

建信上证科创板 200 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：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2025 年 9 月 15 日

公告日期：2025 年 9 月 10 日

目录

一、重要声明与提示	3
二、基金概览	4
三、基金的募集与上市交易	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	7
五、基金主要当事人简介	8
六、基金合同摘要	16
七、基金财务状况	17
八、基金投资组合	17
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、基金上市推荐人意见	25
十三、备查文件目录	26
附件：基金合同摘要	27

一、重要声明与提示

建信上证科创板 200 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，建信基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）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，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。本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保证本报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。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，投资者欲了解建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金的详细情况，请详细阅读发布在本公司网站（[http:// www.ccbfund.cn](http://www.ccbfund.cn)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的本基金招募说明书、产品资料概要。

二、基金概览

1、基金名称：建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金

2、基金类型：股票型证券投资基金

3、运作方式：交易型开放式

4、基金存续期限：不定期

5、基金简称：建信上证科创板 200ETF

6、基金二级市场交易简称及交易代码

证券简称：科 200F；扩位简称：科创 200ETF 建信；交易代码：589820

7、截至公告日前两个工作日的基金份额总额：截至 2025 年 9 月 8 日，本基金的基金份额总额为 246,720,166.00 份。

8、截至公告日前两个工作日的基金份额净值：截至 2025 年 9 月 8 日，本基金的基金份额净值为 1.0005 元。

9、本次上市交易的基金份额总额：截至 2025 年 9 月 8 日，本次上市交易的基金份额总额为 246,720,166.00 份。

10、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

11、上市交易日期：2025 年 9 月 15 日

12、基金管理人：建信基金管理有限责任公司

13、基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

14、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

15、上市推荐人：东方证券股份有限公司

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：中国证监会证监许可[2025]376 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：2025 年 8 月 11 日起至 2025 年 8 月 22 日通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售的日期为 2025 年 8 月 11 日起至 2025 年 8 月 22 日，网上现金发售的日期为 2025 年 8 月 11 日起至 2025 年 8 月 22 日。
- 5、发售价格：1.00 元人民币。
- 6、发售期限：网下现金、网上现金认购发售 10 个工作日。
- 7、发售方式：投资者可选择网下现金、网上现金认购两种方式。
- 8、发售机构

（1）网下现金发售直销机构

投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。

（2）网下现金发售的其他代理机构

华泰证券股份有限公司。

（3）网上现金发售代理机构

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

（二）基金合同生效

本基金自 2025 年 8 月 11 日起向社会公开募集，截至 2025 年 8 月 22 日募集工作已顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，此次募集期间现金认购的有效认购资金扣除认购费用后的净认购金额为人民币 246,719,000.00 元；现金认购的有效认购资金在首次募集期间产生的利息为人民币 15,083.12 元，其中人民币 1,166.00 元折成 1,166.00 份基金份额，剩余人民币 13,917.12 元归入基金财产，不折算为基金份额。上述净认购金额及通过网下现金认购的有效认购款项在募集期内产生的利息合计人民币 1,166.66 元已于 2025 年 8 月 27 日全部划至本基金托管账户。另外，本基金通过网上现金认购的有效认购款

在募集期间内产生的利息为人民币 13,916.46 元,该款项将于下一季度银行结息日次一工作日(2025 年 9 月 22 日)划入本基金托管账户。

本基金于 2025 年 8 月 27 日得到中国证监会书面确认,基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件,基金合同于 2025 年 8 月 27 日正式生效。

(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]209 号

2、上市交易日期:2025 年 9 月 15 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

证券简称:科 200F;扩位简称:科创 200ETF 建信;

5、基金二级市场交易代码:589820

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

6、本基金管理人自 2025 年 9 月 15 日开始办理本基金的申购和赎回业务。投资者应当在本基金指定的申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的申购赎回代理券商包括:中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司和东方证券股份有限公司。本公司可适时增加或调整申购赎回代理券商,并在基金管理人网站公示。

