、研究、运作及风险管理的相关工作。
- 15) 国际投资部负责管理和发展公司 QDII、RQDII 以及其他境外证券市场投资业务，参与相关产品设计，配合客户服务工作，同时担当易方达公司境内和境外投资研究体系互动和交流的桥梁。
- 16) 多资产投资部负责跨区域、跨类别的多种资产的研究及投资工作。
- 17) 机构客户总部负责公司机构客户的销售和服务工作，下设银行客户部、非银行客户部两个二级部门，分别负责所属客户群体的销售和服务工作。
- 18) 渠道与营销管理总部下设渠道部、营销部，负责各类基金代销机构的合作开发及总部层面的维护工作；营销策划方案的制订、推动，营销效果及客群的数据挖掘、分析；公司产品宣传材料制作。
- 19) 北京分公司负责以北京为中心的华北地区的渠道销售和服务工作。
- 20) 上海分公司负责以上海为中心的华东地区的渠道销售和服务工作。
- 21) 广州分公司负责以广州为中心的华南地区的渠道销售和服务工作。
- 22) 成都分公司负责以成都为中心的西南西北地区的渠道销售和服务工作。
- 23) 大连分公司负责以大连为中心的东北及山东地区的渠道销售和服务工作。
- 24) 互联网金融部负责研发基于互联网的交易模式和服务模式，建设相应系统并持续改进用户体验，开展互联网金融业务的营销策划、方案制作、方案实施及对外的合作洽谈，负责公司网站及 App 建设、维护，为互联网上的客户提供服务等工作。
- 25) 客户服务与销售支持总部下设客户服务部、销售支持部，负责销售支持工作，为渠道、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持。
- 26) 全球投资客户部负责执行公司在国际市场的战略目标和定位；开拓国际市场客户，促进公司产品的境外销售，管理和维护客户关系；甄选公司的国际合作投资顾问，对其服务和产品进行管理。

- 27) 养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。
- 28) 实体经济服务部直接为实体经济服务。
- 29) 投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估, 投资与市场的相关数据支持服务工作。
- 30) 监察与合规管理总部下设合规风控部、合规内审部, 负责独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督, 协助并督促各部门履行内控职责, 确保公司各项经营活动稳健合规, 实现公司经营目标。
- 31) 公司法律事务部负责处理与公司运营相关的法律文件审核、法务咨询等事务(含母子公司等集团法律事务), 有效防范法律风险, 保障公司合法合规经营。
- 32) 综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作, 负责公司行政保卫和文书档案等工作。
- 33) 公司财务中心负责公司财务管理业务。
- 34) 技术运营部负责公司 IT 基础设施的规划与建设, 公司日常运营的技术支持与服务, 保障公司信息系统安全可靠高效运行。
- 35) 系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试、以及上线运营后的应用支持工作。
- 36) 系统规划架构部负责研究公司信息系统的规划和架构, 规范指导公司信息系统的建设。
- 37) 金融科技部跟踪研究人工智能、大数据等创新技术, 推动智能技术与公司业务的融合及智能化成果在公司的应用, 推进相关项目的建设实施运营。
- 38) 核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作, 负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作, 以及各银行账户的管理工作。
- 39) 集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作, 保存交易记录, 备份交易数据。
- 40) 数据信息支持部负责参与公司数据中心的建设与应用, 负责产品运作中跨部门数据的制作或统稿报送、产品生命周期中特殊事项的支持以及部分基金信息披露材料的牵头制作等工作。
- 41) 宣传策划部负责制作宣传材料, 传播公司信息, 管理媒体关系, 管理广告投放等。
- 42) 注册登记部负责进行开放式基金、特定多个客户资产管理计划及养老金产品的注册登记业务。

43) 投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发,为市场营销工作提供专业支持。

44) 人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施,具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。

12. 人员情况

截至 2019 年 3 月 31 日,本公司有正式员工 735 人,硕士及以上学历人员占比 76%,其中 527 人具有硕士研究生学历,29 人具有博士研究生学历。

