

---

# 鹏华中证高股息龙头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：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

注册登记人：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：2020年5月13日

公告日期：2020年5月8日

## 目录

|     |                                  |    |
|-----|----------------------------------|----|
| 一、  | 重要声明与提示.....                     | 3  |
| 二、  | 基金概览.....                        | 3  |
| 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.....          | 6  |
| 五、  | 基金主要当事人简介.....                   | 6  |
| 六、  | 基金合同摘要.....                      | 12 |
| 七、  | 基金财务状况.....                      | 12 |
| 八、  | 基金投资组合.....                      | 13 |
| 九、  | 重大事件揭示.....                      | 21 |
| 十、  | 基金管理人承诺.....                     | 21 |
| 十一、 | 基金托管人承诺.....                     | 22 |
| 十二、 | 基金上市推荐人意见.....                   | 22 |
| 十三、 | 备查文件目录.....                      | 22 |
| 附件： | 鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要 .. | 24 |

## 一、 重要声明与提示

《鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等规定编制,鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人鹏华基金管理有限公司(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。本基金托管人中信证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者阅读2020年4月1日刊登在中国证监会指定披露媒介上的《鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》。

## 二、 基金概览

- 1、基金名称:鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金二级市场交易简称:  
证券简称:股息龙头  
扩位证券简称:股息龙头ETF
- 3、二级市场交易代码: 515690
- 4、基金场内申购、赎回简称:股息龙头
- 5、场内申购、赎回代码: 515691
- 6、截至公告日前两个工作日即2020年5月6日基金份额总额: 223,088,000.00份
- 7、截至公告日前两个工作日即2020年5月6日基金份额净值: 1.0191元
- 8、本次上市交易份额: 223,088,000.00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: 2020年5月13日
- 11、基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
- 12、基金托管人: 中信证券股份有限公司
- 13、上市推荐人: 中信证券股份有限公司
- 14、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”): 方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司。

### 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：中国证券监督管理委员会 2019 年 11 月 26 日证监许可[2019]2524 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：2020 年 2 月 24 日至 2020 年 3 月 13 日。其中网上现金认购的发售日期为 2020 年 3 月 11 日至 2020 年 3 月 13 日，网下现金认购和网下股票认购的发售日期为 2020 年 2 月 24 日至 2020 年 3 月 13 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：网下现金认购和网下股票认购 15 个工作日，网上现金认购 3 个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。

8、发售机构：

##### (1) 发售协调人

申万宏源证券有限公司

##### (2) 网下现金和网下股票发售的直销机构

鹏华基金管理有限公司

##### (3) 网下现金认购的发售代理机构

爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、湘财证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中航证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、光大证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、东莞证券股份有限公司。

##### (4) 网上现金认购的发售代理机构

具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况：本基金根据中国证监会证监许可[2019]2524 号文批准，自 2020 年 2 月 24 日起公开募集，截止 2020 年 3 月 13 日，基金募集工作已顺利结束。经普

华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的募集金额总额为 223,088,000.00 元人民币（含股票部分），折合基金份额 223,088,000.00 份；认购资金在募集期间产生的利息为 65,431.89 元人民币，归入基金财产。截止 2020 年 3 月 19 日止，现金认购资金及利息已划入本基金托管专户，以网下认购股票认购的相关股票已过户至本基金证券账户。

本次募集有效认购总户数为 3,258 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计 223,088,000.00 份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中募集期间基金管理人运用自有资金认购本基金 0 份，占基金总份额 0%。

11、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2020 年 3 月 20 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。

## （二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书【2020】120 号

2、上市交易日期：2020年5月13日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。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。

4、基金二级市场交易简称：股息龙头

5、二级市场交易代码：515690

6、基金申购、赎回简称：股息龙头

7、申购、赎回代码：515691

本基金管理人自2020年5月13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（申购赎回代理券商）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：方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司。

上述排名不分先后，本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并及时公告或公示。

8、本次上市交易份额：223,088,000.00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）场内持有人户数

