

国泰上证科创板综合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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2025年3月12日

公告日期：2025年3月7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 .....	4
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.....	16
七、基金财务状况.....	17
八、基金投资组合.....	19
九、重大事项揭示.....	21
十、基金管理人承诺.....	23
十一、基金托管人承诺 .....	24
十二、基金上市推荐人意见 .....	25
十三、备查文件目录.....	26
附件：基金合同内容摘要 .....	27

## 一、重要声明与提示

国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《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，国泰基金管理有限公司（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。本基金托管人中国国际金融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。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资人详细查阅 2025 年 2 月 14 日发布在本基金管理人网站（[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)）上的《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金场内简称：科综国泰（扩位简称：科创综指 ETF 国泰）。
- 3、基金代码：589630。
- 4、2025 年 3 月 5 日基金份额总额：1,503,629,000.00 份。
- 5、2025 年 3 月 5 日基金份额净值：1.0003 元。
- 6、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 7、上市交易日期：2025 年 3 月 12 日。
- 8、基金管理人：国泰基金管理有限公司。
- 9、基金托管人：中国国际金融股份有限公司。
- 10、基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司。
- 11、上市推荐人：国泰君安证券股份有限公司。
- 12、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、联储证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、万联证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证

券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司。

基金管理人可依据实际情况调整申购赎回代理券商，并在基金管理人网站或相关公告列示。

### 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、基金募集申请的注册机构和注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2025】219号文。

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：本基金自2025年2月24日至2025年2月27日公开发售。其中，网上现金认购的日期为2025年2月24日至2025年2月27日，网下现金认购的日期为2025年2月24日至2025年2月27日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售方式：网上现金认购和网下现金认购2种方式。

7、发售机构

##### （1）直销机构

本基金网下现金发售直销机构：国泰基金管理有限公司直销柜台。

##### （2）代销机构

本基金网下现金发售代理机构：中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、长江证券股份有限公司。

本基金网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理。

8、验资机构：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

#### （二）基金合同生效

本基金自2025年2月24日起向社会公开募集，截至2025年2月27日募集工作已顺利结束。经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为1,503,629,000.00元人民币（未开通网下股票认购），折合基金份额1,503,629,000.00份；通过网下直销现金认购的有效认购资金在募集期间产生的银行利息共计0.00元人民币，折合基金份额0.00份；通过网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后产生的利息共计89,742.75元人民币，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。上

述资金总额已于 2025 年 3 月 4 日全额划入基金托管人在中国工商银行股份有限公司开立的本基金托管账户。

按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，募集期间募集及利息结转的基金份额共计 1,503,629,000.00 份，已全部计入基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

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《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 2025 年 3 月 4 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【2025】58 号。

2、上市交易日期：2025 年 3 月 12 日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金场内简称：科综国泰（扩位简称：科创综指 ETF 国泰）。

5、基金代码：589630。投资人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、投资人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：渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、联储证券股份有限公司、民生证券股份

有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、万联证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司。

7、本次上市交易份额：1,503,629,000.00 份。

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 2025 年 3 月 5 日，本基金基金份额持有人户数为 10,194 户，平均每户持有的基金份额为 147,501.37 份。

### （二）持有人结构

截至 2025 年 3 月 5 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 60,729,000 份，占基金总份额的 4.04%；个人投资者持有的基金份额为 1,442,900,000.00 份，占基金总份额的 95.96%。

### （三）前十名基金份额持有人的情况

截至 2025 年 3 月 5 日，前十名基金份额持有人的情况如下表：

序号	基金份额持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占基金总份额的比例
1	潘雪儿	10,000,000.00	0.67%
2	严建亚	10,000,000.00	0.67%
3	熊颖	10,000,000.00	0.67%
4	西安景弘基金管理有限公司—景弘价值长赢二号私募证券投资基金	6,100,000.00	0.41%
5	顾美云	6,060,000.00	0.40%
6	财通证券资管—中航信托 中金财富【859】号家族信托—财通证券资管智选 FOF16 号	5,999,000.00	0.40%
7	西安景弘基金管理有限公司—景弘价值长赢私募证券投资基金	5,100,000.00	0.34%
8	陈颖	5,000,000.00	0.33%
9	张旭辉	5,000,000.00	0.33%
10	王锦华	5,000,000.00	0.33%
11	李军	5,000,000.00	0.33%

