
工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数
证券投资基金
上市交易公告书

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：申万宏源证券有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2021年3月1日

公告时间：2021年2月24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.....	7
五、基金主要当事人简介.....	7
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.....	19
十、基金管理人承诺.....	19
十一、基金托管人承诺.....	20
十二、基金上市推荐人意见.....	20
十三、备查文件目录.....	20
附件：基金合同摘要.....	22

一、重要声明与提示

《工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金（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。

本基金托管人申万宏源证券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、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2021 年 1 月 15 日工银瑞信基金管理有限公司网站（www.icbccs.com.cn）、上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》等法律文件。

二、基金概览

- 1、基金名称：工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金二级市场交易简称：新药 ETF；扩位证券简称：创新药产业 ETF；
- 3、二级市场交易代码：516060
- 4、基金申购、赎回简称：新药 ETF
- 5、申购、赎回代码：516061
- 6、截至公告日前两个工作日即 2021 年 2 月 22 日基金份额总额：290,237,400.00 份
- 7、截至公告日前两个工作日即 2021 年 2 月 22 日基金份额净值：0.9704 元
- 8、本次上市交易份额：290,237,400.00 份
- 9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 10、上市交易日期：2021 年 3 月 1 日
- 11、基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
- 12、基金托管人：申万宏源证券有限公司
- 13、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 14、上市推荐人：申万宏源证券有限公司

三、基金的募集与上市交易

(一) 上市前募集情况

- 1、本基金注册申请的注册机构和准予注册文号：中国证监会证监许可【2020】3465号
- 2、基金运作方式：交易型开放式
- 3、基金合同期限：不定期
- 4、发售日期：2021年1月25日至2021年2月2日
- 5、发售面值：1.00元人民币
- 6、发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购
- 7、发售机构：

(1) 网上现金发售代理机构：

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

(2) 网下现金发售机构

①直销机构

工银瑞信基金管理有限公司

②发售代理机构

申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国金证券股份有限公司。

(3) 网下股票发售机构

①直销机构

工银瑞信基金管理有限公司

②发售代理机构

申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国金证券股份有限公司。

- 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、募集资金总额及入账情况：截至 2021 年 2 月 2 日，本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，本次募集相关的资产总额为 290,237,400.00 元人民币，其中网下现金认购资金在募集期间产生的利息折份额部分共计人民币 5,400.00 元。现金认购资金及折份额的利息已于 2021 年 2 月 8 日划入本基金托管账户。募集期内未有投资者通过网下股票认购方式认购创新药产业 ETF。网上现金认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 71,155.17 元归入基金资产，将于下一个季度结息日（若遇节假日则顺延至下一工作日）后划入本基金托管账户。

10、基金备案情况

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《工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）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 2021 年 2 月 9 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：2021 年 2 月 9 日。

12、基金合同生效日的基金总份额：290,237,400.00 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：上海证券交易所自律监管决定书【2021】69 号

2、上市交易日期：2021 年 3 月 1 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金二级市场简称：新药 ETF

5、基金二级市场交易代码：516060

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、本次上市交易份额：290,237,400.00 份

7、基金资产净值的披露：在开始办理基金份额申购或者赎回或上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

8、未上市交易份额的流通规定：本基金所有份额均上市交易。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即 2021 年 2 月 22 日，本基金的基金份额持有人户数为 3,915 户，平均每户持有的基金份额为 74,134.71 份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2021 年 2 月 22 日，基金份额合计为 290,237,400.00 份，基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的本基金的基金份额为 77,752,400.00 份，占比 26.79%；

个人投资者持有的本基金的基金份额为 212,485,000.00 份，占比 73.21%。

（三）基金场内份额前十名持有人情况（截至 2021 年 2 月 22 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	工银瑞信添福混合型养老金产品—中国 工商银行股份有限公司	10,001,000.00	3.45
2	何杰辉	9,999,000.00	3.45
3	中国国际金融股份有限公司	8,000,000.00	2.76
4	中信建投证券股份有限公司	8,000,000.00	2.76
5	中信证券股份有限公司	8,000,000.00	2.76
6	光大证券股份有限公司	7,500,000.00	2.58
7	招商证券股份有限公司	7,000,000.00	2.41
8	广发证券股份有限公司	6,000,000.00	2.07
9	工银瑞信添颐混合型养老金产品—中国 工商银行股份有限公司	5,000,000.00	1.72
10	长沙金信置业控股有限公司	4,000,000.00	1.38