截至 2020 年 5 月 6 日，本基金场内份额持有人户数为 3258 户，平均每户持有的基金份额为 68,473.91 份。

##### （二）场内持有人结构

截至 2020 年 5 月 6 日，本基金场内份额持有人结构如下：

机构投资者持有的场内基金份额为 21,683,000.00 份，占基金场内总份额的 9.72%；个人投资者持有的场内基金份额为 201,405,000.00 份，占基金场内总份额的 90.28%。

##### （三）前十名场内基金份额持有人情况

截至 2020 年 5 月 6 日，前十名场内基金份额持有人情况如下表。

| 序号 | 基金份额持有人名称   | 持有份额（份）       | 占基金场内总份额的比例（%） |
|----|-------------|---------------|----------------|
| 1  | 西南证券股份有限公司  | 5,000,000.00  | 2.24%          |
| 2  | 方正证券股份有限公司  | 5,000,000.00  | 2.24%          |
| 3  | 郑州尚之康建材有限公司 | 4,993,000.00  | 2.24%          |
| 4  | 张弘          | 2,000,000.00  | 0.90%          |
| 5  | 陈琪          | 2,000,000.00  | 0.90%          |
| 6  | 魏来          | 1,996,000.00  | 0.89%          |
| 7  | 许永建         | 1,770,000.00  | 0.79%          |
| 8  | 贺江南         | 1,500,000.00  | 0.67%          |
| 9  | 饶耀明         | 1,300,000.00  | 0.58%          |
| 10 | 金颖          | 1,300,000.00  | 0.58%          |
|    | 合计          | 26,859,000.00 | 12.04%         |

##### （四）截止到 2020 年 5 月 6 日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 0 份，占该基金总份额的比例为 0%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量为 0 份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为 0 份。

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分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

- 1、名称：鹏华基金管理有限公司
- 2、法定代表人：何如
- 3、总经理：邓召明
- 4、注册资本：1.5 亿元人民币
- 5、注册地址：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层

6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]31号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：91440300708470788Q

8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

9、存续期间：持续经营

10、股东及其出资比例：公司股东由国信证券有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。

11、内部组织结构及职能：

#### **权益投资一部**

负责公司公募基金产品、社保和专户理财投资业务。

#### **权益投资二部**

负责公司公募基金产品和专户理财投资业务。

#### **稳定收益投资部**

负责公司新股基金产品等以绝对回报为目标的公募基金和专户产品。

#### **量化及衍生品投资部**

负责公司量化公募基金产品和量化专户理财投资业务。

#### **固定收益总部**

负责公司固定收益类产品的研究与投资。

#### **研究部**

负责行业及上市公司研究，在公司既定的投资理念和研究理念的基础上，以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持工作。

#### **集中交易室**

负责及时、合规、准确地完成基金经理/投资经理下达的投资指令，防范交易风险，提供投资建议和分析报告。

#### **国际业务部**

负责QDII基金海外投资研究和QFII业务开拓，研究分析相关国际业务产品。

#### **投资银行部**

负责公司新三板和股权投资基金等相关业务工作。

#### **产品规划部**

负责制定公司产品规划与发展策略，以及产品设计、产品管理和产品研究工作，完善公司产品线，丰富公司产品储备。

#### **监察稽核部**

负责公司的法律合规、投资风控、绩效分析、风险/流程管理、稽核审计、以及信息披露

露。

### **总裁办公室**

负责公司财务管理、日常行政事务管理。

### **人力资源部**

负责公司人力资源管理工作。

### **登记结算部**

负责安全高效地完成资产组合的估值，注册登记及资金清算业务，保障后台运作正常运行。

### **信息技术部**

负责公司信息技术系统开发、运行和维护，为公司战略和业务发展提供全面、及时、可靠的信息技术支持。

### **市场发展部**

负责基金销售组织和支持、渠道管理及客服管理工作。

### **营销策划部**

负责公司品牌管理、媒体和广告管理、营销策划与销售支持等各项职能工作。

### **机构理财部**

负责开展公募基金直销、专户理财、社保等各项机构业务的营销和服务工作。

### **电子商务部**

负责公司电子商务平台的搭建、业务推广和公司网站、移动终端等平台的日常内容更新和运营维护，以及外部互联网金融业务合作及第三方销售机构的渠道管理工作。

### **渠道业务部**

负责券商渠道的管理和开拓工作。

### **客户关系管理中心**

贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护区域营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务。

