

华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券
投资基金（QDII）上市交易公告书

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

上市时间：2024年7月16日

公告日期：2024年7月11日

目 录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	2
三、基金的募集与上市交易.....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	10
五、基金主要当事人简介.....	12
六、基金合同摘要.....	20
七、基金财务状况（未经审计）.....	23
八、基金投资组合.....	25
九、重大事件揭示.....	28
十、基金管理人承诺.....	28
十一、基金托管人承诺.....	30
十二、基金上市推荐人意见.....	31
十三、备查文件目录.....	32
附录：基金合同摘要	33

一、重要声明与提示

华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）托管人招商银行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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容，请详细阅读2024年6月19日披露在基金管理人网站(www.huatai-pb.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)上的《华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称：华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

2、基金二级市场交易简称：沙特ETF（扩位简称：沙特ETF）

3、二级市场交易代码：520830

4、基金申购、赎回简称：沙特ETF

5、申购、赎回代码：520830

6、截止公告日前两个工作日即2024年7月9日基金份额总额：
589,619,000.00 份

7、截止公告日前两个工作日即2024年7月9日基金份额净值：0.9911元

8、本次上市交易份额：589,619,000.00 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：2024年7月16日

11、基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

12、基金托管人：招商银行股份有限公司

13、上市推荐人：国泰君安证券股份有限公司

14、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：国盛证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华金证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、江海证券有限公司、海通证券股份有限公司、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。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2024]911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、发售日期为2024年6月24日至2024年7月2日。网下现金发售的日期为2024年6月24日至2024年7月2日，网上现金发售的日期为2024年6月26日至2024年7月2日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购。

7、发售机构

（1）网上现金发售代理机构

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询。

（2）网下现金发售直销机构

华泰柏瑞基金管理有限公司

（3）网下现金发售代理机构

1) 国投证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

法定代表人：段文务

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

2) 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：高涛

客服电话：95532

公司网址：www.china-invs.cn

3) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

4) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座办
公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

5) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：肖海峰

客服电话：95548

公司网址：sd.citics.com

6) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层办
公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：胡伏云

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

7) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101

办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：王晟

客服电话：4008-888-888、95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

8) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

9) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

客服电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

10) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼

法定代表人：张伟

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

11) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座16层

法定代表人：王常青

客服电话：95587/4008-888-108

公司网址：www.csc108.com

12) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

13)粤开证券股份有限公司

注册地址：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、
23 层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

客户服务电话：95564

公司网址：<http://www.ykzq.com>

14)湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11
楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11
楼

法定代表人：孙永祥

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

15)平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层(518048)

法定代表人：谢永林

客服电话：95511*8

公司网址：stock.pingan.com

16)国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六
层

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼机构事业部

法定代表人：张纳沙

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

17)国泰君安证券股份有限公司。

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

（二）基金合同生效

截至2024年7月2日本基金募集工作顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集确认的募集金额总额为589,619,000.00元人民币（含所募集股票市值），折合基金份额589,619,000.00份；其中募集期间认购资金利息折合基金份额的共计0份。募集资金已于2024年7月5日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为7,665户，按照每份基金份额初始面值人民币1.00元计算，本次募集期间有效认购份额（含所募集股票市值）和利息结转的基金份额合计589,619,000.00份，已全部计入相应基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。本基金管理人及本公司的基金从业人员没有认购本基金。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《华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，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2024年7月5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。

（三）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2024]91。

2、上市交易日期：2024年7月16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：沙特ETF（扩位简称：沙特ETF）。
- 5、二级市场交易代码：520830。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
- 6、基金申购、赎回简称：沙特ETF。
- 7、申购、赎回代码：520830。

本基金管理人自2024年7月16日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。目前本基金的一级交易商包括：