7、本次上市交易的基金份额总额:246,720,166.00(截至 2025 年 9 月 8 日)。

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。

9、基金资产净值的披露:在本基金上市交易并开始办理基金份额申购赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值,并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即 2025 年 9 月 8 日，本基金份额持有人户数为 2,224 户，平均每户持有的基金份额为 110935.33 份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2025 年 9 月 8 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 80,143,166.00 份，占基金总份额的 32.48%；个人投资者持有的基金份额为 166,577,000.00 份，占基金总份额的 67.52%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至公告日前两个工作日即 2025 年 9 月 8 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）	占场内总份额比例（%）
1	银河期货有限公司	14,998,000.00	6.08%
2	上海从容投资管理有限公司－从容稳健保值证券投资基金	10,000,000.00	4.05%
3	张志林	10,000,000.00	4.05%
4	东吴证券股份有限公司	8,000,000.00	3.24%
5	国联证券股份有限公司	7,000,000.00	2.84%
6	招商证券股份有限公司	7,000,000.00	2.84%
7	长江证券股份有限公司	6,900,000.00	2.80%
8	广发证券股份有限公司	6,000,166.00	2.43%
9	铸锋资产管理（北京）有限公司－铸锋嘉兴一号私募证券投资基金	6,000,000.00	2.43%
10	苏韵鉴	5,000,000.00	2.03%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人概况

1、基本情况

名称：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

办公地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

设立日期：2005 年 9 月 19 日

法定代表人：生柳荣

联系人：郭雅莉

电话：010-66228888

注册资本：人民币 2 亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准设立。公司的股权结构如下：中国建设银行股份有限公司，65%；信安金融服务公司，25%；中国华电集团产融控股有限公司，10%。

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为本公司的权力机构，由全体股东组成。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由 9 名董事组成，其中 3 名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权、对公司基本制度的制定权和对总裁等高级管理人员的评价和奖惩权。

董事会下设审计委员会，审计委员会按照《公司法》及其他法律法规、监管规定及公司章程的规定行使监督职权，包括检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员执行职务等。

2、主要成员情况

（1）董事会成员

生柳荣先生，董事，现任建信基金管理有限责任公司董事长。厦门大学经济学博士。历任中国建设银行厦门市分行和总行金融市场部、资产负债管理部等部门主要负责人，现任中国建设银行首席财务官。2023 年 9 月兼任建信基金管理有限责任公司党委书记，9 月 26 日兼任建信基金管理有限责任公司董事长。

谢海玉女士，执行董事，现任建信基金管理有限责任公司总裁。毕业于对外经济贸易大学金融学专业，获博士学位。历任中国建设银行总行资金部科员、香港资金交易室一级业务员、资金交易部业务经理、高级副经理、金融市场部处长等职务；2017 年 7 月起历任建信金融资产投资有限公司首席投资官、副总裁等职务，2018 年 8 月起兼任建信金投私募基金管理（北京）有限公司[原建信金投私募基金管理（天津）有限公司]执行董事（至 2024 年 11 月）、总经理（至 2024 年 1 月）；2024 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司党委副书记；2024 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司党委副书记、总裁、执行董事。

钟蓉萨女士，董事，现任美国信安金融集团副总裁、中国区负责人。毕业于中国人民大学统计学专业，获经济学学士学位。历任中国证监会信息统计部信息中心主任科员、副处长、处长和机构监管部处长，中国证券业协会党委委员、副秘书长，中国证券投资基金业协会党委委员、副秘书长、副会长。

陈惠燕女士，董事，现任信安亚洲区财务总监。1993 年毕业于新加坡南洋理工大学，获学士学位。2001 年毕业于悉尼理工大学，获硕士学位。2002 年至 2021 年，在英国保诚集团旗下翰亚投资公司工作，历任亚洲总部财务部经理、财务部高级经理、财务部副总监和财务总监。