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：国泰基金管理有限公司
- 2、法定代表人：周向勇
- 3、总经理：李昇
- 4、注册资本：11,000 万元人民币
- 5、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 1200 号 2 层 225 室
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基字【1998】5 号
- 7、工商登记注册的营业执照统一社会信用代码：91310000631834917Y
- 8、经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务。
- 9、股权结构

股东名称	持股比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
国网英大国际控股集团有限公司	10%

### 10、内部组织结构及职能

公司建立并完善了科学的治理结构。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；

在组织结构方面，公司设立的执行委员会、投资决策委员会、风险管理委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；

公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；

公司稽核监察部门拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

### 11、人员情况

截至 2024 年 12 月 31 日，公司正式员工 433 人，其中 81.06%（351 人）的员工具有硕士及以上学历。

12、信息披露负责人：刘国华

咨询电话：400-888-8688

13、基金管理业务情况

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 270 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

14、本基金基金经理

麻译文，硕士研究生，5 年证券基金从业经历。2020 年 6 月加入国泰基金，历任助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理。2023 年 8 月起兼任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 9 月起兼任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 10 月起兼任国泰中证全指集成电路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 4 月起兼任国泰中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 7 月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 9 月起兼任国泰沪深 300 增强策略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 12 月起兼任国泰创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 2 月起兼任国泰富时中国 A 股自由现金流聚焦交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 3 月起兼任国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人

## 1、基本情况

公司法定中文名称：中国国际金融股份有限公司（简称：中金公司）

公司法定英文名称：China International Capital Corporation Limited（CICC）

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：陈亮

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

邮政编码：100004

成立日期：1995年07月31日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币482,725.686800万元

存续期间：持续经营

联系人：夏天啸

电话：(86-10) 6505-1166

基金托管资格批文及文号：证监许可[2015]1441号

中国国际金融股份有限公司（中金公司，601995.SH，3908.HK）成立于1995年，凭借率先采用市场最佳实践以及深厚的专业知识，完成了众多开创先河的交易，并深度参与中国经济改革和发展，与客户共同成长。中金公司的目标是打造成为具有国际竞争力的一流投资银行。

中金公司一直致力于为多元化的客户群体提供高质量金融增值服务，建立了以研究和信息技术为基础，投资银行、股票业务、固定收益、资产管理、私募股权和财富管理全方位发展的均衡业务结构。

凭借深厚的经济、行业、法律、法规等领域的专业知识，中金公司优质的服务获得了广泛认可。与此同时，可持续发展始终是中金公司的核心理念之一，中金公司期望为社会创造长期价值，以行业高标准积极践行企业社会责任。

2015年，中金公司在香港联交所主板成功挂牌上市。2017年，中金公司与原中国中投证券的战略重组完成，本次交易使中金公司规模显著扩大，实现了对大、中小企业及机构、个人客户更为深度的覆盖，构建了更为均衡的一二级市场业务结构。2020年，中金公司在上海证券交易所主板成功挂牌上市。

集团总部位于北京，在境内拥有多家子公司，并在上海、深圳、厦门、成都、

杭州、济南、重庆、沈阳、南京、苏州设有分公司。此外，集团及下属子公司在中国大陆 30 个省、自治区、直辖市拥有 200 多个证券营业部。集团亦积极开拓境外市场，在中国香港、纽约、伦敦、新加坡、旧金山、法兰克福、东京七个国际金融中心设有子公司或分支机构。

秉承“植根中国，融通世界”的理念，通过广泛的业务网络及杰出的跨境能力，中金公司将持续为客户提供一流的金融服务，协助客户实现其战略发展目标。

中金公司已取得多项业务牌照并开展业务，中金公司拥有证券市场业务全牌照。业务领域跨越境内境外市场，覆盖证券、证券投资基金、直接股权投资等多个领域，包括但不限于经纪业务、自营业务、基金的发起和管理、金融产品代销、托管业务、承销业务、投融资顾问、融资融券业务、场外衍生品等。

最近 3 个会计年度的年末净资本均不低于 20 亿元人民币。最近三个年度内中金公司净资本等各项风险控制指标均符合监管标准。

中金公司资产托管部（下文简称“托管部”）于 2014 年 5 月正式成立，负责为公募、私募基金、资管计划等客户提供资产托管及基金运营等服务。

中金公司资产托管部为独立部门，托管业务与中金公司其他有利益冲突的业务相互隔离，人员及岗位设置实现管理条线独立，有独立的办公场所和独立的网络系统、机房、应用系统、多项备份措施，从而保证利益隔离和信息隔离，保证了托管业务的独立。