13. 信息披露负责人:张南

电话:020-85102688

14. 基金管理业务介绍

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准,易方达基金管理有限公司(简称“易方达”)成立于 2001 年 4 月 17 日,总部设在广州,在北京、上海、香港、深圳、成都、大连等地设有办公场所,并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下,通过市场化、专业化的运作,为投资人的资产实现持续稳定的保值增值,成为国内领先的综合性资产管理机构,具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一,拥有公募、社保、年金、专户、QDII、QFII、RQFII、保险资金委托投资、基本养老保险基金投资等业务资格,投资业务包括主动权益、指数量化、固定收益、国际投资、多资产投资、另类投资等六大板块,为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至 2019 年 3 月 31 日,易方达的总资产管理规模达到 1.3 万亿元,其中公募基金管理规模 7207 亿元。

15. 本基金基金经理

FAN BING(范冰)先生,商学硕士。曾任皇家加拿大银行托管部核算专员,美国道富集团 Middle Office 中台交易支持专员,巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析师、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管,贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。现任易方达基金管理有限公司易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达原油证券投资基金(QDII)基金经理(自 2017 年 3 月 25 日起任职)、易方达中证海外中国互联网 50 交易型

开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 3 月 25 日起任职）、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理（自 2017 年 6 月 27 日起任职）、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 5 月 17 日起任职）、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2019 年 1 月 18 日起任职）、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自 2019 年 3 月 13 日起任职）、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理（自 2019 年 6 月 12 日起任职）。

余海燕女士，经济学硕士。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2013 年 9 月 23 日起任职）、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2014 年 6 月 26 日起任职）、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2015 年 1 月 22 日起任职）、易方达上证 50 指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 4 月 15 日起任职）、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 6 月 15 日起任职）、易方达军工指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 7 月 8 日起任职）、易方达证券公司指数分级证券投资基金基金经理（自 2015 年 7 月 8 日起任职）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 4 月 16 日起任职）、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 4 月 16 日起任职）、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理（自 2016 年 4 月 16 日起任职）、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 4 日起任职）、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 14 日起任职）、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2017 年 7 月 27 日起任职）、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2017 年 11 月 22 日起任职）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 11 日起任职）、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自 2019 年 1 月 18 日起任职）、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

发起式联接基金基金经理（自 2019 年 3 月 20 日起任职）、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（自 2019 年 6 月 12 日起任职）。

（二）基金托管人情况

1. 基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

联系电话：010-66105799

信息披露负责人：郭明

资产托管部负责人：李勇

2. 主要人员情况

截至 2019 年 3 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 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. 基金托管业务经营情况

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、基本养老保险、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 2019 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 945 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《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 65 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

广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575或02095575

网址：www.gf.com.cn

（四）申购赎回代办券商

1. 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575或02095575

网址：www.gf.com.cn

2. 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大厦

法定代表人：徐丽峰

联系人：占文驰

联系电话：0791-86283372

客户服务电话：4008-222-111

传真：0791-86281305

网址：www.gszq.com

3. 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客户服务电话：95597

传真：0755-82492962

网址：www.htsc.com.cn

4. 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

联系电话：010-83574507

客户服务电话：4008-888-888或95551

传真：010-66568532

网址：www.chinastock.com.cn

5. 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户服务电话：95565、400-8888-111

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

（五）基金验资机构

会计师事务所：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

主要经营场所：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

执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁

电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

经办注册会计师：赵雅、马婧

联系人：赵雅

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

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

（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

本基金截至 2019 年 6 月 18 日的资产负债表如下：	本报告期末（2019 年 6 月 18 日；单位：人民币元）
资产：	
银行存款	508,384,899.00
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	2,781,723.50
其中：股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	2,781,723.50
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	72,444.82
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	124,412.36
资产合计	511,363,479.68
负债和所有者权益：	
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	-
应付证券清算款	2,803,278.87
应付赎回款	-
应付管理人报酬	16,719.19
应付托管费	4,179.80

应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应付税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	2,236.19
负债合计	2,826,414.05
所有者权益：	
实收基金	508,411,379.00
未分配利润	125,686.63
所有者权益合计	508,537,065.63
负债与持有人权益合计：	511,363,479.68

八、基金投资组合

截至 2019 年 6 月 18 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(人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	2,781,723.50	0.54
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	508,384,899.00	99.42
8	其他资产	196,857.18	0.04
9	合计	511,363,479.68	100.00