王晓波先生，董事，现任中国华电集团产融控股有限公司党委委员，副总经理、总会计师。毕业于哈尔滨建筑大学，研究生学历。历任黑龙江省物资对外贸易公司会计，华电能源股份有限公司监察审计部审计员、副经理、主任，华鑫国际信托有限公司计划财务部负责人、总经理，华鑫国际信托有限公司信托财务管理部总经理，华鑫国际信托有限公司运营总监兼信托财务管理部总经理，华鑫国际信托有限公司副总经理，中国华电集团资本控股有限公司审计部主任。

吴岚女士，独立董事，现任北京大学数学科学学院金融数学系主任、教授。1999 年获北京大学理学博士学位。1990 年硕士研究生毕业后在北京大学（原）概率统计系、数学科学学院金融数学系担任教学科研工作。2003 年至今担任北京大学数学科学学院金融数学系主任。

姚磊先生，独立董事，现任华领私募股权基金管理（北京）有限公司总经理。毕业于对外经济贸易大学，获硕士学位。历任中国国际金融有限公司投资银行部经理、高级经理、副总经理、执行总经理，公司管理部董事总经理，首席财务官；厦门博润资本投资管理有限公司总经理。

王遥女士，独立董事，现任中央财经大学教授，博士生导师。中央财经大学绿色金融国

际研究院院长，中央财经大学 - 北京银行双碳与金融研究中心主任，财经研究院、北京财经研究基地研究员。中国金融学会绿色金融专业委员会副秘书长，中国证券业协会绿色发展委员会顾问。剑桥大学可持续领导力研究院研究员，牛津大学史密斯企业与环境学院可持续金融项目咨询委员会专家，卢森堡证券交易所咨询顾问。2021 担任联合国开发计划署中国生物多样性金融“BIOFIN”项目首席技术顾问；之前任 SDG 影响力融资研究与推广首席顾问。

莫红女士，职工董事，现任建信基金管理有限责任公司副总裁。毕业于四川大学刑事诉讼法证据法学专业，获博士学位。曾在四川省高级人民法院、四川省纪委、四川省纪委监委任职，从事涉及经济、金融方面的法律工作和对金融企业的纪检监察工作。2021 年 8 月任中国建设银行资产保全部负责人。2023 年 6 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2024 年 2 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、首席运营官，2024 年 10 月任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁、首席运营官。

（2）公司高管人员

谢海玉女士，总裁（简历请参见董事会成员）。

莫红女士，副总裁（简历请参见董事会成员）。

张铮先生，副总裁，硕士。1997 年 4 月加入中国建设银行总行，先后在资金计划部、计划财务部、资金部、资金交易部、金融市场部、香港资金运营中心、财富管理与私人银行部、私人银行部等部门工作，曾长期从事金融市场研究、资金交易、本币投资等业务。2024 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2025 年 1 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁。

刘大超先生，副总裁，硕士。曾在合肥三字集团工作。2003 年 7 月加入中国建设银行总行，先后在基金托管部、投资托管服务部、资产托管业务部工作，长期从事基金托管业务。2025 年 7 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员，2025 年 8 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁。

吴曙明先生，副总裁、督察长，硕士。1992 年 7 月至 1996 年 8 月在湖南省物资贸易总公司工作；1999 年 7 月加入中国建设银行，先后在总行营业部、金融机构部、机构业务部从事信贷业务和证券业务，历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职；2006 年 3 月加入建信基金管理有限责任公司，担任董事会秘书，并兼任综合管理部总经理。2015 年 8 月起任建信基金管理有限责任公司督察长、董事会秘书，2016 年 12 月起任建信基金管理有限责任公司副总裁（首席风险官）、督察长，2017 年 11 月起任建信基金管理有限责任公司党委委员、副总裁（首席风险官）、督察长，2024 年 6 月起任建信基金管理有限

