
中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
上市交易公告书

中银基金管理有限公司

二〇二〇年八月十三日

目录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	4
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	8
五、基金主要当事人简介.....	9
六、基金合同摘要.....	17
七、基金财务状况.....	18
八、基金投资组合.....	20
九、重大事项揭示.....	24
十、基金管理人承诺.....	25
十一、基金托管人承诺.....	26
十二、基金上市推荐人意见.....	27
十三、备查文件目录.....	28
附件：基金合同内容摘要.....	29

一、重要声明与提示

中银中证 800 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，中银基金管理有限公司（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。本基金托管人中信银行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，请投资人详细查阅刊登在本基金管理人网站（<http://www.bocim.com>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

- 1、基金名称：中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金简称：中银 800
- 3、基金二级市场交易简称：中银 800
- 4、二级市场交易代码：515610
- 5、基金申购、赎回简称：中银 800
- 6、申购、赎回代码：515611
- 7、2020 年 8 月 11 日基金份额总额：377,857,400.00 份（未经份额折算）
- 8、2020 年 8 月 11 日基金份额净值：0.9965 元（未经份额折算）
- 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 8 月 18 日。
- 11、基金管理人：中银基金管理有限公司。
- 12、基金托管人：中信银行股份有限公司。
- 13、上市推荐人：中银国际证券股份有限公司。
- 14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：招商证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司与广发证券股份有限公司。若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

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【2019】2049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2020年4月30日至2020年7月8日公开发售。其中，网下现金认购的日期为2020年4月30日至2020年7月8日，网上现金认购的日期为2020年7月6日至2020年7月8日，网下股票认购的日期为2020年4月30日至2020年7月8日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售期限：网下现金发售45个工作日，网上现金发售3个工作日。

7、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购3种方式。

8、发售机构

（1）直销机构

投资人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和网下股票认购。

（2）代销机构

本基金的网下现金发售代理机构为申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、国信证券股份有限公司。

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。

（二）基金合同生效

本基金自2020年4月30日起向社会公开募集，截至2020年7月8日募集工作已顺利结束。经安永华明会计师事务所验资，本次募集的净认购金额为377,855,000.00元人民币，折合基金份额377,855,000.00份；通过网下直销现金

认购的有效净认购资金在募集期间产生的银行利息共计 2,400.00 元人民币，折算为投资人基金份额；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净认购资金在注册登记机构清算交收后至划入基金托管账户前一日产生的利息计入基金财产，不折算为投资人基金份额。上述资金净额已于 2020 年 7 月 14 日划入基金托管人在中信银行股份有限公司开立的本基金托管账户。

本次募集有效认购户数为 4,642 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 377,857,400.00 份，已全部计入基金份额持有人的证券账户，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《中银中证 800 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 2020 年 7 月 16 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【2020】252 号。

2、上市交易日期：2020 年 8 月 18 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：中银 800ETF（基金扩位简称：中银中证 800ETF）

5、二级市场交易代码：515610。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、基金申购、赎回简称：中银 800ETF（基金扩位简称：中银中证 800ETF）

7、申购、赎回代码：515611。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：招商证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司与广发证券股份有限公司。

8、本次上市交易份额：377,857,400.00 份。

9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2020 年 8 月 11 日，本基金基金份额持有人户数为 4,642 户，平均每户持有的基金份额为 81,399 份。

（二）持有人结构

截至 2020 年 8 月 11 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 32,867,400.00 份，占基金总份额的 8.70%；个人投资者持有的基金份额为 344,990,000.00 份，占基金总份额的 91.30%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至 2020 年 8 月 11 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	中银国际证券—中国银行—中银证券中国红—汇中 1 号集合资产管理计划	20002400	5.29
2	海南家美太阳能有限公司	5000000	1.32
3	赵永祥	2000000	0.53
4	杨正钢	2000000	0.53
5	黄旭东	2000000	0.53
6	唐剑刚	2000000	0.53
7	范燕	1980000	0.52
8	山东天泽石油科技有限公司	1800000	0.48
9	纪汉佐	1800000	0.48
10	王奕	1500000	0.40
11	喻苹	1500000	0.40
12	陈潜	1500000	0.40

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：中银基金管理有限公司
- 2、法定代表人：章砚
- 3、总经理：李道滨
- 4、注册资本：1 亿元人民币
- 5、注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 45 楼
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会、证监基金字【2004】93 号
- 7、工商登记注册的营业执照统一社会信用代码：9131000071785197XF
- 8、经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