序号	券商名称	客服电话	公司网址
1	国盛证券有限责任公司	956080	www.gszq.com
2	西部证券股份有限公司	95582	www.west95582.com
3	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
4	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com
5	国泰君安证券股份有限公司	95521	www.gtja.com
6	方正证券股份有限公司	95571	www.foundersc.com
7	华金证券股份有限公司	956011	www.huajinsc.cn
8	中国中金财富证券有限公司	95532	www.ciccwm.com
9	中泰证券股份有限公司	95538	www.zts.com.cn
10	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
11	华安证券股份有限公司	400-809-6518	www.hazq.com
12	湘财证券股份有限公司	95351	www.xcsc.com
13	申万宏源西部证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
14	申万宏源证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
15	渤海证券股份有限公司	956066	www.ewww.com.cn
16	平安证券股份有限公司	95511*8	stock.pingan.com
17	国金证券股份有限公司	95310	www.gjzq.com
18	中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinastock.com.cn
19	招商证券股份有限公司	95565	www.newone.com.cn
20	国信证券股份有限公司	95536	www.guosen.com.cn
21	东吴证券股份有限公司	400-860-1555 或 96288	www.dwzq.com.cn
22	江海证券有限公司	400-666-2288	www.jhzq.com.cn
23	海通证券股份有限公司	95553	www.htsec.com
24	中信证券（山东）有限责 任公司	95548	sd.citics.com
25	中信证券股份有限公司	95548	www.cs.ecitic.com
26	中信证券华南股份有限公司	95548	www.gzs.com.cn

- 8、本次上市交易份额：589,619,000.00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2024年7月9日，本基金份额持有人户数为7,665户，平均每户持有的基金份额为76,923.55份。

（二）持有人结构

截至2024年7月9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272,704,000.00份，占基金总份额的46.25%；个人投资者持有的基金份额为316,915,000.00份，占基金总份额的53.75%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2024年7月9日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	香港上海汇丰银行有限公司	72,000,000.00	12.21%
2	BARCLAYS BANK PLC	72,000,000.00	12.21%
3	北京明晟东诚私募基金管理中心（有限合伙）—明晟东诚明灯尊享2号FOF私募证券投资	15,100,000.00	2.56%
4	北京明晟东诚私募基金管理中心（有限合伙）—明晟东诚火星1期主动式FOF私募证券	10,773,000.00	1.83%
5	张虹	10,000,000.00	1.70%
6	简街香港有限公司—JSQB有限公司（R）	10,000,000.00	1.70%
7	北京明晟东诚私募基金管理中心（有限合伙）—明晟东诚火星6期主动式FOF私募证券	7,864,000.00	1.33%
8	北京明晟东诚私募基金管理中心（有限合伙）—明晟东诚火星7期主动式FOF私募证券	7,020,000.00	1.19%
9	中国国际金融股份有限公司	7,000,000.00	1.19%

9	中信证券股份有限公司	7,000,000.00	1.19%
9	华泰证券股份有限公司	7,000,000.00	1.19%
9	方正证券股份有限公司	7,000,000.00	1.19%
9	北京明晟东诚私募基金管理中心（有限合伙）—汇信行知星亨明晟东诚兴泰 1 号 FOF 私	7,000,000.00	1.19%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
 - 2、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层
 - 3、法定代表人：贾波
 - 4、总经理：韩勇
 - 5、成立日期：2004 年 11 月 18 日
 - 6、批准设立机关：中国证券监督管理委员会
 - 7、批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号
 - 8、工商登记注册的法人营业执照文号：913100007178517770
 - 9、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
 - 10、组织形式：有限责任公司
 - 11、注册资本：贰亿元人民币
 - 12、存续期间：持续经营
 - 13、信息披露负责人：刘万方
- 联系电话：400-888-0001，（021）38601777
- 14、股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

15、内部组织结构及职能：

公司设立了权益投资决策委员会、固定收益投资决策委员会、专户投资决策委员会、基金中基金（FOF）投资决策委员会、基金投资顾问业务投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。权益投资决策委员会、固定收益投资决策委员会、专户投资决策委员会、基金中基金（FOF）投资决策委员会、基金投资顾问业务投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

