

---

# 工银瑞信中证稀有金属主题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：华泰证券股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2023年3月10日

公告时间：2023年3月7日

---

## 目 录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	4
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	8
五、基金主要当事人简介.....	9
六、基金合同摘要.....	16
七、基金财务状况（未经审计）.....	17
八、基金投资组合.....	19
九、重大事件揭示.....	22
十、基金管理人承诺.....	23
十一、基金托管人承诺.....	24
十二、备查文件目录.....	25

---

## 一、重要声明与提示

《工银瑞信中证稀有金属主题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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，工银瑞信中证稀有金属主题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，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金托管人华泰证券股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2023 年 1 月 19 日深圳证券交易所网站（[www.szse.cn](http://www.szse.cn)）、工银瑞信基金管理有限公司网站（[www.icbccs.com.cn](http://www.icbccs.com.cn)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《工银瑞信中证稀有金属主题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：工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金类别：股票型
- 3、基金运作方式：交易型开放式
- 4、基金场内简称：稀有金属 ETF 基金
- 5、基金代码：159671
- 6、标的指数名称：中证稀有金属主题指数
- 7、标的指数代码：930632
- 8、基金存续期限：不定期
- 9、基金份额总额：截至 2023 年 3 月 3 日，本基金的基金份额总额为 1,835,051,737.00 份。
- 10、基金份额净值：截至 2023 年 3 月 3 日，本基金的基金份额净值为 0.9867 元。
- 11、本次上市交易的基金份额总额：1,835,051,737.00 份（截至 2023 年 3 月 3 日）
- 12、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 13、上市交易日期：2023 年 3 月 10 日
- 14、基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司
- 15、基金托管人：华泰证券股份有限公司
- 16、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 17、申购赎回代理券商：具体请见《工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》以及相关公告。

---

### 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【2022】2530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：2023年2月6日至2023年2月13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：

投资者可直接通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务，具体名单如下：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、网信证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

#### (2) 网下现金、网下股票发售直销机构：

工银瑞信基金管理有限公司。

#### (3) 网下现金发售代理机构（排名不分先后）：

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、中信证券华南股份有限公司、招商证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、华泰证券股

---

份有限公司、浙商证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。

(4) 网下股票发售代理机构（排名不分先后）：

中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、西南证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司。

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、认购资金总额及入账情况：

本次募集的净认购金额为人民币 1,834,952,955.00 元（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的利息转份额的银行利息共计人民币 98,782.00 元。本次募集所有资金已于 2023 年 2 月 17 日全额划入本基金在基金托管人华泰证券股份有限公司开立的“华泰托管工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金”托管专户。

10、基金备案情况

本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《工银瑞信中证稀有金属主题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 2023 年 2 月 17 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：2023 年 2 月 17 日。

12、基金合同生效日的基金总份额：1,835,051,737.00 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：深圳证券交易所深证上【2023】157 号

2、上市交易日期：2023 年 3 月 10 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基金场内简称：稀有金属 ETF 基金

5、基金交易代码：159671

投资者在深圳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：1,835,051,737.00 份（截至 2023 年 3 月 3 日）

---

7、基金净值的披露：基金管理人于每个开放日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日进行揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：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 2023 年 3 月 3 日，本基金的基金份额持有人户数为 19,790 户，平均每户持有的基金份额为 92,726.21 份。

##### （二）持有人结构

截至 2023 年 3 月 3 日，基金份额合计为 1,835,051,737.00 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 117,098,559.00 份，占比 6.38%；

个人投资者持有的本基金的基金份额为 1,717,953,178.00 份，占比 93.62%。

##### （三）基金场内份额前十名持有人情况（截至 2023 年 3 月 3 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	到金（北京）投资管理有限公司— 到金德胜 1 期私募证券投资基金	10,000,291.00	0.54
2	中国银河证券股份有限公司	8,300,051.00	0.45
3	卞东辉	5,000,437.00	0.27
4	淄博圣达置业有限责任公司	5,000,437.00	0.27
5	段友贞	5,000,437.00	0.27
6	康淇	5,000,437.00	0.27
7	云量科技（北京）有限责任公司	5,000,437.00	0.27
8	李朝云	5,000,388.00	0.27
9	林仁从	5,000,340.00	0.27
10	黄俊	5,000,340.00	0.27



---

## 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

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、FOF投资部、养老金投资中心、指数及量化投资部、研究部、中央交易室、营销管理部、战略客户部、数字金融部、产品管理部、综合管理部、风险管理部、法律合规部、内控稽核部、财务部、人力资源部、纪委办公室、金融科技创新中心、客户服务部、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