(二) 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金于2019年6月18日未持有股票及存托凭证。

(三) 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金于2019年6月18日未持有股票及存托凭证。

(四) 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及存托凭证投资明细

本基金于2019年6月18日未持有股票及存托凭证。

(五) 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金于2019年6月18日未持有债券。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金于2019年6月18日未持有债券。

(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十名资产支持证券投资明细

本基金于2019年6月18日未持有资产支持证券。

(八) 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金融衍生品投资明细

本基金于2019年6月18日未持有金融衍生品。

(九) 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	NIKKO ETF -	ETF基	开放	Nikko Asset Management	2,781,723.50	0.55

	NKY 225	金	式	Co., Ltd.		
--	---------	---	---	-----------	--	--

(十) 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. 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	72,444.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	124,412.36
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	196,857.18

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于2019年6月18日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

本基金于2019年6月18日未持有股票。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行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、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:

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。

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。

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。

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

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为广发证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见:

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的条件;

2、基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

(一)中国证监会准予易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的文件;

(二)《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》;

(三)《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书》;

(四)《易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)托管协议》;

(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。

存放地点：基金管理人、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：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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》和《招募说明书》等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

易方达基金管理有限公司

2019年6月20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，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项或应付申购对价、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定；

- (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、法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、法规规定，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、结算机构办理基金登记、结算业务并获取《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券或基金所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法进行融资、融券、转融通；
- (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、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户和收益分配等业务规则；
- (17) 选择、更换基金境外投资顾问；
- (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办理基金份额的发售、

申购、赎回和登记结算事宜；

(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、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 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，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和全部募集费用，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者的利益；

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 选择、更换境外托管人，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责；

(8) 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和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》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和基金份额净值；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，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定；

(22) 保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；

(23) 每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

(24) 基金托管人应办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

(25) 基金托管人应保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(26) 按照有关法律法规、《基金合同》的规定以受托人名义或指定的代理人名义登记资产；

(27) 确保基金按照有关法律法规、《基金合同》约定的投资范围和限制进行管理；

(28) 确保基金根据有关法律法规、《基金合同》确定并实施收益分配方案；

(29) 确保基金按照有关法律法规、《基金合同》的规定进行认购、申购、赎回等日常交易；

(30) 对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责，境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人承担相应责任；

(31) 法律法规及中国证监会、外管局规定的和《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暂不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

(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、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外），但由于标的 ETF 基金交易方式变更、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；

- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以

基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记结算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、交易、非交易过户、质押等业务规则（包括申购赎回清单的调整、开放时间的调整等），或证券交易所和登记结算机构调整上述业务规则；

(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) 推出新业务或服务；

(8) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、开通场外申购赎回、跨系统转托管等业务；

(9) 按照指数编制机构的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费率、计算方法或支付方式等；

(10) 本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

(11) 调整基金收益分配原则；

(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开时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（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、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书面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的有关证明文件、受托出席会议者出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

（2）经核对，到会者在权益登记日代表的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基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定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，同时提交的有关证明文件、受托出具书面意见的代理人出具的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记结算机构记录相符。

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、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50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

(2) 通讯开会

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

(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《基金合同》另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（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。

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。

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）基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式采用现金分红；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可进行收益分配；

4、本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

（二）基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金收益评价日本基金相对标的指数的超额收益率 = 基金累计报酬率 - 标的指数同期累计报酬率

基金累计报酬率 = 收益评价日基金份额净值（如上市后基金份额发生折算，则采用剔除上市后折算因素的基金份额净值） / 基金上市前一上海证券交易所和日本东京证券交易所同时开放交易的工作日基金份额净值 - 100%

剔除上市后折算因素的基金份额净值=

$$\frac{\text{基金资产净值}}{\text{基金份额总额}} \times \prod_i \text{上市后第}i\text{次基金份额折算比例}$$