9、股权结构

股东名称	持股比例
中国银行股份有限公司	83.5%
贝莱德投资管理（英国）有限公司	16.5%

10、内部组织结构及职能

公司拥有健全的法人治理结构体系，贯彻民主集中制原则，建立了股东会、董事会、监事等组织机构。公司在章程和各个组织机构的议事规则中，明晰了各组织的职责，对股东会、董事会、监事、管理层等各个法人治理组织权力进行相互制衡。董事会充分重视独立董事的作用，九位董事会成员中有四位独立董事。独立董事具有明确的职责、权利和义务，独立监督公司做出客观决策。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常管理。公司在管理层面设置执行委员会，审议决定公司日常经营管理中的重大事项。公司下设投资部门、市场推广及销售部门、合规部门、审计部门、风险管理部门、运营部门、财务部门等，能够保证本基金顺利、规范运作。

11、人员情况

（1）董事会成员

章砚（ZHANG Yan）女士，董事长。国籍：中国。英国伦敦大学伦敦政治经

济学院公共金融政策专业硕士。现任中银基金管理有限公司董事长。历任中国银行总行全球金融市场部主管、助理总经理、总监，总行金融市场总部、投资银行与资产管理部总经理。

李道滨（LI Daobin）先生，董事。国籍：中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。

韩温（HAN Wen）先生，董事。国籍：中国。首都经济贸易大学经济学学士。现任中国银行总行人力资源部副总经理。历任中国银行北京市分行公司业务部高级经理，通州支行副行长，海淀支行副行长，上地支行副行长（主持工作）、行长，丰台支行行长等职。

杨柳（YANG Liu）先生，董事。国籍：中国。2019年9月起担任中银基金管理有限公司董事。武汉大学经管学院企业管理硕士研究生。现任中国银行财富与私人银行部副总经理。曾任中国东方信托投资公司（原中国银行信托公司）副处长、处长，中国银行托管部处长、副总经理。

曾仲诚（Paul Tsang）先生，董事。国籍：中国。为贝莱德亚太区首席风险管理总监、董事总经理，负责领导亚太区的风险管理工作，同时担任贝莱德亚太区执行委员会成员。曾先生于2015年6月加入贝莱德。此前，他曾担任摩根士丹利亚细亚洲首席风险管理总监，以及其亚太区执行委员会成员，带领独立的风险管理团队，专责管理摩根士丹利在亚洲各经营范围的市场、信贷及营运风险，包括机构销售及交易（股票及固定收益）、资本市场、投资银行、投资管理及财富管理业务。曾先生过去亦曾于美林的市场风险管理团队效力九年，并曾于瑞银的利率衍生工具交易\结构部工作两年。曾先生现为中国清华大学及北京大学的风险管理客座讲师。他拥有美国威斯康辛大学麦迪逊分校工商管理学士学位，以及宾夕法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士学位。

赵欣舸（ZHAO Xinge）先生，独立董事。国籍：中国。美国西北大学经济学博士。曾在美国威廉与玛丽学院商学院任教，并曾为美国投资公司协会（美国共同基金业行业协会）等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教务长和金融MBA主任，并在华宝信托担任独立董事。

杜惠芬（DU Huifen）女士，独立董事。国籍：中国。山西财经大学经济学

学士，美国俄克拉荷马州梅达斯经济学院工商管理硕士，澳大利亚国立大学高级访问学者，中央财经大学经济学博士。现任中央财经大学金融学院教授，兼任新时代信托股份有限公司独立董事。曾任山西财经大学计统系讲师、山西财经大学金融学院副教授、中央财经大学独立学院（筹）教授、副院长、中央财经大学金融学院副院长等职。

付磊（FU Lei）先生，独立董事。国籍：中国。首都经济贸易大学管理学博士。现任首都经济贸易大学会计学院教授、博士生导师。兼任中国商业会计学会常务理事、中国内部审计协会理事、中国会计学会会计史专业委员会主任、北京会计学会常务理事、北京总会计师协会学术委员，江河创建集团股份有限公司独立董事、北京九强生物技术股份有限公司独立董事、航天长征化学工程股份有限公司独立董事、国投泰康信托有限公司独立董事等职。