---

日常投资管理工作的。

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的。

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、产品和服务工作的。

指数及量化投资部是公司主动、被动量化业务的归口管理部门，负责公司公募、专户、ETF、指数化等主被动量化业务的管理的。

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的。

中央交易室负责投资指令的交易执行工作的。

营销管理部负责银行、券商、独立销售机构等渠道和客户，各类代销和直销业务一体化业务的开拓、营销和维护工作的。

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的。

数字金融部负责数字化营销的组织和实施，推进互联网金融创新业务落地和平台建设的。

产品管理部负责产品创新、开发与管理。

综合管理部负责公司发展战略研究分析、股权管理及品牌管理和媒体关系维护。承担党委办公室、办公室、董监事会办公室相关职能的。

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的。

法律合规部负责公司法律合规工作的。

内控稽核部负责公司内控稽核工作的。

财务部负责公司财务管理工作的。

人力资源部负责公司人力资源招聘、培训、薪酬、考核等工作，承担党委宣传部、党委组织部职能的。

纪委办公室承担纪委日常工作职责的。

金融科技创新中心负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行、网络安全和维护的。

客户服务部负责投资者教育工作，建设和运营公司投教基地、呼叫中心，开展直销柜台业务，为公司高端要客陪伴服务的。

运作部负责公司开放式基金的注册登记、清算、核算和会计工作的。

北京分公司负责实施区域内渠道代销、机构等业务的营销、拓展、维护和服务等工作的。

---

上海分公司负责实施区域内渠道代销、机构等业务的营销、拓展、维护和服务等工作。

深圳分公司负责实施区域内渠道代销、机构等业务的营销、拓展、维护和服务等工作。

目前，公司共有员工 683 人，平均年龄 35 岁，79%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 198 人，投资人员平均拥有约 13 年的从业经验。

截至 2023 年 2 月 28 日，公司旗下管理 230 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

史宝琰先生，8 年证券从业经验；曾任 Amazon Inc. 数据分析工程师，华夏基金高级经理；2019 年加入工银瑞信，现任指数及量化投资部基金经理。2021 年 12 月 1 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的基金经理；2022 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2022 年 3 月 21 日至今，担任工银瑞信中证线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 22 日至今，担任工银瑞信国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 1 月 4 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 1 月 4 日至今，担任工银瑞信中证沪港深互联网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；2023 年 2 月 17 日至今，担任工银瑞信中证稀有金属主题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：华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人：张伟

设立时间：1991 年 4 月 9 日

批准设立机关：中国人民银行总行

批准设立文号：银复[1990]497 号文

---

基金托管资格批文及文号：《关于核准华泰证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（中国证监会证监许可[2014]1007号）

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：907558.9027万人民币

联系电话：025--83388463

联系人：尹鹏

#### （1）托管人公司介绍

华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）前身为江苏省证券公司，于1990年12月经中国人民银行总行批准设立，1991年4月9日领取企业法人营业执照，1991年5月26日正式开业。1994年，经江苏省体改委批准，公司改制为定向募集股份公司。1997年6月，公司更名为“江苏证券有限责任公司”。1999年3月，公司更名为“华泰证券有限责任公司”。2007年11月29日经中国证监会批准，公司整体变更为“华泰证券股份有限公司”。2007年12月7日，公司办理了工商登记变更手续。2009年7月，公司吸收合并信泰证券有限责任公司。2010年2月，公司成功在上交所挂牌上市。2015年6月，公司在香港联交所主板挂牌上市。2019年6月，公司发行的GDR在伦交所主板市场上市交易。华泰证券是一家国内领先的大型综合证券集团，具有庞大的客户基础、领先的互联网平台和敏捷协同的全业务链体系。公司搭建了客户导向的组织机制，通过线上线下有机结合的方式，为个人和机构客户提供全方位的证券及金融服务，并致力于成为兼具本土优势和全球视野的一流综合金融集团。监管部门对公司的分类结果：2016年为B类BBB级，2017年为A类AA级，2018年为A类AA级，2019年为A类AA级，2020年为A类AA级。

#### （2）主要人员情况

华泰证券资产托管部充分发挥作为新兴托管券商的证券市场专业化优势，搭建了由高素质人才组成的专业化托管团队。现有员工中本科以上学历占比100%，硕士研究生人员占比超过90%，专业分布合理，是一支诚实勤勉，开拓创新的资产托管从业人员团队。