目前，公司下设 33 个部门，并在北京、深圳分别设立了分公司。

投资一部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

投资二部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

投资三部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

投资四部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

专户投资部：负责公司权益专户投资相关业务。

研究部：负责权益类基金的股票研究。

固定收益部：负责公司固定收益的投资管理。

机构投资管理部：负责专户的理财管理，对内管理服务机构销售人员。

指数投资部：负责指数研究、设计和开发工作，以及进行指数产品的投资管理。

量化与海外投资部：负责量化和海外 QDII 产品的投资管理。

资产配置部：负责基金投资顾问业务、FOF 业务。

交易部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行交易指令执行与监督。

华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心（深圳分公司）、华北营销中心（北京分公司）、西南营销中心：负责基金销售。

机构业务部（北京）、机构业务部（上海）、机构业务部（深圳）：负责机构客户的业务拓展。

券商业务部：负责券商客户的业务拓展。

市场营销部：负责公司品牌、基金产品的市场推广服务。

销售管理部：负责对外开拓维护渠道总部，对内管理服务渠道销售人员。

客户服务部：负责公司的客户服务。

产品与业务发展部：负责基金产品研发等新业务拓展。

基金事务部：负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

信息技术部：负责公司信息系统的日常运行与开发。

电子商务部：负责线上营销业务的业务开展。

合规法律部：负责内部法律事务咨询，处理外部法律事务，检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况，负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。

风险管理部：负责投资、交易环节风险提示及控制，研究公司风险管理政策与方针，协调各部门处理公司层面风险事项。

人力资源部：负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。

综合管理部：负责公司后勤服务、公文档案管理。

财务部：负责公司财务事项。

16、人员情况：

截至 2024 年 7 月 5 日，本公司共有员工 320 人。其中，投资研究团队共有人员 95 名，全公司取得基金从业资格的有 312 人。公司高级管理人员和从事研究、投资、估值、营销、监察稽核等业务的主要业务人员都已取得基金从业资格。在所有公司人员中，研究生及以上学历共有 245 人，占 77%；本科学历 67 人，占 21%。。

。

17、基金管理业务情况简介：

截至 2024 年 3 月 31 日，公司旗下管理 155 只开放式基金，其中包括 55 只股票型基金、61 只混合型基金、23 只债券型基金、3 只货币型基金、10 只 QDII 基金、2 只另类投资基金、1 只基金中基金。我司旗下管理的开放式基金包括上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰

柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基

金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞

恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞致远混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞益享债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦合债券型证券投资基金、华泰柏瑞祥泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞科技创新混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞中证 2000 指

数增强型证券投资基金、华泰柏瑞锦悦债券型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、华泰柏瑞上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金。

截至 2024 年 3 月 31 日，共管理 155 只基金，公司管理的基金资产规模为 3155.20 亿元，基金总份额为 4520.98 亿份。

18、本基金基金经理：

李沐阳先生，美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月起任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)的基金经理。

何琦先生，上海交通大学经济学学士。曾任汇丰银行证券服务部证券结算师，2008 年 11 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，曾任交易部高级交易员，海外投资部基金经理助理。2017 年 7 月起任华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 8 月起任华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投

资基金的基金经理。2020年12月起任华泰柏瑞中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年1月起任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021年5月起任华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金和华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2021年9月起任华泰柏瑞中证港股通50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022年1月起任华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022年4月起任华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。2022年12月起任华泰柏瑞中证香港300金融服务交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理。