### **北京分公司**

负责公司与北京地区各家银行、券商总部及国家相关部委的日常沟通、信息反馈工作；贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护北京及周边区域营销渠道，开展各项产品销售业务。

### **上海分公司**

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护浙江、江西、江苏、山东、安徽、上海及周边区域营销渠道，开展基金销售业务。

### **武汉分公司**

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护湖北、湖南、河南、重庆等区域营销渠



道，开展基金销售业务。

#### **广州分公司**

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护广东区域（除深圳）、广西、贵州及云南等区域营销渠道，开展基金销售业务。

#### **北方营销中心**

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护北京、河北、内蒙、天津、山西等区域营销渠道，开展基金销售业务。

#### **华南营销中心**

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护深圳、四川、福建、西北及新疆等区域营销渠道，开展基金销售业务。

#### **鹏华资产管理有限公司**

负责特定客户资产管理业务及中国证监会许可的其他业务。

#### **12、人员情况**

截至2019年12月31日，公司共有员工444人，其中，博士占比4.8%，硕士占比68.5%，本科占比24%，其他占比2.7%。

#### **13、信息披露联系人及咨询电话**

张戈 0755-82825720

#### **14、本基金基金经理**

罗捷先生，国籍中国，管理学硕士，8年证券基金从业经验。历任联合证券研究员、万得资讯产品经理、阿里巴巴（中国）网络技术有限公司产品经理；2013年8月加盟鹏华基金管理有限公司，曾任监察稽核部高级金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员、投资经理，现担任量化及衍生品投资部基金经理。2018年1月起担任鹏华深证民营ETF、鹏华深证民营ETF联接基金经理。2018年03月担任鹏华量化先锋混合基金基金经理，2018年03月至2019年05月担任鹏华量化策略混合基金基金经理，2018年03月担任鹏华医药指数（LOF）基金基金经理，2018年08月担任鹏华沪深300指数增强基金基金经理，2019年11月担任鹏华传媒分级基金基金经理。罗捷先生具备基金从业资格。

### **（二）基金托管人**

#### **一、基金托管人基本情况**

名称：中信证券股份有限公司（简称：中信证券）

住所：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

成立日期：1995 年 10 月 25 日

基金托管业务批准文号：《关于核准中信证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可[2014]1044 号）

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：1,211,690.84 万人民币

存续期间：持续经营

联系人：吴俊文

联系电话：010-60838888

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）成立于 1995 年 10 月 25 日，前身是中信证券有限责任公司。中信证券于 2003 年 1 月 6 日在上海证券交易所挂牌上市，并于 2011 年 10 月 6 日在香港联交所上市交易。截至 2018 年末，中信证券总资产为人民币 6531 亿元，净资产 1568 亿元。第一大股东为中国中信有限公司（持股比例为 16.5%）。

目前，中信证券拥有主要全资子公司 4 家，分别为中信证券（山东）有限责任公司、中信证券国际有限公司、金石投资有限公司、中信证券投资有限公司；拥有主要控股子公司 2 家，即中信期货有限公司、华夏基金管理有限公司。根据中国证监会核发的经营业务许可证，公司经营范围包括：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

此外，公司还具有以下业务资格：

1、经中国证监会核准或认可的业务资格：网上交易、受托理财、合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务（QDII）、直接投资业务、银行间市场利率互换、自营业务及资产管理业务开展股指期货交易资格、约定购回式证券交易资格、股票收益互换业务试点资格、自营业务及证券资产管理业务开展国债期货交易业务资格、黄金等贵金属现货合约代理及黄金现货合约自营业务试点资格、证券投资基金托管资格、信用风险缓释工具卖出业务资格、国债期货做市业务资格。