#### （3）基金托管业务经营情况

华泰证券于2014年9月29日经中国证监会核准取得证券投资基金托管资格，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。华泰证券始终坚持稳健的经营理念，严格管理、审慎经营、规范运作，注重风险管理，保持良好的资本结构，严格遵守国家有关基金托管业务的法律法规、行业监管规章和公司有关管理规定，规范运作、严格管理，确保基

---

金托管业务的稳健运行。

华泰证券资产托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时披露，为基金份额持有人利益履行基金托管职责，保证基金份额持有人的合法权益。

## 2、托管业务的内部控制制度

### （1）内部控制目标

遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规则和公司有关管理规定，秉持稳健经营、规范运作的理念，在组织体系、决策授权、制度流程等方面进一步完善风险控制措施，防范和化解风险，保证托管资产的安全完整；维护基金份额持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

### （2）风险治理组织架构

华泰证券风险管理组织架构包括四个主要部分：董事会及合规与风险管理委员会、总裁室及风险控制委员会、首席风险官、各职能部门以及各业务部门。

董事会是风险管理的最高决策机构，并对公司全面风险管理体系的有效性承担最终责任。董事会设合规与风险管理委员会，对风险管理的总体目标、基本政策、风险评估报告进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见。总裁室是风险管理的最高执行机构，根据董事会的授权和批准，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作，并下设风险控制委员会。公司设首席风险官，负责全面风险管理工作。在主要业务部门都设立了一线的风险控制组织，各级组织和人员需在授权范围内履行风险管理的职责，分工明晰，强调相互协作。公司指定风险管理部履行风险管理职责，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议。合规法律部是华泰证券合规管理的核心职能部门，主要负责对公司经营管理活动和员工执业行为进行合规管理，以及管理公司的法律事务工作。稽查部负责对公司各级部门的风险管理、内部控制及经营管理绩效进行独立、客观地检查、监督、评价，并督促其改进。各部门分工协作，各有侧重，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价三道防线功能。资产托管部通过设立内部合规岗位、内控检查机制、报告机制等方式，实现对各类风险的全面有效管理，保证在合法合规、稳健规范的基础上开展基金托管业务。

### （3）内部控制制度及措施

华泰证券资产托管业务具备了系统、完善的内部控制制度体系，建立了业务管理制度、

---

内部控制制度、业务操作流程，涵盖了业务管理操作、会计核算、监督和内控、信息系统、内部管理等各方面，覆盖了资产托管业务开展的各个重要环节，能够有效指导业务正常运转、稳健发展。

主要风险控制措施：（1）通过严格的业务隔离制度、专用交易单元及结算备付金账户、合理的账户结构、核算对账机制、实物资产盘点制度、内部多层次监督检查机制、系统保障客户资金安全、安防控制等措施有效控制资产安全风险；（2）通过监督管理机制、建立并完善投资监督系统、投资监督管理实施方案、核心业务数据向公司风控部门开放、透明化运作等措施有效控制投资监督风险；（3）通过内部管理控制制度、多维度对账机制、复核监督机制、系统故障应急处理机制和灾难备份机制等措施有效防范资金清算风险；（4）通过明确指令处理相关要素机制、严格资金划付管理流程、划款指令审核机制、监控资金变动机制、人工备份划款方式、及时沟通反馈机制等措施有效防范资金交收风险；（5）通过协议约定估值方法、信息传递程序及差错处理机制、独立会计核算机制、建立对账机制、会计资料管理调阅机制、差错及应急处理机制等措施有效防范资产净值估算错误风险；（6）通过信息披露和保密制度、协议约定信息披露的内容和程序、原始账簿数据分析和采集机制、信息批露授权机制等措施有效防范信息披露风险。

### 3、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

基金托管人根据《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》、《基金合同》、《托管协议》和相关法律法规的规定对基金投资范围、投资对象、禁止投资行为，基金投资、融资比例，基金管理人参与银行间债券市场，基金管理人投资受限证券，选择存款银行进行监督。对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额（参考）净值计算、应收资金到账、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和《托管协议》的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，

---

基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告，由此造成的损失由基金管理人承担。

（三）基金登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

注册登记业务办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：4008058058

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

（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：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：魏佳亮、朱寅婷