资产托管部人员具备金融、会计等相关专业学历背景。清算、估值、注册登记、投资监督等主要业务岗位人员来自托管银行、基金管理公司、信托公司，具备丰富的资管产品、基金运作管理经验。

## 2、主要人员情况

陈亮先生，党委书记、董事长、管理委员会主席。

陈亮先生，1968 年 1 月出生，自 2023 年 11 月起获委任为中金公司董事长，自 2023 年 10 月起任中金公司党委书记、管理委员会主席。陈先生自 1994 年 10 月至 2001 年 2 月历任新疆宏源信托投资股份有限公司计算机部主任、证券部副总经理兼文艺路证券营业部经理、证券业务总部副总经理，自 2001 年 2 月至 2009 年 9 月历任宏源证券股份有限公司乌鲁木齐业务总部总经理、总经理助理、新疆营销经纪中心总经理、经纪业务总部总经理，自 2009 年 9 月至 2015 年 1 月担任

宏源证券股份有限公司副总经理、宏源期货有限公司董事长，自 2014 年 12 月至 2019 年 5 月担任申万宏源集团股份有限公司（一间于深圳证券交易所（股份代号：000166）和香港联交所（股份代号：06806）两地上市的公司）和申万宏源证券有限公司党委委员、申万宏源集团股份有限公司总经理、申万宏源西部证券有限公司执行董事，自 2015 年 8 月至 2019 年 5 月担任申万宏源西部证券有限公司党委书记，及自 2019 年 6 月至 2023 年 10 月历任中国银河证券股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：601881）和香港联交所（股份代号：06881）两地上市的公司）总裁、副董事长、董事长。陈先生于 1989 年 7 月毕业于新疆大学数学专业（本科），于 2016 年 1 月自复旦大学取得高级管理人员工商管理硕士学位。

严格先生，董事总经理，资产托管部负责人。

严格于 2021 年加入中金公司资产托管部担任部门负责人。2016 年至 2020 年，任职于中金资本运营有限公司从事私募基金管理工作，主要负责基金募集，投后管理及投资者关系等相关工作。2004 年至 2016 年任职于中金公司财务部，协助部门管理相关工作，拥有丰富的财税，项目管理和风险管控经验。2004 年毕业于北京大学主修会计学，辅修电子商务，具备证券从业资格、基金从业资格。

### 3、基金托管业务经营情况

中金公司于 2015 年 6 月 30 日获得证监会允许开展证券投资基金托管业务的批复（证监许可【2015】1441 号），截止 2024 年 12 月 31 日，托管各类在运作产品 877 支，其中 9 支公募基金产品。

中金公司自取得托管资格以来，严格按照《基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规，履行法律法规和基金合同赋予托管人的各项权利和义务。

### 4、基金托管人的内部控制制度

#### （1）内部控制目标

为保证托管业务的规范运营，促进托管业务高效管理、持续稳定和健康发展，内部控制和风险管理必须达到以下目标：

①确保托管业务运作遵守国家有关法律法规、行业监管要求，自觉形成守法经营、规范运作的经营理念和经营风格。

②确保托管资产的安全完整，维护基金持有人的合法权益，切实履行托管人职责。

③确保内部控制和风险管理体系的有效性。

④防范和化解运营风险，确保业务的安全、稳健运行。

## （2）内部控制原则

中金公司按照健全性、有效性、独立性、相互制约等原则，对证券投资基金托管业务的运作进行监督和控制。

①健全性原则。内部控制和风险管理应涉及到托管业务的各个方面、各个环节，确保托管资产的安全和完整。

②有效性原则。建立对内控制度和风险管理措施的监督、评价、反馈和完善机制，保证制度有效执行。

③独立性原则。中金公司配备专门的内控人员，并与其他业务内控相独立。

④相互制约原则。资产托管部的岗位设置应当职责明确、相互制约。

⑤审慎性原则。托管业务风险管理应满足合规要求，以审慎经营、防范和化解风险为目标，独立、客观、审慎地进行客户资质审查，原则上“看不清、不展业”。

## （3）内部控制制度及措施

根据《基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规，托管部制定了一整套证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，制定《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务人员管理办法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务应急预案》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务隔离制度》、《中国国际金融股份有限公司内部审计部托管业务审计工作指引》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务信息系统权限管理方法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务信息技术规范》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务托管资产保管管理办法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务会计估值核算管理办法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务会计核算指引》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管资产终止运营操作规程》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务资金清算业务管理办