2、交易所核准的业务资格：交易所固定收益平台做市商、权证交易、质押式回购业务、港股通业务、上市公司股权激励行权融资业务、股票期权经纪业务、股票期权自营业务、上

证 50ETF 期权合约品种主做市商、上海证券交易所上市基金主做市商。

3、中国证券业协会核准的业务资格：报价转让、中小企业私募债券承销业务、柜台交易业务、股份转让系统从事推荐业务和经纪业务、场外期权、互联网证券业务。

4、中国人民银行核准的业务资格：全国银行间拆借市场成员、短期融资券承销、银行间债券市场做市商、公开市场一级交易商。

5、其它：记账式国债承销团成员、中国结算甲类结算参与者、证券业务外汇经营许可证（外币有价证券经纪业务、外币有价证券承销业务、受托外汇资产管理业务）、企业年金基金管理资格、政策性银行承销团成员资格、全国社保基金转持股份管理资格、全国社保基金境内投资管理人资格、受托管理保险资金资格、全国基本养老保险基金证券投资管理服务资格、转融通业务试点资格、保险兼业代理业务资格、新三板做市商、军工涉密业务咨询服务资格。

## 二、主要人员情况

2014 年中信证券设立托管部，管理并具体承办基金托管业务。托管部下设产品管理、估值核算、托管结算、监督稽核、同业服务、渠道服务、代理清算、营销管理、跨境运营、募集监督、运营规划支持、客户服务、风险管理、基金评价、客户方案、综合等业务组。部门员工均具备证券投资基金从业资格，并具有多年金融从业经历，核心业务岗人员均已具备 2 年相关业务经验。截至 2019 年 6 月 30 日，部门员工共计 110 人，平均具备 3 年以上托管业务相关从业经验。

吴俊文女士，中信证券托管部行政负责人；西安电子科技大学计算机及应用学学士，2000 年 7 月至 2014 年 7 月，担任中信证券清算部执行总经理，主要负责经纪业务、资产管理业务以及自营投资业务的业务运营管理工作，2014 年 7 月起任中信证券托管部行政负责人。

## 三、基金托管业务经营情况

中信证券于 2014 年 10 月经中国证监会核准获批证券投资基金托管资格。中信证券自取得证券投资基金托管资格以来，秉承“忠于所托，信于所管”的宗旨，严格遵守国家的有关法律法规和监管机构的有关规定，依靠科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的运营系统和专业的服务团队，切实履行资产托管人职责，为投资者提供安全、高效、专业的托管服务。

### （三）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：021-68419095

传真：021-68870311

联系人：陈文祥

**(四) 验资机构**

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

执行事务合伙人：李丹

办公室地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：潘晓怡

经办会计师：单峰、潘晓怡

**(五) 基金上市推荐人**

名称：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

联系人：郑慧

客户服务电话：95548

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

## 六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、 基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

### （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 2020 年 5 月 6 日资产负债表如下:

| 资 产      | 2020 年 5 月 6 日 | 负债和所有者权益    | 2020 年 5 月 6 日 |
|----------|----------------|-------------|----------------|
|          | 余额             |             | 余额             |
| 资 产：     |                | 负债：         |                |
| 银行存款     | 89,286,825.86  | 短期借款        |                |
| 结算备付金    | 636,480.13     | 交易性金融负债     |                |
| 存出保证金    | 20,735.74      | 衍生金融负债      |                |
| 交易类金融资产  | 147,416,179.93 | 卖出回购金融资产款   |                |
| 其中：股票投资  | 147,416,179.93 | 应付证券清算款     | 10,086,627.69  |
| 债券投资     |                | 应付赎回款       |                |
| 资产支持证券投资 |                | 应付管理人报酬     | 44,293.03      |
| 基金投资     |                | 应付托管费       | 22,146.48      |
| 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      | 128,335.78     |
| 应收证券清算款  |                | 应付税费        |                |
| 应收利息     | 276,434.14     | 应付利息        |                |
| 应收股利     |                | 应付利润        |                |
| 应收申购款    |                | 其他负债        | 15,006.51      |
| 其他资产     |                | 负债合计        | 10,296,409.49  |
|          |                | 所有者权益：      |                |
|          |                | 实收基金        | 223,088,000.00 |
|          |                | 未分配利润       | 4,252,246.31   |
|          |                | 所有者权益合计     | 227,340,246.31 |
|          |                |             |                |
| 资产合计     | 237,636,655.80 | 负债与持有人权益总计： | 237,636,655.80 |