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：赵桂才（代）

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

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

本公司下设二十二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、销售服务部、产品管理部、财务部、人力资源部、战略发展部、纪委办公室、法律合规部、内控稽核部、风险管理部、信息科技部、运作部、北京分公司、上海分公司、深圳分公司。

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管理工作。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除共同基金外其余资产组合的日常投资管理工作。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、产品和服务工作。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、产品开发和服

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，以及公司投资服务工作。中央交易室负责投资指令的交易执行工作。营销管理部负责公司渠道代销和券商直销业务的管理,以及品牌管理和媒体关系维护。战略客户部负责公司主权类机构业务、非银行机构业务、公司业务、养老金战略客户等销售管理。互联网金融部负责公司互联网金融创新业务。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工作。人力资源部负责公司人力资源招聘、薪酬、考核等工作，承担党委宣传部、党委组织部职能。战略发展部负责公司发展战略研究分析、股权管理及培训管理、行政管理，承担党委办公室、办公室、董监事会办公室相关职能。纪委办公室承担纪委日常工作职责。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、网络安全和维护。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。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司（含子公司）共有员工 697 人，平均年龄 34 岁，75%的员工拥有硕士以上学历。公司投研团队由资深基金经理和研究员组成，投研人员 187 人，投资人员平均拥有约 13 年的从业经验。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司旗下管理 164 只开放式基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、QDII、FOF 等不同类型，建立了覆盖高中低风险等级的公募基金产品线。

3、本基金基金经理

邓皓友先生，7 年证券从业经验；曾在瀚华金控股份有限公司担任数据分析师；2014 年加入工银瑞信，现任指数投资中心衍生品投资研究员、基金经理。2019 年 10 月 29 日至今，担任工银瑞信创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 29 日至今，担任工银瑞信 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，担任工银瑞信中证消费服务领先交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 2 月 9 日至今，担任工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号恒奥中心 B 座

法定代表人：杨玉成

成立日期：2015 年 01 月 16 日

基金托管业务批准文号：《关于核准申万宏源证券有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可（2019）1165 号）

组织形式：有限责任公司（非自然人投资或控股的法人独资）

注册资本：4700000 万人民币

存续期间：无限期

联系人：刘尚文

联系电话：010-88085720

申万宏源证券有限公司（简称“申万宏源证券”），是由新中国第一家股份制证券公司——申银万国证券股份有限公司与国内资本市场第一家上市证券公司——宏源证券股份有限公司，于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。申万宏源证券是一家综合性、全牌照大型券商，目前，注册资本 470 亿元，拥有正式员工 9000 余名，在全国设有 34 家区域分公司和 309 家营业部（含西部证券），并设有中国香港、伦敦、东京、新加坡、首尔等海外分支机构。2019 年 4 月 26 日，申万宏源证券母公司——申万宏源集团在香港联交所挂牌上市成为 A+H 股上市公司。

申万宏源证券目前拥有全面的证券类业务资格，主要包括：证券经纪、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、证券投资基金代销、为期货公司提供中间介绍业务（以上各项业务限新疆、甘肃、陕西、宁夏、青海、西藏以外区域），证券资产管理，证券承销与保荐（限除可转换债券以外的各类债券品种），证券自营（除服务新疆、甘肃、陕西、宁夏、青海、西藏区域证券经纪业务客户的证券自营外），股票期权做市，证券投资基金托管。同时，申万宏源证券还设有申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源（国际）集团有限公司、申银万国证券研究所有限公司、申银万国期货有限公司、申银万国投资有限公司、申银万国创新证券投资有限公司、申万菱信基金管理有限公司、富国基金管理有限公司等 8 家子公司。

申万宏源证券正在中投公司、中央汇金公司等股东单位的大力支持下，契合国家发展战略重点布局上海、新疆、香港、新加坡等区域，通过转型创新不断做大做强，打造“有信仰、

敢担当”的国内一流金融企业，为中国资本市场的创新发展做出积极贡献。

此外，申万宏源证券还具有以下业务资格：

(1) 经中国证监会核准或认可的业务资格：企业年金基金投资管理人资格、沪深交易所债券质押式报价回购业务资格、贵金属现货合约自营资格、黄金现货合约自营资格、合格的境内投资者资格、国债期货自营业务资格、上海黄金交易所银行间黄金询价业务资格，信用衍生品业务资格、国债期货做市业务资格。