法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务投资监督管理办法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务档案管理办法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务信息披露管理办法》、《中国国际金融股份有限公司证券投资基金托管业务内部控制和风险管理办法》、《中国国际金融股份有限公司托管业务风险准备金（公募基金）管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统完整独立，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理。

资产托管业务的内部控制包含以下措施：

- ①客户选择风险内部控制措施；
- ②基金资金清算与交收风险内部控制措施；
- ③基金估值核算风险内部控制措施；
- ④基金监督风险内部控制措施；
- ⑤操作风险内部控制措施；
- ⑥法律合规风险内部控制措施。

#### 5、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

中金公司作为基金托管人，根据《基金法》、《运作办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

中金公司作为基金托管人，发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和基金合同的行为，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。中金公司有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反中金公司通知的违规事项未能及时纠正的，中金公司有权报告监管机构。

#### 6、其他事项

最近一年内中金公司及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违



规行为，未因基金托管业务受到中国人民银行、中国证监会、国家金融监督管理总局及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

（三）基金上市推荐人

名称：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

客服电话：95521 或 400-8888-666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

（四）验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东长安街 1 号东方广场东二办公楼八层

办公地址：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼

执行事务合伙人：邹俊

联系电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、叶凯韵

## 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

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

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金截至 2025 年 3 月 5 日的资产负债表（未经审计）如下：

国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

#### 2025年3月5日资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产	本期末 2025 年 3 月 5 日
资产：	
银行存款	3,768,990.67
结算备付金	1,008,061,155.98
存出保证金	-
交易性金融资产	492,276,440.40
其中：股票投资	492,276,440.40
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	1,504,106,587.05
负债与持有人权益	
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-

应付赎回款	-
应付管理人报酬	6,179.87
应付托管费	2,059.96
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	976.90
负债合计	9,216.73
所有者权益：	
实收基金	1,503,629,000.00
未分配利润	468,370.32
所有者权益合计	1,504,097,370.32
负债和所有者权益总计	1,504,106,587.05

注：报告截止日 2025 年 3 月 5 日，本基金份额净值：1.0003 元，本基金份额总额：1,503,629,000.00 份。

## 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 2025 年 3 月 5 日，本基金的投资组合情况如下：

### （一）报告期末基金资产组合情况

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	492,276,440.40	32.73
	其中：股票	492,276,440.40	32.73
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,011,830,146.65	67.27
6	其他各项资产	-	-
7	合计	1,504,106,587.05	100.00

### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有积极投资的股票。

#### 2、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	377,271,057.40	25.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	95,678,613.00	6.36
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	17,831,606.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	1,495,164.00	0.10
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	492,276,440.40	32.73

(三) 期末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、期末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	688041	海光信息	167,900	25,848,205.00	1.72
2	688256	寒武纪	31,200	22,195,680.00	1.48
3	688981	中芯国际	134,500	13,123,165.00	0.87
4	688111	金山办公	31,500	11,198,880.00	0.74
5	688271	联影医疗	69,600	9,346,584.00	0.62
6	688012	中微公司	42,500	8,615,175.00	0.57
7	688036	传音控股	68,600	6,525,232.00	0.43
8	688223	晶科能源	973,800	6,446,556.00	0.43
9	688506	百利天恒	28,712	6,257,780.40	0.42
10	688396	华润微	117,200	5,709,984.00	0.38

2、期末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：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资  
明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持  
证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 报告期末本基金投资股指期货交易情况说明

注：截至本报告期末，本基金未进行股指期货交易。

(八) 投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查  
或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、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  
外的情况。

3、其他各项资产构成

注：本基金本报告期末无其他资产。

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 九、重大事项揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。



## 十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

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

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

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

严格遵守《基金法》等相关法规以及《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的约定履行相应职责。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）本基金上市符合《中华人民共和国证券投资基金法》《上海证券交易所交易规则》《上海证券交易所证券投资基金上市规则》《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》规定的相关条件；

（二）基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求。

### 十三、备查文件目录

(一)中国证监会准予国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件;

(二)《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(三)《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(四)《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件和营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点:基金管理人和基金托管人处。

查阅方式:投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

风险提示:基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于上述基金前应认真阅读基金的《基金合同》、《招募说明书》,了解基金产品的详细情况,选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金,并注意投资风险。