责任公司党委委员、副总裁、督察长，2025 年 4 月起任建信基金管理有限责任公司副总裁、督察长。

(3) 督察长

吴曙明先生，督察长（简历请参见公司高级管理人员）

(4) 本基金基金经理

龚佳佳先生，硕士。曾任诺安基金管理有限公司数量投资部研究员、基金经理助理；工银瑞信基金管理有限公司指数投资部量化研究员；华夏基金管理有限公司数量投资部研究员、投资经理。2018 年 5 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部基金经理助理、基金经理等职务。2019 年 2 月 22 日至 2023 年 2 月 1 日任建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 7 日至 2022 年 5 月 5 日任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 7 日至 2022 年 5 月 5 日任建信创业板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；2019 年 8 月 23 日至 2023 年 12 月 11 日任建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 3 月 6 日至 2023 年 1 月 5 日任建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 4 月 17 日至 2021 年 4 月 6 日任建信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 6 月 29 日起任建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 2 月 18 日至 2022 年 9 月 29 日任建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 3 月 11 日起任建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；2021 年 5 月 27 日起任建信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的基金经理；2021 年 6 月 3 日至 2022 年 5 月 11 日任建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 7 月 15 日至 2024 年 1 月 24 日任建信中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 7 月 29 日起至 2021 年 12 月 27 日任建信中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 19 日起任建信中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 8 日至 2023 年 12 月 11 日任建信沪深 300 红利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；2021 年 9 月 9 日至 2024 年 9 月 9 日任建信中证全指证券公司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；2021 年 11 月 25 日至 2023 年 10 月 17 日任建信中证饮料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022 年 1 月 7 日起任建信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022 年 7 月 21 日起任建信中证农牧主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

(5) 投资决策委员会成员

谢海玉女士，总裁。

张 铮先生，副总裁。

吴曙明先生，副总裁。

陈正宪先生，总裁特别助理。

乔 梁先生，投研总监。

陶 灿先生，权益投资部总经理。

陈建良先生，固定收益投资部总经理。

田元泉先生，研究部总经理。

江 源女士，多元资产投资部副总经理。

叶乐天先生，数量投资部副总经理。

娄晓辰女士，国际投资与业务发展部总经理。

卜 蕊女士，基础设施投资部总经理。

解一辉女士，投资风险管理部总经理。

(6) 上述人员之间均不存在近亲属关系。

(二) 基金托管人情况

1、基金托管人概况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋

法定代表人：张为忠

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：朱萍

联系电话：（021）31888888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）六个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

2、主要人员情况

张为忠，男，1967 年出生，硕士研究生。曾任中国建设银行大连市分行开发区分行行长，中国建设银行内蒙古总审计室总审计师兼主任，中国建设银行湖北省分行纪委书记、副行长、党委委员，中国建设银行普惠金融事业部（小企业业务部）总经理，中国建设银行公司业务总监。现任中共上海浦东发展银行股份有限公司委员会书记、董事长。

李国光，男，1967 年出生，硕士研究生。历任上海浦东发展银行天津分行资财部总经理，天津分行行长助理、副行长，总行资金总部副总经理，总行资产负债管理委员会主任，总行清算作业部总经理，沈阳分行党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止 2025 年 6 月 30 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 14967.99 亿元，托管证券投资基金共 499 只。

4、基金托管人的内部控制制度

(1) 本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

(2) 本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

(3) 内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

5、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

(1) 监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- 1) 《中华人民共和国证券法》；
- 2) 《中华人民共和国证券投资基金法》；
- 3) 《公开募集证券投资基金运作管理办法》；；
- 4) 《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》

5) 《基金合同》、《基金托管协议》;

6) 法律、法规、政策的其他规定。

(2) 监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定,对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督,及时提示基金管理人违规风险。

(3) 监督方法

1) 资产托管部设置核算监督岗位,配备相应的业务人员,在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责,规范基金运作,维护基金投资人的合法权益,不受任何外界力量的干预;

2) 在日常运作中,凡可量化的监督指标,由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督,实现系统的自动跟踪和预警;

3) 对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等,采取人工监督的方法。

(4) 监督结果的处理方式

1) 基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果,采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等;

2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作,以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人,指明违规事项,明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查,如果基金管理人未予纠正,基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时,基金托管人应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正;