（二）基金托管人

1、基金托管人概况

名称：招商银行股份有限公司

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：王良

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、基金托管业务经营情况

截至2023年12月31日，招商银行股份有限公司累计托管1374只证券投资基金。

（三）上市推荐人

国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：朱健

客户服务电话：95521/400-8888-666

网站：www.gtja.com

（四）一级交易商

序号	券商名称	客服电话	公司网址
1	国盛证券有限责任公司	956080	www.gszq.com
2	西部证券股份有限公司	95582	www.west95582.com
3	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
4	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com
5	国泰君安证券股份有限公司	95521	www.gtja.com
6	方正证券股份有限公司	95571	www.foundersc.com
7	华金证券股份有限公司	956011	www.huajinsec.com
8	中国中金财富证券有限公司	95532	www.ciccwm.com
9	中泰证券股份有限公司	95538	www.zts.com.cn
10	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
11	华安证券股份有限公司	400-809-6518	www.hazq.com
12	湘财证券股份有限公司	95351	www.xcsc.com
13	申万宏源西部证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
14	申万宏源证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
15	渤海证券股份有限公司	956066	www.ewww.com.cn
16	平安证券股份有限公司	95511*8	stock.pingan.com
17	国金证券股份有限公司	95310	www.gjzq.com
18	中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinastock.com.cn
19	招商证券股份有限公司	95565	www.newone.com.cn
20	国信证券股份有限公司	95536	www.guosen.com.cn
21	东吴证券股份有限公司	400-860-1555 或 96288	www.dwzq.com.cn
22	江海证券有限公司	400-666-2288	www.jhzq.com.cn
23	海通证券股份有限公司	95553	www.htsec.com
24	中信证券（山东）有限 责任公司	95548	sd.citics.com
25	中信证券股份有限公司	95548	www.cs.ecitic.com
26	中信证券华南股份有限 公司	95548	www.gzs.com.cn

（五）基金验资机构

机构名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦

507 单元01 室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：单峰、胡莲莲

联系人：胡莲莲

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

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从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至本公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至2024年7月9日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资 产：		负债：	
银行存款	583,173,052.37	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	295,364,787.84	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	294,248,450.35
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	32,181.24
基金投资	295,364,787.84	应付托管费	6,436.24
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息		应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	3,606.50
其他资产	153,009.81	负债合计	294,290,674.33
		所有者权益：	
		实收基金	589,619,000.00
		未分配利润	-5,218,824.31
		所有者权益合计	584,400,175.69
资产合计：	878,690,850.02	负债与持有人权益总计：	878,690,850.02

注：1、截至2024年7月9日，基金份额净值0.9911元，基金份额总额589,619,000.00份。

2、本报告期自2024年7月5日起至2024年7月9日止。本基金合同于2024年7月

5日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2024年7月9日，本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例（%）
权益投资		
其中：股票		
固定收益投资		
其中：债券		
基金	295,364,787.84	33.61
资产支持证券		
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	583,173,052.37	66.37
其他各项资产	153,009.81	0.02
合计	878,690,850.02	100.00

（二）在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布
截止2024年7月9日，本基金未持有股票及存托凭证。

（三）按行业分类的股票及存托凭证投资组合

截止2024年7月9日，本基金未持有股票及存托凭证。

（四）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证
明细

截止2024年7月9日，本基金未持有股票及存托凭证。

（五）按债券品种分类的债券投资组合

截止2024年7月9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五名债券投资明细
截止2024年7月9日，本基金未持有债券。

（七）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

资明细

截止2024年7月9日，本基金未持有资产支持证券。

（八）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资 明细

截止2024年7月9日，本基金未持有金融衍生品。

（九）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	CSOP Saudi Arabia ETF	ETF 基金	交易型开放式	CSOP Asset Management Limited	295,364,787.84	50.54

（十）投资组合报告附注

1、自本基金合同生效日至2024年7月9日，本基金前十名证券的发行主体中无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	应收股利	
2	应收利息	
3	其他资产	153,009.81
	合计	153,009.81

4、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细
截止2024年7月9日，本基金未持有资产支持证券。

5、本报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

截止2024年7月9日，本基金未持有可转换债券。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差

7、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規、部门規章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

九、重大事件揭示

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

十、基金管理人承诺

基金管理人就本基金上市交易后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

在本基金上市后，我行承诺严格遵守《基金法》等相关法规以及《华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》、《华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》的约定履行相应职责。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人国泰君安证券股份有限公司。上市推荐人就本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，文件内所载资料均经过核实。