(2) 交易所核准的业务资格：沪深交易所约定购回式证券交易权限、上海证券交易所国债买断式回购参与主体资格、上海证券交易所固定收益证券综合电子平台交易商（一级）资格、上海证券交易所上证 50ETF 期权合约品种一般做市商资格、沪深交易所股票质押式回购交易权限、上海证券交易所港股通业务交易权限、深港通下港股通业务交易权限、现金管理产品快速取现业务资格、上海黄金交易所特别会员资格、股票期权经纪、自营业务交易权限。

(3) 中国证券业协会核准的业务资格：场外金融衍生品试点资格、柜台市场试点资格、互联网证券业务试点资格、场外期权业务二级交易商资格、大连股权交易中心推荐挂牌、定向增资业务资格。

(4) 中国人民银行核准的业务资格：上海自贸区分账核算业务资格、全国银行间同业拆借市场同业拆借业务资格、全国银行间债券交易市场准入资格。

(5) 其他：非金融企业债务融资工具承销业务资格、中国银行间市场交易商协会会员资格、信用风险缓释工具核心交易商资格、信用风险缓释凭证创设机构资格、信用联结票据创机构资格、上海清算所债券交易净额清算业务资格、银行间债券市场尝试做市业务权限、利率互换市场业务资格、代理证券账户业务资格、证券质押登记业务委托代理资格、股票期权业务试点证券资金结算资格、中央国债登记结算有限责任公司乙类结算会员资格、证券业务外汇经营资格、境外证券投资外汇额度批复、中国外汇交易中心外币拆借业务资格、全国中小企业股份转让系统主办券商业务（推荐、经纪、做市业务）、浙江股权交易中心推荐挂牌、定向增资业务资格、转融通业务资格、机构间私募产品报价与服务系统做市商资格、受托管理保险资金业务资格、军工涉密业务咨询服务业务资格、债券通业务资格。

2、主要人员情况

申万宏源证券基金托管业务由托管中心（一级部门）具体负责。基金托管业务团队由托管中心下设估值核算部、资金监督部、运营支持部三个二级部门共同组成。申万宏源证券拥

有一支多元共融的基金托管专业队伍，共计 23 人，平均年龄在 35 岁以下，所有人员均获得基金从业资格。相关从业人员均为业务经验丰富、专业能力强、素质高的业务精英，其中 80%以上是具有 5 年以上从业经验的专业人员，核心业务岗位人员平均具备 7 年以上托管从业经验。业务人员在长期的业务工作中，积累了丰富的业务处理经验，擅长处理各类个性化需求和复杂业务；运营支持人员具备金融、会计、法律、信息技术等专业学历和工作背景，可综合解决基金运营过程中的各类复合型问题。整个托管业务团队不仅在业务领域具有专业业务水平，还具有横向综合的业务把控能力，能够从容应对托管业务中各类专业问题。

刘晔先生，申万宏源证券托管中心总经理：北京理工大学管理学硕士，自 2000 年 11 月起供职于宏源证券股份有限公司（2015 年并入申万宏源证券），此后一直在证券公司负责运营清算工作，2018 年 8 月起担任申万宏源证券托管中心总经理，负责基金托管业务。

3、基金托管业务经营情况

申万宏源证券于 2019 年 7 月获得中国证监会行政许可《关于核准申万宏源证券有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可（2019）1165 号），取得证券投资基金托管资格。申万宏源证券严格遵守国家法律法规、监管机构及自律组织的相关规定，在健全的内控体系下，依靠业务团队丰富的经验、规范的管理运作模式、先进安全的业务系统，切实履行资产托管人职责，保障基金资产安全。

4、基金托管人的内部控制制度

（1）内部控制目标

保证基金托管业务的运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；防范和化解业务经营风险，保证托管资产的安全、完整；维护基金份额持有人的权益；保障业务安全、有效、稳健运行。

（2）内部控制原则

1) 合法性原则。基金托管业务内部控制和 risk 管理制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于基金托管业务经营管理活动的始终。