八、 基金投资组合

截止到 2020 年 5 月 6 日，本基金的投资组合如下：

(一) 基金资产组合情况

| 序号 | 资产类别   | 金额（元）          | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 147,416,179.93 | 62.03        |
|    | 其中：股票  | 147,416,179.93 | 62.03        |
| 2  | 基金投资   |                |              |
| 3  | 固定收益投资 |                |              |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             |                |        |
|   | 资产支持证券            |                |        |
| 4 | 贵金属投资             |                |        |
| 5 | 金融衍生品投资           |                |        |
| 6 | 买入返售金融资产          |                |        |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 |                |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 89,923,305.99  | 37.84  |
| 8 | 其他各项资产            | 297,169.88     | 0.13   |
| 9 | 合计                | 237,636,655.80 | 100.00 |

(二) 按行业分类的股票投资组合

1、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              | 6,843,637.00  | 3.01         |
| C  | 制造业              | 73,997,446.32 | 32.55        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,154,760.00  | 2.27         |
| E  | 建筑业              | 3,348,360.00  | 1.47         |
| F  | 批发和零售业           |               |              |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,687,600.00  | 1.62         |
| H  | 住宿和餐饮业           |               |              |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  |               |              |
| J  | 金融业              | 38,576,126.00 | 16.97        |
| K  | 房地产业             | 15,675,223.00 | 6.90         |
| L  | 租赁和商务服务业         |               |              |
| M  | 科学研究和技术服务业       |               |              |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    |               |              |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    |               |              |
| P  | 教育               |               |              |
| Q  | 卫生和社会工作          |               |              |
| R  | 文化、体育和娱乐         |               |              |

|   |    |                |       |
|---|----|----------------|-------|
|   | 乐业 |                |       |
| S | 综合 |                |       |
|   | 合计 | 147,283,152.32 | 64.79 |

**2、积极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              | 104,692.67 | 0.05         |
| 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  | 28,334.94  | 0.01         |
| J  | 金融业              |            |              |
| K  | 房地产业             |            |              |
| L  | 租赁和商务服务业         |            |              |
| M  | 科学研究和技术服务业       |            |              |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    |            |              |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    |            |              |
| P  | 教育               |            |              |
| Q  | 卫生和社会工作          |            |              |
| R  | 文化、体育和娱乐业        |            |              |
| S  | 综合               |            |              |
|    | 合计               | 133,027.61 | 0.06         |

**3、按行业分类的港股通投资股票投资组合**

无。

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)        | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|--------------|
| 1  | 603328 | 依顿电子 | 622,400.00   | 6,609,888.00 | 2.91         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 5,000.00     | 6,500,000.00 | 2.86         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 187,400.00   | 6,489,662.00 | 2.85         |
| 4  | 002601 | 龙蟠佰利 | 388,700.00   | 6,390,228.00 | 2.81         |
| 5  | 600507 | 方大特钢 | 1,155,472.00 | 5,973,790.24 | 2.63         |
| 6  | 000895 | 双汇发展 | 143,800.00   | 5,966,262.00 | 2.62         |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 76,500.00    | 5,646,465.00 | 2.48         |
| 8  | 601166 | 兴业银行 | 344,000.00   | 5,617,520.00 | 2.47         |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 97,800.00    | 5,300,760.00 | 2.33         |
| 10 | 600028 | 中国石化 | 1,171,700.00 | 5,190,631.00 | 2.28         |