十三、备查文件目录

- （一）中国证监会准予本基金注册的文件
- （二）《华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》
- （三）《华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》
- （四）《华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）法律意见书。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2024年7月11日

附录：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金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与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；在遵循基金份额持有人利益优先原则的前提下代表本基金就本基金所持有的标的 ETF 行使相关基金份额持有人权利；
- （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及转融通业务；
- （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、非交易过户、转托管等的业务规则，开通人民币之外的其他销售币种基金份额的申购、赎回等业务；

（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，进行基金、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、申购和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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

（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，保存期限不低于法律法规的规定；

（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，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）基金管理人应按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务，包括但不限于委托人身份识别、委托人身份和交易资料留存、资金来源和用途合法性审查、大额可疑交易报告、制裁筛查等，并为托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外；

（28）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，有权呈报中国证监会，并可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和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）选择、更换或撤销境外托管人并为之签署有关协议；

（8）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，

保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

（5）保管（或委托境外托管人保管）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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

（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，保存期限不低于法律法规的规定；

（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的现金部分；

（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

和银行业监督管理机构，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）当基金托管人将其义务委托第三方处理时，对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任。基金托管人委托的第三方机构不包括相关司法管辖区域内的证券登记、清算机构、第三方数据和信息来源机构、根据当地市场惯例无法向该服务提供方追偿的其他机构；

（23）资金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有，现金存入资金账户时构成境外托管人的等额债务，基金份额持有人不对该现金资产享有优先求偿权，除非法律法规及撤销或清算程序明文规定该等现金不归于清算财产外。境外托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行终止清算时，除非在相关法律法规强制要求下，不得将托管资产项下的证券、非现金资产归入其清算资产；

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

（25）安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

（26）按法律法规规定，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

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

（28）基金托管人应保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，保存期限不低于法律法规的规定；

（29）法律法规及中国证监会、外管局规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- （1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、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) 遵守基金管理人、销售机构、证券交易所和登记机构的相关交易及业务规则；

(10) 在购买本基金前认真阅读基金合同、托管协议，了解并接受基金管理人、基金托管人按照基金合同、托管协议就本基金海外投资运作、托管所作出的各项安排，愿意接受本基金资产在境外投资运作、托管中可能产生的法律风险、税收风险及《基金合同》所列明的其他风险；

(11) 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。

鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，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基金份额持有人大会。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

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

（8）变更基金投资目标、范围或策略，但由于标的 ETF 的基金交易方式变更、标的 ETF 终止上市、标的 ETF 的基金合同终止、标的 ETF 与其他基金进行合并、标的 ETF 的基金管理人发生变更而变更本基金投资目标、范围或策略的情况除外；

- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

- （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式、调整基金份额类别；

（3）因相应的法律法规、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变化；

（5）基金管理人、代销机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务的规则（包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整、申购对价/赎回对价组成的调整等）；

（6）基金推出新业务或服务；

（7）监管机关或证券交易所要求或决定本基金终止上市；

（8）由于标的 ETF 的基金交易方式变更、标的 ETF 终止上市、标的 ETF 的基金合同终止、标的 ETF 与其他基金进行合并、标的 ETF 的基金管理人发生变更而变更为直接投资于该标的指数成份股和备选成份股的指数基金；

（9）增加新的销售币种、调整现有基金销售币种设置、停止现有币种的销售；

（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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人

所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规及监管机构允许的前提下，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、电话或其他监管机构允许的方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式，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二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。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书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按照《信息披露办法》的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）标的ETF召开基金份额持有人大会时，本基金的基金管理人应当代表其基金份额持有人的利益，参与标的ETF的基金份额持有人大会，并在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

（十）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。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、当基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，可进行收益分配；
- 3、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基金份额净值低于面值；
- 4、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5、本基金收益分配采用现金方式；
- 6、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