国泰基金管理有限公司

二〇二五年三月七日

## 附件：基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 自行担任登记机构和/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、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(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) 在符合有关法律法规和相关证券交易所及登记机构相关业务规则的规定以及本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户等业务的规则；

(17) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(18) 在不违反法律法规和监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人以基金资产作为质押进行融资或其他相关业务；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构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、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，但因监管机构、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不低于法律法规规定的最低期限；

(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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;投资者以股票认购的,相关股票的解冻按照《业务规则》的规定处理;

(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。

3、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1) 自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4) 根据相关市场规则,为基金开设证券账户、资金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。

4、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》、《托管协议》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，但因监管机构、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》、《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》、《托管协议》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低于法律法规规定的最低期限；

(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》、《托管协议》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。

5、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。

6、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) 缴纳基金认购款项或股票、申购/赎回对价及法律法规和《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

(一) 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。

(二) 在本基金成功募集并运作之后，如基金管理人管理本基金的联接基金的：

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份额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。

(三) 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（法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定的除外）：

- (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；
- (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、在不违背法律法规和《基金合同》的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

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

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公

司的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 增加或减少份额类别，或调整基金份额分类办法及规则；

(5) 调整基金收益的分配原则和支付方式；

(6) 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；

(7) 在不违反法律法规的前提下，基金管理人、相关证券交易所、登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户、质押等业务的规则；

(8) 基金推出新业务或服务；

(9) 调整基金的申购赎回方式；调整申购对价、赎回对价组成，调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(10) 基金在其他证券交易所上市、开通场外申购赎回或其他申购赎回模式；

(11) 募集并管理以本基金为目标ETF的联接基金、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；

(12) 监管机关或证券交易所要求或决定本基金终止上市；

(13) 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。

(四) 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。

（五）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。

#### （六）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或通讯开会方式或法律法规或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或系统。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非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，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。表决方式上，基金份额持有人也可以采用网络、电话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载明。

## (七) 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（九）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。

### （八）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时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基金份额持有人身份文件的表决视为有效出席的基金份额持有人，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。

#### （九）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。

#### （十）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。

（十一）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人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、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可每月对本基金进行评估并可根据实际情况进行收益分配，分配时间、分配方案及收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

2、本基金的收益分配方式为现金分红；

3、基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

4、本基金每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后，可调整基金收益的分配原则和

支付方式。

## （二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## （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，在2日内在规定媒介公告。

## （四）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；
- 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、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/期权交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、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0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，基金托管人按照基金管理人出具的自动划付授权书中约定的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性划付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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，基金托管人按照基金管理人出具的自动划付授权书中约定的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性划付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类”中第3—10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、标的指数许可使用费。本基金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。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### （二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资股指期货等其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

### （三）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%；

（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) 本基金若参与股指期货交易，应遵守以下投资限制：

1) 本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%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

3) 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；

4) 本基金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%；

(9) 本基金若参与国债期货交易，应遵守以下投资限制：

1) 本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%；

2) 本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%；

3) 本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%；

4) 本基金所持有的债券（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；

(10) 本基金若参与股票期权交易，应遵守以下投资限制：

1) 本基金因未平仓的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%；

2) 开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，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期权保证金的现金等价物；

3) 未平仓的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；

(11) 本基金若参与股指期货、国债期货交易，在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约和股指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；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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；

(12) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

(13) 本基金若参与融资业务，每个交易日日终，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%；

(14) 本基金若参与转融通证券出借业务，应遵守以下投资限制：

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%，其中，出借期限在10个交易日以上的出借证券，纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过本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) 参与转融通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；

5) 因证券市场波动、上市公司合并、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上述比例限制的，基金管理人不得新增出借业务；



(15) 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；

(16) 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；

(17) 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；

(18) 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。

除上述第（6）、（14）、（15）、（16）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，基金管理人应当在相关证券可交易的10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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，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调整上述限制，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按调整后的规定执行。

## 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。

法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，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按调整后的规定执行。

### 3、关联交易

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从事关联交易的条件和要求，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按变更后的规定执行。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

### （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）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 七、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，经履行适当程序后，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

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2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、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个工作日内成立基金财产清算小组，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。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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财产；

- (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财产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不低于法律法规规定的最低期限。

### 八、争议的处理

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，应经友好协商解决，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地

点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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。

《基金合同》受中华人民共和国法律（为本基金合同之目的，不含港澳台地区法律）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》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。