2) 全面性原则。基金托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

3) 及时性原则。基金托管业务经营活动必须能在发生时准确、及时地记录；按照“内部控制优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须已建立相关的规章制度。

4) 审慎性原则。基金托管业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产的安

全与完整。

5) 有效性原则。内部控制和 Risk 管理制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

6) 独立性原则。公司托管的基金资产、公司的自有资产、公司托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内部控制制度的检查、评价部门必须独立于内部控制制度的制定和执行部门。

(3) 内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司内部控制指引》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》法律法规、部门规章等规章制度，申万宏源证券建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制和 Risk 管理体系，确保基金托管业务规范、安全、高效运行。

内部控制主要制度包括《申万宏源证券有限公司证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金托管业务和外包服务从业人员管理规程》、《证券投资基金托管业务和外包服务内部控制和 Risk 管理规程》、《证券投资基金托管业务和外包服务信息隔离墙管理规程》、《证券投资基金托管业务和外包服务内部稽核管理规程》、《证券投资基金托管业务和外包服务信息系统权限管理规程》、《证券投资基金托管业务和外包服务档案和信息保密管理规程》、《托管业务及外包服务应急处置操作规程》、《证券投资基金托管业务资产保管管理规程》、《证券投资基金托管业务资金清算管理规程》、《证券投资基金托管业务估值核算管理规程》、《证券投资基金托管业务估值核算指引》、《证券投资基金托管业务投资监督管理规程》、《证券投资基金托管业务信息披露管理规程》、《证券投资基金托管业务信息系统管理规程》等。

在申万宏源证券 Risk 管理体系下，建立健全基金托管业务的全面 Risk 管理体系，覆盖各 Risk 类型、各业务条线、各业务流程、全部客户，形成统一的风险理念、Risk 语言和 Risk 政策。建立健全 Risk 管理的配套制度、组织架构、技术系统、指标体系、专业队伍、应对机制和文化。建立多层次、多维度的控制体系，并动态调整。在申万宏源证券整体管理体系下，建立健全授权管理体系，并严格执行。建立健全 Risk 管理信息收集机制，全面、系统的识别、分析可能面临的 Risk 及其来源、特征、触发条件和潜在影响等要素，并分类管理。建立健全应急处理机制，明确责任、规范程序，并持续改进。

托管业务内部控制的主要措施包括：岗位隔离机制、双人复核机制、权限管理机制、人员培训机制、工作日志机制、关键信息人工抽查验证机制、应急演练机制、备份机制、独立

的数据获取机制、严格的准入机制等。

5、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

(1) 监督方法

基金托管人依照《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关法规、基金合同及相关协议的约定，监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同、协议等规定，对基金管理人运作基金的投资对象、投资组合的投资比例、投资范围、基金资产净值的计算、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、基金管理人发送的投资指令、相关信息披露等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

(2) 监督程序

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时向基金管理人发出书面通知限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认，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，基金托管人根据具体情况及时报告中国证监会。

通过技术或非技术手段发现基金管理人重大违规行为，有权立即报告中国证监会同时电话或书面通知管理人进行解释或举证，并限期纠正。

(三) 登记结算机构

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：戴文华

电话：010-50938931

传真：010-50938907

联系人：徐一文

(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：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：张勇、朱宏宇

联系电话：(021) 23238888

传 真：(021) 23238800

联系人：朱宏宇

(五) 基金上市推荐人

名称：申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号恒奥中心 B 座

法定代表人：杨玉成

成立日期：2015 年 01 月 16 日

基金托管业务批准文号：《关于核准申万宏源证券有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可（2019）1165 号）

组织形式：有限责任公司（非自然人投资或控股的法人独资）

注册资本：4700000 万人民币

存续期间：无限期

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）

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

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 2021 年 2 月 22 日的资产负债表如下：

单位：人民币元

资产：	期末数	负债：	期末数
银行存款	80,633,108.29	短期借款	
结算备付金	100,000,000.00	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	121,084,171.80	卖出回购金融资	

		产款	
其中：股票投资	121,084,171.80	应付证券清算款	20,306,407.05
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	46,440.41
基金投资		应付托管费	7,224.10
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	92,299.37
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	194,880.04	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	7,644.14
其他资产	202,750.25	负债合计	20,460,015.07
		所有者权益：	
		实收基金	290,237,400.00
		未分配利润	-8,582,504.69
		所有者权益合计	281,654,895.31
资产合计	302,114,910.38	负债与持有人权益总计	302,114,910.38