基金管理人对于基金累计报酬率和标的指数同期累计报酬率的计算方法参见招募说明书。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无重大实质不利影响的情况下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金超额收益、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。

（三）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。

（四）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费，含境外托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后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、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金投资标的 ETF、境外股票而产生的各项合理费用（包括但不限于标的 ETF 的交易费用、申购赎回费用等）；
- 7、基金的证券/期货账户开立费用、证券/期货交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees），包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 10、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用），以及为基金利益聘请税务顾问产生的费用；
- 11、基金的开户费用、账户维护费用；
- 12、基金上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 13、除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；
- 14、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用（境外托管人垫付资金所产生的合理费用）；
- 15、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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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 0.10% 年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—15 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、指数许可使用费，指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产

中列支；

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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金主要通过投资于标的ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金以标的ETF基金份额为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、与标的指数相关的公募基金（含ETF）、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品以及其他境外市场投资工具和境内市场投资工具。

境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票以及存托凭证（下同））、衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、现金资产、货币市场工具以及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）。

境外市场投资工具包括在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转

让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金将根据法律法规的规定参与境内融资及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 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度扩大，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行标的 ETF 的买卖。本基金还将适度参与标的 ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利，力争增强基金收益。

本基金除主要投资标的 ETF 以外，还可投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、与标的指数相关的公募基金（含 ETF）、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品以及其他境内市场和境外市场依法发行的金融工具，追求尽可能贴近标的指数的表现。

2、股票（含存托凭证）投资策略

本基金对标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）的投资目的是构建

股票组合以申购标的 ETF。该部分资产投资主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组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（含存托凭证）及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。

特殊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（含存托凭证）流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票（含存托凭证）长期停牌；（4）其他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。

3、债券的投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。

其中可转换债券和可交换债券，结合了权益类证券与固定收益类证券的特性，具有下行风险有限同时可分享基础股票价格上涨的特点。本基金将评估其内在投资价值，结合对可转换债券、可交换债券市场上的溢价率及其变动趋势、行业资金的配置以及基础股票基本面的综合分析，最终确定其投资权重及具体品种。

4、衍生品投资策略

（1）境外金融衍生品投资策略

为更好地实现本基金的投资目标，本基金将在条件允许的情况下投资于远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品，以期降低跟踪误差水平。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的金融衍生品进行交易。

为了更好地跟踪标的指数，本基金还可通过投资外汇期货、外汇远期、外汇互换等来管理基金投资以及应对申购赎回过程中的汇率风险。

（2）境内金融衍生品投资策略

为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

1) 股指期货投资策略

本基金投资股指期货时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

2) 股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

3) 国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5、资产支持证券的投资策略

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

6、境内融资及转融通证券出借业务

本基金还可以参与境内融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。

7、境外回购交易及证券借贷交易策略

为更好地实现投资目标，增加基金收益，弥补基金运作成本，本基金在控制风险的前提下可以进行境外回购交易、境外证券借贷交易。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并按规定公告。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- 1) 本基金投资于标的 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；
- 2) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
- 3) 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

4) 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基金合同约定的投资范围保持一致；

本基金境内投资应遵循以下限制：

5) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；

6) 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%；

7) 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%；

8) 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%；

9) 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%；

10) 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；

11) 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；

12) 本基金参与股指期货和国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

①基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票和标的 ETF 总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

②基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

③在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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、标的 ETF、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；

④本基金所持有的股票市值、标的 ETF 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、标的 ETF 投资比例的有关约定；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

13) 基金因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽股票期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵股票期权保证金的现金等价物；未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

14) 本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

15) 本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

①出借证券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纳入流动性受限证券的范围；

②参与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得低于 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；

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本条规定的，基金管理人不得新增出借业务；

16) 本基金投资境内发行的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；

本基金境外投资应遵循以下限制：

17) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行，但在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