联系电话：(021) 23238212

传真：(021) 23238800

联系人：魏佳亮

---

## 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）

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支。

深圳证券交易所所在本基金成立后至上市交易公告书公告前未收取任何费用。

本基金成立后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

本基金截至 2023 年 3 月 3 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	312,280,559.38	短期借款	
结算备付金	450,459,508.32	交易性金融负债	
存出保证金	524,990.06	衍生金融负债	
交易性金融资产	1,147,622,102.94	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	1,147,622,102.94	应付证券清算款	99,485,414.94
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	67,539.93
基金投资		应付托管费	10,506.21
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	820,010.20
应收证券清算款		应付税费	
应收利息		应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	9,669.90
其他资产	239,752.29	<b>负债合计</b>	<b>100,393,141.18</b>
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	1,835,051,737.00
		未分配利润	-24,317,965.19
		<b>所有者权益合计</b>	<b>1,810,733,771.81</b>

---

资产合计	1,911,126,912.99	负债与持有人权益 总计	1,911,126,912.99
------	------------------	----------------	------------------

## 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约定。

截至2023年3月3日，工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的投资组合如下：

### （一）截至2023年3月3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	1,147,622,102.94	60.05
	其中：股票	1,147,622,102.94	60.05
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	762,740,067.70	39.91
8	其他资产	764,742.35	0.04
9	合计	1,911,126,912.99	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2023年3月3日，本基金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	129,952,854.68	7.18
C	制造业	1,002,929,692.26	55.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,739,556.00	0.81
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,147,622,102.94	63.38

本基金 2023 年 3 月 3 日未持有指数投资境内股票。

## 2、2023 年 3 月 3 日积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金 2023 年 3 月 3 日未持有积极投资境内股票。

### (三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1、截止 2023 年 3 月 3 日，本基金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	000792	盐湖股份	6,095,255	149,150,889.85	8.24
2	002466	天齐锂业	1,164,700	93,443,881.00	5.16
3	002460	赣锋锂业	1,267,500	89,903,775.00	4.97
4	603799	华友钴业	1,438,090	83,553,029.00	4.61
5	600111	北方稀土	2,464,400	69,175,708.00	3.82
6	603993	洛阳钼业	8,096,358	48,416,220.84	2.67
7	002738	中矿资源	605,920	44,280,633.60	2.45
8	002192	融捷股份	353,000	34,346,900.00	1.90
9	002176	江特电机	1,921,600	33,973,888.00	1.88
10	688122	西部超导	369,192	33,973,047.84	1.88

2、2023 年 3 月 3 日积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投

#### 资明细

2023 年 3 月 3 日，本基金未持有积极投资股票。

### (四) 按券种分类的债券投资组合

截至 2023 年 3 月 3 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 2023 年 3 月 3 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2023年3月3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2023年3月3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

(1) 截至2023年3月3日, 本基金未持有股指期货。

(2) 截至2023年3月3日, 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

(九) 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

2023年2月17日(基金合同生效日)至2023年3月3日, 本基金投资的前十名证券的发行主体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、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2023年3月3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	524,990.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	108,738.14
7	待摊费用	131,014.15
8	其他	-
9	合计	764,742.35

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2023年3月3日, 本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2023年3月3日, 本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

---

## 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、深圳证券交易所的监督管理。

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

---

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《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

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稀有金属主题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）《工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（六）《工银瑞信中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（七）《工银瑞信中证稀有金属主题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

2023年3月7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9层甲5号901

法定代表人：赵桂才

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：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：南京市江东中路228号

邮政编码：210019

法定代表人：张伟

成立时间：1991年4月9日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2014]1007号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：玖拾亿柒仟陆佰陆拾伍万圆

存续期间：持续经营

### 二、基金合同当事人及权利义务

#### （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》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利及债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、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,因监管机构、司法机关等有权机关要求以及审计、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,保存期限不低于法定最低期限;
  - (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合

---

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，相关冻结机构应予以解冻，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。

## (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，因监管机构、司法机关等有权机关要求以及审计、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。

### 三、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。

鉴于本基金和本基金联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金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并表决。在计算参会份额和票数时，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或基金合同另有约定的以外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 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；
- (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、深圳证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (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、深圳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或调整基金份额类别设置、在其他境内外证券交易所上市、开通或停止场外申购赎回、开通或暂停跨系统转托管业务；

(9) 本基金的联接基金通过特殊申购参与本基金的申购赎回；

(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。除法律法规、中国证监会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异议，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、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标的指数同期累计报酬率；

4、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；

5、基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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性不利影响的前提下，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，无需召开基金份额持有人大会。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的基金收益分配对象、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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### （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。

## 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；

9、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布相关费用、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。

(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，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

---

4、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的标的指数许可使用费（由基金管理人承担）；

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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，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（含存托凭证）、其他股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、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。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

#### 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。

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、可转换债券、可交换债券投资

可转换债券、可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点，是本基金的重要投资对象之一。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券、可交换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

#### 5、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。

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。

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) 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

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款项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。