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五股票投资明细

| 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  | 002985 | 北摩高科 | 782.00 | 30,693.50 | 0.01         |
| 2  | 300832 | 新产业  | 882.00 | 27,685.98 | 0.01         |
| 3  | 002987 | 京北方  | 770.00 | 17,740.80 | 0.01         |
| 4  | 002983 | 芯瑞达  | 660.00 | 16,414.20 | 0.01         |
| 5  | 603212 | 赛伍技术 | 715.00 | 11,847.55 | 0.01         |

(四) 按债券品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投资明细

无。

(六) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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) 按公允价值占基金资产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**

**1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

**2、本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资股指期货将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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

**(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明**

**1、本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**3、本期国债期货投资评价**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**(十一) 投资组合报告附注**

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

方大特钢：

2019年11月6日，方大特钢科技股份有限公司（以下简称“方大特钢”或“公司”）收到南昌市应急管理局下发的《行政处罚决定书》[（洪）应急罚[2019]01号]，主要内容公告如下：

**一、安全事故的基本情况**

2019年5月29日16时23分，方大特钢炼铁厂二号高炉煤气上升管发生爆裂事故，事故造成6人死亡，4人受伤，导致较大亡人事故。（以下简称“本次事故”）

2019年9月16日，公司披露《关于被纳入安全生产失信联合惩戒“黑名单”的公告》，根据中华人民共和国应急管理部公告，公司被纳入“2019年第二批安全生产失信联合惩戒‘黑名单’单位及人员名单”。

## 二、行政处罚决定书相关情况

本次事故违反了《中华人民共和国安全生产法》第十七条的规定，依据《中华人民共和国安全生产法》第一百零九条第（二）项和《安全生产行政处罚自由裁量适用规则（试行）》第十五条第七款的规定，决定给予方大特钢人民币1,000,000元的行政处罚。

## 三、对公司的影响

（一）本次事故造成的直接经济损失共计人民币2724万余元，涉及遇难人员的善后工作和伤者的医疗救治工作全部完成。公司收到南昌市应急管理局下发的《行政处罚决定书》，将及时缴清罚款，该事项对公司当期及本年度的利润影响较小；

（二）事故发生后，公司深刻汲取教训，全面落实并加强各级安全管理，进行全面隐患排查治理，对安全自查及第三方机构检查评估发现的问题进行了全面整改。截至目前，公司生产经营情况正常；

（三）公司被纳入联合惩戒名单后，将对重大项目申报、依法取得政府性资金支持、评级授信、信贷融资等方面造成一定影响，截至目前，公司银行信贷保持正常流转，应急管理部门将加强对公司的巡查力度，保障公司安全生产。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

## 龙麟佰利：

近期，龙麟佰利集团股份有限公司（以下简称“公司”）收到河南省生态环境厅出具的《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】5号）、河南省生态环境厅出具的《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】7号）、焦作市应急管理局出具的《行政处罚决定书》（焦安监罚【2019】72号）、深圳证券交易所《关于对龙麟佰利集团股份有限公司的监管函》（中小板监管函【2019】第131号），主要内容公告如下：

### 一、河南省生态环境厅出具的《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】5号）

#### 1、行政处罚决定书的主要内容

公司存在年产12万吨硫酸法钛白粉生产线未经竣工环境保护验收即投入生产的违法行为。

公司上述行为违反了《建设项目环境保护管理条例》第十九条“编制环境影响报告书、环境影响报告表的建设项目，其配套建设的环境保护设施经验收合格，方可投入生产或者使用；未经验收或者验收不合格的，不得投入生产或者使用”的规定，已构成违法。

依据《建设项目环境保护管理条例》第二十三条第一款“违反本条例规定，需要配套建设的环境保护设施未建成、未经验收或者验收不合格，建设项目即投入生产或者使用，或者在环境保护设施验收中弄虚作假的，由县级以上环境保护行政主管部门责令限期改正，处 20 万元以上 100 万元以下的罚款；逾期不改正的，处 100 万元以上 200 万元以下的罚款；对直接负责的主管人员和其他责任人员，处 5 万元以上 20 万元以下的罚款；造成重大环境污染或者生态破坏的，责令停止生产或者使用，或者报经有批准权的人民政府批准，责令关闭”之规定，经集体研究，对公司环境违法行为作出以下处理决定：

