

# 富国中证 ESG120 策略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：富国基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2021 年 7 月 1 日

公告日期：2021 年 6 月 28 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.....          | 8  |
| 六、基金合同摘要.....             | 13 |
| 七、基金财务状况.....             | 13 |
| 八、基金投资组合.....             | 14 |
| 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、备查文件目录.....            | 20 |
| 附件：基金合同内容摘要.....          | 22 |

## 一、重要声明与提示

《富国中证 ESG120 策略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”）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，富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人富国基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人华夏银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2021 年 5 月 26 日披露于本基金管理人网站（[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的基金的基金合同、托管协议、招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件。

本基金投资中的风险详见招募说明书“风险揭示”章节，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式基金，特定风险还包括：标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数值计算出错的风险、标的指数编制方案带来的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、指数成份股停牌的风险等等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。另外，本基金在上海证券交易所上市交易，对于选择通过二级市场交易的投资者而言，其投资收益为

买卖价差收益，交易费用和二级市场流动性因素都会在一定程度上影响投资者的投资收益。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金基金合同及招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：富国中证 ESG120 策略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：ESG 龙头（扩位简称：ESG 龙头 ETF）
- 3、二级市场交易代码：516400
- 4、基金场内申购、赎回简称：ESG 龙头
- 5、场内申购、赎回代码：516401
- 6、截至公告日前两个工作日（即 2021 年 6 月 24 日）基金份额总额：  
241,458,957.00 份
- 7、截至公告日前两个工作日（即 2021 年 6 月 24 日）基金份额净值：1.0001  
元
- 8、本次上市交易份额：241,458,957.00 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 7 月 1 日
- 11、基金管理人：富国基金管理有限公司
- 12、基金托管人：华夏银行股份有限公司
- 13、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

本基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

### 三、基金的募集与上市交易

#### （一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2021 年 3 月 31 日证监许可〔2021〕1104 号。

2、基金运作方式：契约型，交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2021 年 5 月 31 日至 2021 年 6 月 9 日。其中，网下现金认购的日期为 2021 年 5 月 31 日至 2021 年 6 月 9 日；网上现金认购的日期为 2021 年 6 月 7 日至 2021 年 6 月 9 日；网下股票认购的日期为 2021 年 5 月 31 日至 2021 年 6 月 9 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：网下现金认购和网下股票认购 8 个工作日，网上现金认购 3 个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

8、发售机构：

##### （1）发售主协调人

中航证券有限公司

##### （2）网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构

安信证券股份有限公司（不参与网下股票认购）、长江证券股份有限公司（不参与网下股票认购）、东北证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司（不参与网下现金认购）、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司（不参与网下股票认购）、申万宏源证券有限公司（不参与网下股票认购）、中国银河证券股份有限公司（不参与网下股票认购）、中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司。

##### （3）网上现金认购的发售代理机构

具有基金销售业务资格，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任

公司认可的证券公司（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

9、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况

富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金首次募集的实收基金现金部分合计为人民币 241,458,957.00 元。其中净认购资金人民币 241,445,000.00 元已于 2021 年 6 月 16 日全部划至基金托管账户。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 70,312.53 元，其中利息折份额金额为人民币 13,957.00 元，剩余人民币 56,355.53 元归入基金财产（到期付息以 2021 年 6 月 20 日实际结息使用利率所计算的利息金额为准），该款项将于下一个银行结息日（2021 年 6 月 20 日）后划入基金托管账户。

本次首次发行募集的实收基金股票部分，其有效股票认购数量按认购期最后一日的均价计算的认购金额为人民币 0.00 元，折合基金份额 0.00 份。

本次募集有效认购户数为 2,000 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 241,458,957.00 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

11、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》以及《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2021 年 6 月 16 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

12、基金合同生效日：2021 年 6 月 16 日。

13、基金合同生效日的基金份额总额：241,458,957.00 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]269 号

2、上市交易日期：2021 年 7 月 1 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金二级市场交易简称：ESG 龙头（扩位简称：ESG 龙头 ETF）