3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查,应及时提供有关情况和资料。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等有关法律法规的规定及《基金合同》约定,制定投资监督标准与监督流程,对基金合同生效之后所委托资产的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督,及时提示管理人违规风险,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对于基金资产的核算、基金资产净值的计算、对各基金费用的提

取与开支情况、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。

2、监督程序

基金托管人发现基金管理人有关违反《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。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有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（三）上市推荐人

东方证券股份有限公司

（四）一级交易商

目前，本基金一级交易商名单如下：中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司和东方证券股份有限公司。

（五）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

联系人：马剑英

经办注册会计师：高鹤、马剑英

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

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

（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

截至公告前两个工作日即 2025 年 9 月 8 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：
单位：人民币元

资产	本报告期末
	2025 年 9 月 8 日
资产：	
银行存款	125,198,212.13
结算备付金	234,024.32
存出保证金	
交易性金融资产	147,956,777.74
其中：股票投资	147,956,777.74
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	273,389,014.19
负债和所有者权益	
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	26,497,354.23
应付赎回款	
应付管理人报酬	8,072.61
应付托管费	2,690.85
应付销售服务费	
应交税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	36,947.16
负债合计	26,545,064.85
所有者权益：	
实收基金	246,720,166.00
未分配利润	123,783.34
所有者权益合计	246,843,949.34
负债和所有者权益总计	273,389,014.19

注：截至 2025 年 9 月 8 日，基金份额净值 1.0005 元，基金份额总额 246,720,166.00 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。

截至公告前两个工作日即 2025 年 9 月 8 日，本基金的投资组合情况如下：

（一）期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	147,956,777.74	54.12
	其中：股票	147,956,777.74	54.12
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	125,432,236.45	45.88
6	其他资产		
7	合计	273,389,014.19	100.00

（二）期末按行业分类的股票投资组合

1、期末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		-
C	制造业	120,563,382.34	48.84
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	18,812,137.21	7.62
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	8,581,258.19	3.48
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	147,956,777.74	59.94

2、期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

3、期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

(三) 期末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、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	688313	仕佳光子	49,065.00	3,601,371.00	1.46
2	688382	益方生物	61,828.00	2,374,195.20	0.96
3	688068	热景生物	9,914.00	1,744,864.00	0.71
4	688660	电气风电	81,470.00	1,718,202.30	0.70
5	688270	臻镭科技	22,888.00	1,694,856.40	0.69
6	688108	赛诺医疗	50,538.00	1,642,485.00	0.67
7	688630	芯碁微装	12,072.00	1,620,062.40	0.66
8	688321	微芯生物	43,626.00	1,596,711.60	0.65
9	688503	聚和材料	25,877.00	1,582,637.32	0.64
10	688388	嘉元科技	52,076.00	1,503,434.12	0.61

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

无。

(四) 按券种分类的债券投资组合

无。

(五) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

无。

(六) 按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

(七) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

(八) 按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

(十一) 投资组合报告附注

1、本报告编制日前一年内，本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金前十名股票中，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	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	其他资产	-
5	合计	-

4、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5、本报告期前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前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《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：

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

(二)根据《基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，将及时向中国证监会报告。

十二、基金上市推荐人意见

东方证券股份有限公司作为上市推荐人,就建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金上市交易事宜出具意见如下:

(一) 建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金上市符合《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;

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

十三、备查文件目录

(一)中国证监会准予建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件

(二)《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四)《建信上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

(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

(八)中国证监会要求的其他文件

存放地点：备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

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：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。

建信基金管理有限责任公司

2025 年 9 月 10 日

附件：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）基金份额持有人的权利与义务

基金投资人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，基金投资人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）交纳基金认购款项或股票、申购对价、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) 按照反洗钱法律法规要求，向基金管理人和基金销售机构提供身份基本信息及相关证明文件，配合基金管理人和基金销售机构就反洗钱事项进行尽职调查；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 发售基金份额；
- (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；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户等业务规则；