- (1) 责令限期六个月改正环境违法行为；
- (2) 给予罚款四十万元的行政处罚。

## 2、整改措施

公司将及时履行上述处罚决定，积极办理相关手续。

## 二、河南省生态环境厅出具的《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】7 号）

### 1、行政处罚决定书的主要内容

公司年产 30 万吨硫氯耦合钛材料绿色制造项目主体工程已建成，配电设施、电器仪表系统和管线工程尚未建成，未依法报批建设项目环境影响评价文件。

公司上述行为违反了《中华人民共和国环境影响评价法》第二十二条第一款“建设项目的环评报告书、报告表，由建设单位按照国务院的规定报有审批权的环境保护行政主管部门审批”和《中华人民共和国环境影响评价法》第二十五条“建设项目的环评评价文件未依法经审批部门审查或者审查后未予批准的，建设单位不得开工建设”的规定，已构成违法。

依据《中华人民共和国环境影响评价法》第三十一条第一款“建设单位未依法报批建设项目环评报告书、报告表，或者未依照本法第二十四条的规定重新报批或者报请重新审核环评报告书、报告表，擅自开工建设的，由县级以上环境保护行政主管部门责令停止建设，根据违法情节和危害后果，处建设项目总投资额百分之一以上百分之五以下的罚款，并可以责令恢复原状；对建设单位直接负责的主管人员和其他直接责任人员，依法给予行政处分。”之规定，经研究，对公司环境违法行为作出以下处理决定：

- (1) 责令停止建设；
- (2) 按照总投资额 6500 万元的百分之二处以罚款人民币壹佰叁拾万元。

## 2、整改措施

公司将及时履行上述处罚决定，积极办理相关手续。

三、焦作市应急管理局出具的《行政处罚决定书》（焦安监罚【2019】72号）

公司组织建设的100万吨/年高盐废水深度治理项目，前期已要求停止建设，在项目未取得建设项目安全审查书的情况下，项目仍有开工行为。

上述事实违反了《危险化学品安全管理条例》第十二条第一款“新建、改建、扩建生产、储存危险化学品的建设项目（以下简称建设项目），应当由安监部门进行安全条件审查。”的规定。

依据《危险化学品安全管理条例》第七十六条第一款“未经安全条件审查，新建、改建、扩建生产、储存危险化学品的建设项目的，由安监部门责令停止建设，限期改正；逾期不改正的，处50万元以上100万元以下的罚款；构成犯罪的，依法追究刑事责任。”的规定，决定给予处罚款人民币壹佰万元整的行政处罚

## 2、整改措施

公司将及时履行上述处罚决定，积极办理相关手续。

三、深圳证券交易所《关于对龙麟佰利联集团股份有限公司的监管函》（中小板监管函【2019】第131号）

## 1、主要内容

2019年7月9日，公司披露《关于2019年度日常关联交易预计情况的公告》称，截至2019年6月30日，公司与关联方焦作市维纳科技有限公司及四川龙麟集团有限责任公司的公司发生关联交易1.18亿元，占公司2018年末经审计净资产的0.95%，公司未及时披露上述关联交易。

公司的上述行为违反了本所《股票上市规则（2018年11月修订）》第2.1条、第2.7条、第10.2.4条和第10.2.11条的规定。

## 2、整改措施

公司收到《监管函》后，公司组织董事、监事、高级管理人员及相关业务人员对《股票上市规则》和《中小企业板上市公司规范运作指引》等相关规定进行学习，总结相关经验与教训，增强合规意识，切实履行信息披露义务，杜绝类似问题再次发生。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

## 2、基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。。

## 3、其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）   |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 20,735.74  |
| 2  | 应收证券清算款 |            |
| 3  | 应收股利    |            |
| 4  | 应收利息    | 276,434.14 |
| 5  | 应收申购款   |            |
| 6  | 其他应收款   |            |
| 7  | 待摊费用    |            |
| 8  | 其他      |            |
| 9  | 合计      | 297,169.88 |