5、二级市场交易代码：516400

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：ESG 龙头

7、申购、赎回代码：516401

本基金管理人自 2021 年 7 月 1 日开始办理本基金的申购和赎回业务。投资者应当在本基金指定的申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的申购赎回代理券商包括：国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

本公司可适时增加或调整申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

8、本次上市交易份额：241,458,957.00 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 2021 年 6 月 24 日，本基金场内份额持有人户数为 2,000 户，平均每户持有的基金份额为 120,729.48 份。

### （二）持有人结构

截至 2021 年 6 月 24 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 236,504,957.00 份，占基金总份额的 97.95%；个人投资者持有的基金份额为 4,954,000.00 份，占基金总份额的 2.05%。

### （三）前十名基金份额持有人的情况

| 序号 | 基金份额持有人名称                             | 持有份额          | 占场内基金总份额的比例（%） |
|----|---------------------------------------|---------------|----------------|
| 1  | UBS AG                                | 40,000,000.00 | 16.57%         |
| 2  | 创金合信基金－华夏银行－创金合信华睿2号集合资产管理计划          | 20,007,500.00 | 8.29%          |
| 3  | 丰琰投资管理（浙江自贸区）有限公司－丰琰泰合私募证券投资基金        | 15,000,000.00 | 6.21%          |
| 4  | 中信建投证券－中信建投期货有限公司－中信建投聚智多策略2号单一资产管理计划 | 10,000,000.00 | 4.14%          |
| 5  | 方正中期期货有限公司                            | 10,000,000.00 | 4.14%          |
| 6  | 银河期货有限公司                              | 9,999,000.00  | 4.14%          |
| 7  | 五矿证券有限公司                              | 8,001,666.00  | 3.31%          |
| 8  | 东兴证券股份有限公司                            | 8,001,333.00  | 3.31%          |
| 9  | 申万宏源证券有限公司                            | 8,000,000.00  | 3.31%          |
| 10 | 中国中金财富证券有限公司                          | 8,000,000.00  | 3.31%          |

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：富国基金管理有限公司
- 2、法定代表人：裴长江
- 3、总经理：陈戈
- 4、注册资本：5.2 亿元人民币
- 5、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层
- 6、设立批准文号：证监基金字【1999】11 号
- 7、工商登记注册的统一社会信用代码：91310000710924515X
- 8、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
- 9、股权结构（截止于 2021 年 5 月 31 日）：



| 股东名称          | 出资比例    |
|---------------|---------|
| 海通证券股份有限公司    | 27.775% |
| 申万宏源证券有限公司    | 27.775% |
| 加拿大蒙特利尔银行     | 27.775% |
| 山东省国际信托股份有限公司 | 16.675% |

#### 10、内部组织结构及职能：

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理的工作，确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则，防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设三十一个部门、三个分公司和二个子公司，分别是：权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、固定收益交易部、多元资产投资部、量化投资部、海外权益投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、机构业务部、养老金业务部、银行业务部、券商业务部、机构服务部、零售业务部、营销管理部、客户服务部、电子商务部、战略与产品部、合规稽核部、风险管理部、计划财务部、人力资源部、综合管理部（董事会办公室）、信息技术部、运营部、不动产基金管理部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理（香港）有限公司、富国资产管理（上海）有限公司。

权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益投资部：根据法律法规、公司规章制度、契约要求，在授权范围内，负责固定收益类公募产品和部分非固定收益类公募产品的投资管理；固定收益专户投资部：负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理；固定收益信用研究部：建立和完善债券信用评级体系，开展信用研究等，为公司固定收益类投资决策提供研究支持；固定收益策略研究部：开展固定收益投资策略研究，统一固定收益投资中台管理，为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制；固定收益交易部：在公司投委会、分管领导授权范围内，负责审核并执行各固定收益投资组合指令，实现对投资交易一线风险控制的前提下，高效、公平地完成投资指令，并结合执行情况完成交易反馈；多元资产投资部：根据法律法规、公司规章