(17) 根据反洗钱法律法规要求，针对基金份额持有人较高洗钱风险情形，采取强化措施（包括对基金份额持有人的相关账户及交易加强监测、管控等措施），管理和降低风险；

(18) 根据《个人信息保护法》和反洗钱相关法律法规要求，收集、存储、使用、加工、传输、提供、公开、删除等方式处理基金份额持有人个人信息及反洗钱信息，并为托管人依法开展的反洗钱工作提供充分的协助；

(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、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，但向监管机构、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人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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，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。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

- (1) 自基金合同生效之日起, 依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;
- (2) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金投资人的利益;

(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, 为基金办理证券交易等资金清算;

(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、托管协议及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户, 按照基金合同及托管协议的约定, 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;

(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及托管协议的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同及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及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）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

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。

若以本基金为目标基金，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席本基金的基金份额持有人大会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。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会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。联接基金折算为本基金后的每一

参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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。

本基金基金份额持有人大会不设日常机构。

(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,法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外:

- (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,但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外;
- (6) 变更基金类别;
- (7) 本基金与其他基金的合并;
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略,但法律法规和中国证监会另有规定的除外;
- (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) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- (13) 终止基金上市,但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外;

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

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率；
- (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、相关证券交易所和登记机构等调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则（包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；
- (6) 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；
- (7) 基金推出新业务或服务；
- (8) 募集并管理以本基金为目标ETF的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、开通场外申购赎回、跨系统转托管等业务；
- (9) 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；
- (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）。参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，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）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有

的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，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，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

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。

（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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定之外，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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《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、基金的收益与分配

（一）基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式为现金分红；

3、若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

4、基金管理人每季度可对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行评估，基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率时，可进行收益分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见招募说明书；

5、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。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；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。上海证券交易所或登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

（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，按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

四、基金的费用与税收

（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，法律法规、中国证监会另有规定的除外；

4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、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、结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；
- 8、基金上市费及年费；
- 9、基金收益分配中发生的费用；
- 10、基金登记费用、IOPV计算与发布费用；
- 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0.15%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，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、公休假等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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，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、公休日等，日期顺延至最近可支付日支付。

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或摊入当期费用，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、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。

本基金的指数许可使用费按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付，由基金管理人承担，不列入基金费用。

（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、基金的投资

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金也可投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包含国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、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、同业存单、银行存款（包括协议存款，定期存款以及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生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的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和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。

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基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，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）标的指数

上证科创板200指数

（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）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产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%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金可以不受前述比例限制；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金可以不受前述比例限制；

（3）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%；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%；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%；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%；

（4）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；

（5）本基金参与国债期货交易依据下列标准建构组合：

①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；

④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%；

（6）本基金参与股指期货交易，依据下列标准建构组合：

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，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

③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%；

④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；

（7）本基金参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：

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本基金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本基金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；

（8）每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权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、应收申购款等；

（9）本基金参与国债期货或股指期货交易的，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；

（10）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；

（11）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（12）本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（14）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；

（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、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规定的, 基金管理人不得新增出借业务;

(16) 本基金参与融资业务后, 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%;

(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) 本基金参与信用衍生品投资, 需遵守下列投资比例限制: 本基金不得持有信用保护卖方属性的信用衍生品, 不得持有合约类信用衍生品, 持有的信用衍生品的名义本金不得超过本基金对应受保护债券面值的100%; 本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的10%; 因证券/期货市场波动、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比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在3个月内进行调整;

(19) 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(4)、(13)、(14)、(15)、(18)项外, 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调整上述限制, 如适用于本基金, 则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

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。

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的原则，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调整上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

六、基金资产净值

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金资产净值、基金份额净值的公告方式

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，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并依据法律法规规定报中国证监会备案。

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，并自决议生效后依照《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、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；

3、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；

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、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、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。

在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

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, 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, 根据该会当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并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定, 仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间, 基金管理人、基金托管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。

本基金合同受中国(为本基金合同之目的, 不含台湾、香港、澳门地区)法律管辖并从其解释。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。

2、基金合同的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、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。

5、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。