八、基金投资组合

截至 2021 年 2 月 22 日，本基金的投资组合如下：

(一) 截至 2021 年 2 月 22 日，本基金资产组合情况

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	121,084,171.80	40.08
	其中：股票	121,084,171.80	40.08
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	180,633,108.29	59.79
8	其他资产	397,630.29	0.13
9	合计	302,114,910.38	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 2021 年 2 月 22 日，指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	90,592,896.80	32.16
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	2,560,200.00	0.91
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	19,746,984.00	7.01
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	7,531,700.00	2.67
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	652,391.00	0.23
	合计	121,084,171.80	42.99

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

2、截至 2021 年 2 月 22 日，积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

3、截至 2021 年 2 月 22 日，按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

(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

1、截至 2021 年 2 月 22 日，指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603259	药明康德	98,100	15,431,130.00	5.48
2	600276	恒瑞医药	121,400	12,141,214.00	4.31
3	000661	长春高新	24,400	10,712,332.00	3.80
4	300122	智飞生物	55,000	9,496,300.00	3.37
5	300347	泰格医药	45,100	7,531,700.00	2.67
6	300142	沃森生物	132,908	6,625,463.80	2.35
7	600196	复星医药	103,900	4,884,339.00	1.73
8	300601	康泰生物	29,300	4,658,407.00	1.65
9	002007	华兰生物	94,200	4,437,762.00	1.58
10	002821	凯莱英	12,500	3,557,750.00	1.26

2、截至2021年2月22日，积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票明细

无。

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

截至 2021 年 2 月 22 日，本基金未持有债券。

(五) 按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

截至 2021 年 2 月 22 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 2021 年 2 月 22 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权证投资明细

截至 2021 年 2 月 22 日，本基金未持有权证。

(八) 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2021 年 2 月 22 日，本基金未持有股指期货投资，也无期间损益。

(九) 按公允价值占净值比例大小排序的前五名贵金属明细

截至 2021 年 2 月 22 日，本基金未持有贵金属。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2021 年 2 月 22 日，本基金未持有国债期货投资，也无期间损益。

（十一）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 2021 年 2 月 22 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 2021 年 2 月 22 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	194,880.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	71,155.17
7	待摊费用	131,595.08
8	其他	-
9	合计	397,630.29

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2021 年 2 月 22 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

无。

九、重大事件揭示

无。

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、上海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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

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

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为申万宏源证券有限公司。上市推荐人与本基金管理人之间不存在任何关联关系。

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》规定的相关条件；

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

十三、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中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金注册的文件

（二）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）《工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

-
- (六) 《工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
 - (七) 《工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
 - (八) 中国证监会规定的其他文件

工银瑞信基金管理有限公司

二〇二一年二月二十四日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人简介

（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：赵桂才（代）

设立日期：2005年6月21日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【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）基金托管人简况

名称：申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：杨玉成

成立时间：2015年01月16日

批准设立机关和文号：中国证监会 证监许可[2015]95号

组织形式：有限责任公司

注册资本：4700000.000000万人民币

基金托管资格批文及文号：证监许可[2019]1165号

存续期间：持续经营

二、基金合同当事人及权利义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

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股票、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 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结算业务并获得《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、转融通证券出借业务；
 - (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
 - (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
 - (16) 选择、更换基金申购赎回代理券商，对基金申购赎回代理券商的相关行为进行监督和处理；
 - (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、赎回等业务规则；
 - (18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
 - (2) 办理基金备案手续；
 - (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
 - (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式

管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购对价、赎回对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 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，基金管理人承担全部募集费用，将已募集的认购款项、连同认购款项的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；对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，登记机构应予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；

(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，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(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，因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

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

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《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不少于法定最低期限；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

-
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
 - (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
 - (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会，并通知基金管理人；
 - (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
 - (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
 - (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
 - (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金和本基金联接基金（即“工银瑞信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“联接基金”）的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（一）召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定的以外，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，但基金合同另有约定的除外；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规或中国证监会要求或者根据基金合同约定调整上述报酬标准的除外；
- (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；
- (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) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被证券交易所终止上市的除外；
- (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、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规、上海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；
- (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) 基金管理人、上海证券交易所和登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