注： \prod_i 为连乘符号。当基金份额折算比例为 N 时，表示每一份基金份额折算为 N 份。

标的指数同期累计报酬率=收益评价日标的指数收盘值/基金上市前一上海证券交易所和日本东京证券交易所同时开放交易的工作日标的指数收盘值-100%（使用估值汇率折算）

当上述超额收益率超过 1%时，基金管理人有权进行收益分配。

2、根据前述收益分配原则计算截至基金收益评价日本基金的份额可分配收益，并确定收益分配比例。

3、每基金份额的应分配收益为份额可分配收益乘以收益分配比例，保留小数点后 3 位，第 4 位舍去。

（三）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。

（四）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 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（五）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，不足部分由基金管理人垫付。

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（含境外托管人的托管费）；
- 3、《基金合同》生效后的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、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 8、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用；
- 9、代表基金投资或其他与基金投资活动有关的费用；

- 10、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 11、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 12、基金上市初费及年费；
- 13、收益分配中发生的费用；
- 14、基金依照有关法律法规应当缴纳或预提的任何税收、征费及相关的利息、费用和罚金，以及直接为处理基金税务事项产生的税务代理费；
- 15、其他为基金的利益而产生的费用；
- 16、按照国家有关规定和《基金合同》约定，因基金运作而发生的，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 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，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首日起 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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，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首日起 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等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与指数编制机构签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向指数编制机构支付。指数许可使用费的费率、具体计算方法及支付方式等见招募说明书。

如果基金管理人和指数编制机构对指数许可使用费的计算方法、费率或支付方式等另有约定的，本基金从其最新约定。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议，但基金管理人应及时在指定媒介予以公告。

上述“一、基金费用的种类”中第4—16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各纳税主体，依照中国或所投资市场所在国家或地区的法律法规的规定履行纳税。本基金在投资和运作过程中如发生增值税等应税行为，相应的增值税、附加税费以及可能涉及的税收滞纳金等由基金财产承担，届时基金管理人可通过本基金托管账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人按照相关规定申报缴纳。如果基金管理人先行垫付上述增值税等税费的，基金管理人有权从基金财产中划扣抵偿。本基金清算后若基金管理人被税务机关要求补缴上述税费及可能涉及的滞纳金等，基金管理人有权向投资人就相关金额进行追偿。

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的最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的ETF、标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品。

为更好地实现投资目标，本基金还可投资于境外市场和境内市场依法发行的金融工具，其中境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证（包括全球存托凭证、美国存托凭证等）、房地产信托凭证、政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券、银行存款、货币市场工具、结构性投资产品、远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品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；境内市场投资工具包括银行存款、同业存单、货币市场工具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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人可以将其纳入投资范围,其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金投资于标的ETF的资产不低于非现金资产的80%且不低于基金资产净值的90%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

(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) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制;

(2) 基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%;

(3) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。前项非流动性资产是指法律或《基金合同》规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产;

(4) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%,临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准;

(5) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的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,法律法规另有规定的,从其规定;

(6) 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本基金合同约定的投资范围保持一致;

(7) 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(5)、(6)情形之外,若基金超过上述投资比例限制,应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓,以符合投资比例限制要求。

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。

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,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

2、金融衍生品投资

基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当严格遵守下列规定:

(1) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%;

(2) 基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%；

(3) 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%；

(4) 基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告；

(5) 基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品；

3、本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%；

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；

(4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：1) 现金；2) 存款证明；3) 商业票据；4) 政府债券；5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证；

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任；

4、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

(1) 所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

(2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；

(3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；

(4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

(5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任;

(6) 基金参与证券借贷交易、正回购交易, 所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%;

前项比例限制计算, 基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

5、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) 购买不动产;
- (5) 购买房地产抵押按揭;
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证;
- (7) 购买实物商品;
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外, 借入现金; 该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%;
- (9) 利用融资购买证券, 但投资金融衍生品除外;
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易;
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层;
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品;
- (13) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (14) 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;
- (15) 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。

6、法律法规或监管部门取消上述组合限制或禁止行为规定, 如适用于本基金, 则本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制或禁止行为规定进行变更的, 本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致, 基金管理人可依据法律法规或监管部

门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券、标的 ETF 基金份额、票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

（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）基金资产净值、基金份额净值的公告

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

基金份额净值是按照估值日基金资产净值除以估值日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

《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方可执行，自决议生效后两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，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、《基金合同》生效后，基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定直接终止本基金合同的；

3、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；

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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

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

（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

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。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，按照其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，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，各方当事人应恪守各自的职责，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。