制度、契约要求，在授权范围内，负责 FOF 基金投资运作和跨资产、跨品种、跨策略的多元资产配置产品的投资管理；量化投资部：负责公司有关量化投资管理业务；海外权益投资部：负责公司在中国境外（含香港）的权益投资管理；权益专户投资部：负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理；养老金投资部：负责养老金（企业年金、职业年金、基本养老金、社保等）及类养老金专户等产品的投资管理；权益研究部：负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等；集中交易部：负责除固定收益之外的各类投资交易和风险控制；机构业务部：负责保险、财务公司、上市公司、主权财富基金、基金会、券商、信托、私募、同业养老金管理人、同业公募基金 FOF、海外客户等客群的销售与服务；养老金业务部：负责养老金第一、第二支柱客户、共同参与第三支柱客户的销售与服务；银行业务部：负责银行客户的金融市场部、同业部、资产管理部、私人银行部等部门非代销销售与服务；券商业务部：根据公司发展战略，以券商客户为核心，打造包括私募、上市公司等在内的券商业务生态圈，深耕券商总部及分支机构，带动券商代销及相关业务的发展，不断增加券商保有规模，提升公司品牌影响力，为公司整体业务协同提供有效补充；机构服务部：负责协调三个机构销售部门对接公司资源，实现项目落地，提供专业支持和项目管理，对公司已有机构客户进行持续专业服务；零售业务部：管理华东营销中心、华中营销中心、广东营销中心、深圳营销中心、北京营销中心、东北营销中心、西部营销中心、华北营销中心，负责公募基金的零售业务；营销管理部：负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒介关系管理，为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持；客户服务部：拟定客户服务策略，制定客户服务规范，建设客户服务团队，提高客户满意度，收集客户信息，分析客户需求，支持公司决策；电子商务部：负责基金电子商务发展趋势分析，拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则，有效推进公司电子商务业务；战略与产品部：负责开发、维护公募和非公募产品，协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略，建立数据搜集、分析平台，为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持；合规稽核部：履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职责，开展内部审计，管理信息披露、法律事务等；风险管理部：执行公司整体风险管理策略，牵头拟定公司风险管理制

度与流程，组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对，负责公司旗下各投资组合合规监控等；信息技术部：负责软件开发与系统维护等；运营部：负责基金会计与清算；不动产基金管理部：根据公司发展战略，开展公开募集基础设施证券投资基金业务等；计划财务部：负责公司财务计划与管理；人力资源部：负责人力资源规划与管理；综合管理部（董事会办公室）：负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司（内部）宣传、信息调研、行政后勤管理等工作；富国资产管理（香港）有限公司：证券交易、就证券提供意见和提供资产管理；富国资产管理（上海）有限公司：经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。

#### 11、人员情况

截止到 2021 年 5 月 31 日，公司有员工 546 人，其中 74%以上具有硕士及以上学历。

#### 12、信息披露负责人：赵瑛

电话：021-20361818

#### 13、基金管理业务介绍

截至 2021 年 3 月 31 日，本公司旗下共管理 199 只公募基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，公募基金资产管理规模超过 7000 亿元。

#### 14、本基金基金经理

蔡卡尔，硕士，自 2013 年 8 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员；自 2017 年 1 月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2017 年 5 月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理，2018 年 5 月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月起任富国中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 4 月起任富国中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；兼任量化投资部量化投资副总监。具有基金从业资格。

### （二）基金托管人

#### 1、基金托管人基本情况

名称：华夏银行股份有限公司（简称：“华夏银行”）

住所：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：李民吉

成立时间：1992 年 10 月 14 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：15387223983 元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行[银复（1992）391 号]

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]25 号

联系人：郑鹏

电话：（010）85238667

传真：（010）85238680

## 2、主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理室、运营室、创新与产品室 5 个职能处室。资产托管部共有员工 50 人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

## 3、基金托管业务经营情况

华夏银行于 2005 年 2 月 23 日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会核准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神，始终遵循“安全保管基金资产，提供优质托管服务”的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至 2021 年 3 月末，托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、保险资管计划、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计 10675 只，证券投资基金 71 只，全行资产托管规模达到 55634.03 亿元。