## 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 300832 | 新产业  | 27,685.98      | 0.01         | 新股未上市    |
| 2  | 002987 | 京北方  | 17,740.8       | 0.01         | 新股未上市    |

## 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，投资组合报告中数字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期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

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

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

### 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。

(二) 根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

(四) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为中信证券股份有限公司。上市推荐人就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，文件内所载的资料均经过核实。

### 十三、备查文件目录

(一) 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 2、《鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

- 4、《鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照

(二) 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

(三) 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999、4006788533。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

鹏华基金管理有限公司

二〇二〇年五月八日

**附件：鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要**

**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、义务**

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项或股票、应付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定；
- (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) 基金管理人的权利、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、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) 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、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，为基金的利益依法进行融资融券及转融通证券出借业务；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

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

- (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
- (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 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出, 并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式, 随时查阅到与基金有关的公开资料, 并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集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) 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、义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 从基金管理人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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (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召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置和相关规则按照法律法规的有关规定进行。

若本基金推出本基金的联接基金，则：

鉴于本基金和 ETF 联接基金的相关性，ETF 联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的 ETF 联接基金的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，ETF 联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，ETF 联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的 ETF 联接基金份额占 ETF 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。

ETF 联接基金的基金管理人不应以 ETF 联接基金的名义代表 ETF 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 ETF 联接基金的特定基金份额持有人的委托以 ETF 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。

ETF 联接基金的基金管理人代表 ETF 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 ETF 联接基金基金合同的约定召开 ETF 联接基金的基金份额持有人大会，ETF 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 ETF 联接基金的基金管理人代表 ETF 联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

(一) 召开事由

1、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；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 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除外；
- (9) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (10) 变更基金份额持有人大会程序；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 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；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 调低除基金管理费、基金托管费外其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 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;

(4) 增加、减少、调整基金份额类别设置;

(5) 基金管理人、相关证券交易所、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务规则;

(6) 基金推出新业务或服务;

(7) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(8) 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;

(9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时,由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开,并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额 10% 以上

(含 10%) 的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。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书面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；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人亦可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

###### （2）通讯开会

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

#### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除本基金合同另有约定的，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 2 日内在指定媒介上公告。

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) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### (二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### (三) 基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配采用现金方式；

3、当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，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》；

4、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；

5、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、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。

#### （五）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 日内在指定媒介公告。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

### 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》生效后的标的指数许可使用费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费、诉讼费、公证费和认证费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券/期货交易费用；

- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券/期货账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费及年费、登记结算费用、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 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休日等，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% 的年费率计提。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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

标的指数供应商根据相应标的指数许可协议变更标的指数许可使用费率、计算方式和支付方式时，基金管理人需依照有关规定最迟于新的费率、计算方式和支付方式实施日前 2 日在指定媒介公告并书面通知基金托管人。

上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、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、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

(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、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册的股票）、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货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）。

本基金可依据法律法规的规定，参与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。

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比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相

应调整。

### （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%，中国证监会规定的特殊品种除外；
- （4）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （5）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （6）本基金应投资于信用级别评级为 **BBB** 以上（含 **BBB**）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- （7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （9）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；
- （10）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：
  - a. 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%；
  - b. 本基金在任何交易日日终，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；



c.本基金在任何交易日日终，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%；

d.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；

e.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%；

f.每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(11) 本基金参与融资的，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%；

(12) 本基金参与转融通证券出借业务，应当遵守下列要求：

a.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；

b.参与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%；

c.最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

d.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；

(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该基金资产净值的 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；

(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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（6）、（12）、（13）、（14）情形之外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、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；因前述因素致使基金投资比例不符合上述第（12）项情形时，基金管理人不得新增出借业务；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。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，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。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (二) 基金净值信息的公告方式

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前且基金份额未上市交易的，基金管理人应当至少每周在指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或基金份额上市交易的，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交

易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，在指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、基金合同变更和终止的事由、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后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。

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具有证券、期货相关业务资格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指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (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15年以上。

### 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，任何一方均有权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，对各方当事人均有约束力，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》受中国法律管辖。

#### **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。