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

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

20) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%；

21) 金融衍生品投资限制

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

①基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

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

③基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%；

22) 本基金可以参与境外证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

24) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基

金总资产；

25) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述 3)、4)、5)、10)、15) 情形之外，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、标的 ETF 暂停申购、赎回、暂停上市或二级市场交易停牌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，基金管理人应当在所涉境内证券可交易之日起 10 个交易日内进行调整，所涉境外证券可交易之日起 30 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

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) 购买不动产；
- (2) 购买房地产抵押按揭；
- (3) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (4) 购买实物商品；
- (5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；该临时用途借入现金的比例超过基金资产净值的 10%；
- (6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品以及法律法规及中国证监会另有规定的除外；
- (7) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (8) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (9) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (10) 承销证券；
- (11) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (12) 从事承担无限责任的投资；

- （13）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （14）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （15）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

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。

（五）标的指数

本基金的标的指数为富时沙特阿拉伯指数。

本基金标的指数由富时国际有限公司编制并发布，是代表富时全球指数中具有沙特阿拉伯国籍大型及中型上市公司的表现的市值加权指数。

除基金合同另有约定外，未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

（六）业绩比较基准

业绩比较基准为富时沙特阿拉伯指数收益率（使用估值汇率折算）。

（七）风险收益特征

本基金标的 ETF 为股票指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的 ETF，紧密跟

踪指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要投资香港证券市场上上市的ETF，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

（八）标的ETF的变更

标的ETF出现下述情形之一的，本基金将本着维护投资者合法权益的原则并履行适当程序后，由主要投资于标的ETF变更为直接投资于该标的指数成份股和备选成份股的指数基金，无需召开基金份额持有人大会审议；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数或与其合并。相应地，基金合同中删除关于标的ETF的表述部分。基金管理人也可以履行适当程序后变更本基金的标的ETF，届时将由基金管理人另行公告。

- 1、标的ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；
- 2、标的ETF终止上市；
- 3、标的ETF基金合同终止；
- 4、标的ETF与其他基金进行合并；
- 5、标的ETF的基金管理人发生变更；
- 6、中国证监会规定的其他情形。

（九）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

六、基金资产净值的计算方式和公告方式

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的股票、基金、存托凭证、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定，并可参考国际会计准则。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

（四）估值方法

1、标的 ETF 估值方法

（1）本基金投资的标的 ETF 份额按照估值日标的 ETF 的基金份额净值估值。

（2）标的 ETF 估值日无份额净值披露的，以最近一日的份额净值估值。

（3）如果基金管理人认为按上述价格不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。

2、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

3、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、固定收益品种的估值

境内部分：

（1）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

（2）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

（3）对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净

价交易的债券，选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

（4）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

境外部分：

（1）对于首次发行未上市的境外债券按成本价估值；对于非上市境外债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

（2）对于上市流通的境外债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券，选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

5、同一证券同时在两个或者两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

6、衍生品估值方法：

（1）本基金境内投资国债期货合约、股指期货合约、股票期权合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

（2）境外上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（3）境外未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值；若衍生品价格无法通过公开信息取得，由基金管理人负责从其经纪商处取得，并及时告知基金托管人。

7、本基金投资境外存托凭证，公开挂牌的存托凭证按估值日在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。本基金投资境内存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

8、标的 ETF 以外基金估值方法：

非上市基金的估值：

（1）非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

（2）货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

上市基金的估值：

(1) 投资的 ETF 基金（标的 ETF 除外），按所投资 ETF 基金估值日的收盘价估值。

(2) 上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值。

(3) 上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。

(4) 上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

9、本基金参与融资或转融通证券出借业务，应参照监管机构或行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

10、本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应使用基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价或法律法规或监管机构允许的汇率；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

11、对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定及中国与该国或地区签署的相关税收协定履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的

损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

12、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

13、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对外公布的结果对外予以公布。

（五）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个估值日的下一个工作日计算该估值日基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日的下一个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日的下一个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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并履行适当程序后变更并公告。

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、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 4、基金合同约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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，但因本基金所持基金、证券的流动性受

到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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，保存期限不低于法律法规的规定。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

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

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

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

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。