### （三）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：蒋燕华

经办注册会计师：蒋燕华、费泽旭

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书及相关公告设定的费率收取认购费。

### （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2021年6月24日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

| 资产      | 期末余额           | 负债和所有者权益  | 期末余额 |
|---------|----------------|-----------|------|
| 资产：     |                | 负债：       |      |
| 银行存款    | 238,844,041.83 | 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 | 2,676,334.46   | 卖出回购金融资产款 | —    |

|             |                       |                   |                       |
|-------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| 其中：股票投资     | 2,676,334.46          | 应付证券清算款           | —                     |
| 基金投资        | —                     | 应付赎回款             | —                     |
| 债券投资        | —                     | 应付管理人报酬           | 26,466.23             |
| 资产支持证券投资    | —                     | 应付托管费             | 5,293.25              |
| 贵金属投资       | —                     | 应付销售服务费           | —                     |
| 衍生金融资产      | —                     | 应付交易费用            | 2,444.71              |
| 买入返售金融资产    | —                     | 应交税费              | —                     |
| 应收证券清算款     | —                     | 应付利息              | —                     |
| 应收利息        | 9,366.63              | 应付利润              | —                     |
| 应收股利        | —                     | 递延所得税负债           | —                     |
| 应收申购款       | —                     | 其他负债              | 12,218.67             |
| 递延所得税资产     | —                     | <b>负债合计</b>       | <b>46,422.86</b>      |
| 其他资产        | —                     | 所有者权益：            |                       |
|             |                       | 实收基金              | 241,458,957.00        |
|             |                       | 未分配利润             | 24,363.06             |
|             |                       | 所有者权益合计           | 241,483,320.06        |
| <b>资产总计</b> | <b>241,529,742.92</b> | <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>241,529,742.92</b> |

## 八、基金投资组合

本基金目前仍处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

截至 2021 年 6 月 24 日，本基金的投资组合如下：

（一）基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
|    | 权益投资              | 2,676,334.46   | 1.11         |
|    | 其中：股票             | 2,676,334.46   | 1.11         |
|    | 固定收益投资            | —              | —            |
|    | 其中：债券             | —              | —            |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
|    | 贵金属投资             | —              | —            |
|    | 金融衍生品投资           | —              | —            |
|    | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
|    | 银行存款和结算备付金合计      | 238,844,041.83 | 98.89        |
|    | 其他资产              | 9,366.63       | 0.00         |
|    | 合计                | 241,529,742.92 | 100.00       |

注：本基金将按照相关法律法规的要求，在上市前完成基金投资组合与标的指数的拟合。

（二）按行业分类的股票投资组合

1、积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：截止 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有积极投资股票

2、指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | —       | —            |

|   |                  |              |      |
|---|------------------|--------------|------|
| B | 采矿业              | 37,533.00    | 0.02 |
| C | 制造业              | 1,431,435.60 | 0.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 53,411.00    | 0.02 |
| E | 建筑业              | 119,525.00   | 0.05 |
| F | 批发和零售业           | 15,415.00    | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 96,699.00    | 0.04 |
| H | 住宿和餐饮业           | —            | —    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 63,120.00    | 0.03 |
| J | 金融业              | 701,268.00   | 0.29 |
| K | 房地产业             | 62,476.00    | 0.03 |
| L | 租赁和商务服务业         | 38,368.00    | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业       | —            | —    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | —            | —    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | —            | —    |
| P | 教育               | —            | —    |
| Q | 卫生和社会工作          | 50,468.86    | 0.02 |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 6,615.00     | 0.00 |
| S | 综合               | —            | —    |
|   | 合计               | 2,676,334.46 | 1.11 |

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|



|    |        |       |       |            |      |
|----|--------|-------|-------|------------|------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 100   | 206,805.00 | 0.09 |
| 2  | 600036 | 招商银行  | 3,200 | 176,000.00 | 0.07 |
| 3  | 000858 | 五 粮 液 | 400   | 117,080.00 | 0.05 |
| 4  | 601601 | 中国太保  | 3,300 | 101,376.00 | 0.04 |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药  | 1,200 | 81,600.00  | 0.03 |
| 6  | 601919 | 中远海控  | 2,900 | 77,401.00  | 0.03 |
| 7  | 002415 | 海康威视  | 1,200 | 76,080.00  | 0.03 |
| 8  | 000333 | 美的集团  | 1,000 | 73,200.00  | 0.03 |
| 9  | 601166 | 兴业银行  | 3,200 | 65,408.00  | 0.03 |
| 10 | 600309 | 万华化学  | 600   | 62,994.00  | 0.03 |