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

(7) 基金推出新业务或服务；

(8) 增设新的基金份额类别、在其他境内外证券交易所上市、开通或暂停跨系统转托管业务；

(9) 增加、减少、调整基金份额类别设置；

(10) 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

额持有人依法自主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、基金份额持有人会议的召集人有权决定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《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公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用纸质、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 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表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

在符合上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

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、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金分红方式；
- 3、当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0%以上时，可进行收益分配；
- 4、基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率；
- 5、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；
- 6、基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，将对上述基金收益分配原则进行调整，并于变更实施日前在规定媒介公告。

（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 日内在规定媒介公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

五、基金费用与税收

（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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、公证费、审计费、诉讼费和仲裁费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券/期货等交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金上市费及年费；

9、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；

10、基金相关账户的开户及维护费用；

11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金的标的指数许可使用费不由基金资产承担。

（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 0.45%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 0.07%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.07\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致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，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

六、基金的投资

（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，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以参与转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现

金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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。

（三）投资策略

本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

在一般情形下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产投资组合，但在特殊情况下，本基金可以选择其它证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不得超过 2%。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。

1、股票资产日常投资组合管理

（1）投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和组合调整。

1) 确定目标组合：根据复制标的指数成份股及其权重的方法确定目标组合。

2) 确定建仓策略：根据对成份股流动性、公司行为等因素的分析，确定合理的建仓策略。

3) 组合调整：根据复制法确定目标组合之后，在合理时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

（2）投资组合日常管理

1) 根据标的指数构成及权重，结合基金当前持有的证券组合及其比例，制作下一交易日基金的申购赎回清单并公告。

2) 将基金持有的证券组合构成与标的指数进行比较，制定目标组合构成及权重，确定

合理的交易策略。

3) 实施交易策略, 以实现基金最优组合结构。

(3) 标的指数成份股票定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告, 在指数成份股调整生效前, 分析并确定组合调整策略, 及时进行投资组合的优化调整, 减少流动性冲击, 尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息(如: 股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等), 以及成份股公司其他重大信息, 分析这些信息对指数的影响, 并根据这些信息确定基金的申购赎回清单以及基金的每日交易策略。

(5) 标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内, 若出现成份股票临时调整的情形, 本基金管理人将密切关注样本股票的调整, 并及时制定相应的投资组合调整策略。

(6) 申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息, 结合基金的现金头寸管理, 分析其对组合的影响, 制定交易策略以应对基金的申购赎回。

(7) 跟踪偏离度的监控与管理

基金经理每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度。每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等, 并优化跟踪偏离度管理方案。

(8) 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上, 根据审慎原则合理参与存托凭证的投资, 以更好地跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

2、股指期货投资策略

本基金为提高投资效率更好地达到本基金的投资目标, 在风险可控的前提下, 以套期保值为目的, 本着谨慎原则, 参与股指期货投资。本基金将根据对现货和期货市场的分析, 发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点, 采用股指期货在短期内取代部分现货, 获取市场敞口, 投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。

3、资产支持证券投资策略

本基金将重点对拟投资标的的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等因素进行分析，同时密切关注流动性变化对标的的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

4、其他金融工具投资策略

本基金基于流动性管理的需要，可以投资于债券等固定收益类工具，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

（四）投资限制

1、组合限制

基金管理人运用基金财产进行证券投资，遵守下列限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；

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

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（4）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（6）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(7) 本基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(8) 本基金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%，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；

(9) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列投资比例的限制：

1) 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%；

2) 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 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 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%；

4) 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%；

5) 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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

6) 本基金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；

(10) 本基金参与转融通证券出借业务，应当遵守以下交易限制：

1) 参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应归为流动性受限资产；

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不低于 2 亿元；

4) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(12) 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；

(13) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(14) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第(6)、(10)、(11)和(12)项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(10)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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，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。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关

联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，或以变更后的规定为准，不需要经基金份额持有人大会审议，但需提前公告。

七、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、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得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

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，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

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

(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符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法定最低期限。

九、争议的处理和适用的法律

对于因《基金合同》的订立、内容、履行和解释而产生的或与《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。不愿或者不能通过协商、调解方式解决的，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。仲裁裁决是终局性的，对各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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（不含港澳台立法）管辖。

十、基金合同的存放及查阅方式

《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。