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：截止 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有积极投资股票。

（四）按债券品种分类的债券投资组合

注：截至 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有债券。

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：截至 2021 年 6 月 24 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序的前十名资产支持证券投资明细

注：截至 2021 年 6 月 24 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序的前五名贵金属投资明细

注：截至 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有贵金属投资。

（八）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：截至 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有权证。

（九）本基金投资的股指期货交易情况说明

注：截止 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有股指期货。

（十）本基金投资的国债期货交易情况说明

注：截止 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有国债期货。

（十一）投资组合报告附注

1、申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。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“招商银行”的发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等 27 项违法违规事实，中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日对公司做出罚款 7170 万元的行政处罚（银保监罚决字〔2021〕16 号）。

招商银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

本报告编制日前一年内，本基金持有的“兴业银行”的发行主体兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”），由于存在同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规事实，中国银保监会福建监管局于 2020 年 8 月 31 日对公司做出没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元的行政处罚（闽银保监罚决字〔2020〕24 号）；由于存在为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；违反银行卡收单外包管理规定等 5 项违法违规事实，中国人民银行福州中心支行于 2020 年 9 月 4 日对公司做出警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款的行政处罚（福银罚字〔2020〕35 号）。

兴业银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余 8 名证券的发行主体本期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、申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。

本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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    | 9,366.63 |
| 5 | 应收申购款   | —        |
| 6 | 其他应收款   | —        |
| 7 | 待摊费用    | —        |
| 8 | 其他      | —        |
| 9 | 合计      | 9,366.63 |

#### 4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细

注：截止 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有可转换债券。

#### 5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### （1）指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截止 2021 年 6 月 24 日，本基金指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

##### （2）积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：截止 2021 年 6 月 24 日，本基金未持有积极投资股票。

## 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

本基金管理人就本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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

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

## 十二、备查文件目录

以下备查文件存放于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。

- （一）中国证监会准予本基金募集注册的文件
- （二）《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- （四）《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （五）法律意见书

(六) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

**风险提示：**

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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本基金的基金合同、基金招募说明书和基金产品资料概要等产品法律文件和风险揭示书，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。

富国基金管理有限公司

2021 年 6 月 28 日

## 附件：基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及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) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和收益分配等的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(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、赎回的对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他

人泄露；

(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、足额支付投资者申购或赎回之基金份额的投资者应收对价；

(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条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期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存款利息（税后）在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；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。

## (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；
- (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、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货等交易资金清算；
- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户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、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；
- (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 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和义务

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、基金产品资料概要等信息披露文件；

(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) 交纳基金认购款项和认购股票、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、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。若未来本基金份额持有人大会成立日常机构，则按照届时有效的法律法规的规定执行。

若以本基金为目标基金且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，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。

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、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整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；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或者变更收费方式;
- (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) 标的指数更名或调整指数编制方法,以及变更基金名称、业绩比较基准;
- (6) 按照中证指数有限公司的要求,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、支付方式或收取下限等;
- (7) 基金推出新业务或服务;
- (8) 基金管理人、相关证券交易所、基金登记机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整或修改《业务规则》,包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、基金交易、非交易过户、转托管等内容;
- (9) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成;
- (10) 调整基金份额净值、申购赎回清单的内容、计算和公告的时间或频率;
- (11) 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、开通跨系统转托管等业务;
- (12) 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;
- (13) 调整基金收益分配原则;
- (14) 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，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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



2、通讯开会。通讯开会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、在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他书面或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，具体方式在会议通知中列明。

4、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、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。

## （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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

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

## 三、基金合同的变更、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，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

## （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过符合《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，由基金财产清算小组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。

### 四、争议解决方式

(一) 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，均应提交上海国际经济贸易仲裁委员会按照申请仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

(二) 基金合同受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）管辖。

### 五、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。