孙祁祥（SUN Qixiang）女士，独立董事。国籍：中国。北京大学经济学博士。现任北京大学经济学院教授，博士生导师。兼任北京大学政府和社会资本合作（PPP）研究中心主任、北京大学中国保险与社会保障研究中心主任。曾任北京大学经济学院院长、亚太风险与保险学会主席、美国哈佛大学访问教授。

（2）监事

卢井泉（LU Jingquan）先生，监事，国籍：中国。南京政治学院法学硕士。历任空军指挥学院教员、中国银行总行机关党委组织部副部长、武汉中北支行副行长、企业年金理事会高级经理、投资银行与资产管理部高级交易员。

赵蓓青（ZHAO Beiqing）女士，职工监事，国籍：中国，研究生学历。历任辽宁省证券公司上海总部交易员、天治基金管理有限公司交易员、中银基金管理有限公司交易员、交易主管。现任中银基金管理有限公司交易部总经理。

（3）管理层成员

李道滨（LI Daobin）先生，董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军（Jason X. OUYANG）先生，督察长。国籍：加拿大。中国证券业协会-沃顿商学院高级管理培训班(Wharton-SAC Executive Program)毕业证书，加拿大西部大学毅伟商学院(Ivey School of Business, Western University)工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任蔚深证券有限

责任公司(现英大证券)研究发展中心总经理、融通基金管理公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文(ZHANG Jiawen)先生, 副执行总裁。国籍: 中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

王圣明(WANG Shengming)先生, 副执行总裁。国籍: 中国。北京师范大学教育管理学院硕士。现任中银基金管理有限公司副执行总裁。历任中国银行托管业务部副总经理。

闫黎平(YAN Liping)女士, 副执行总裁。国籍: 中国。中国人民大学法学院法学硕士。2019 年加入中银基金管理有限公司, 现任中银基金管理有限公司副执行总裁。曾任南方基金管理股份有限公司总裁助理兼保险机构业务部总经理。

12、信息披露负责人: 欧阳向军

咨询电话: 021-38834999

13、基金管理业务情况

截至 2019 年 12 月 31 日, 本基金管理人共管理 115 只开放式证券投资基金。

14、本基金基金经理

赵建忠(ZHAO Jianzhong)先生, 中银基金管理有限公司助理副总裁(AVP), 金融学硕士。2007 年加入中银基金管理有限公司, 曾担任基金运营部基金会计、研究部研究员、基金经理助理。2015 年 6 月至今任中银中证 100 基金基金经理, 2015 年 6 月至今任国企 ETF 基金基金经理, 2015 年 6 月至今任中银 300E 基金基金经理, 2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银宏利基金基金经理, 2016 年 8 月至 2018 年 2 月任中银丰利基金基金经理, 2020 年 4 月至今任中银 100 基金基金经理。具有 13 年证券从业年限。具备基金、期货从业资格。

(二) 基金托管人情况

1、基本情况

名称: 中信银行股份有限公司

住所: 北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

成立时间：1987 年 4 月 20 日

批准设立机关和批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2004]125 号

注册资本：489.35 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：4006800000

传真：010-85230024

2、主要人员情况

孙德顺先生，中信银行执行董事、行长。孙先生自 2016 年 7 月 20 日起任本行行长。孙先生同时担任中信银行（国际）董事长。此前，孙先生于 2014 年 5 月至 2016 年 7 月任本行常务副行长；2014 年 3 月起任本行执行董事；2011 年 12 月至 2014 年 5 月任本行副行长，2011 年 10 月起任本行党委副书记；2010 年 1 月至 2011 年 10 月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长；2005 年 12 月至 2009 年 12 月任交通银行北京市分行党委书记、行长；1984 年 5 月至 2005 年 11 月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心（北京）等单位工作，期间，1995 年 12 月至 2005 年 11 月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长，1999 年 1 月至 2004 年 4 月曾兼任中国工商银行数据中心（北京）总经理；1981 年 4 月至 1984 年 5 月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学，获经济学硕士学位。

杨毓先生，中信银行副行长，分管托管业务。杨先生自 2015 年 7 月起任本行党委委员，2015 年 12 月起任本行副行长。此前，杨先生 2011 年 3 月至 2015 年 6 月任中国建设银行江苏省分行党委书记、行长；2006 年 7 月至 2011 年 2 月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长；1982 年 8 月至 2006 年 6 月在中国建设银行河南省分行工作，历任计财处副处长，信阳分行副行长、党委委员，计财处处长，郑州市铁道分行党委书记、行长，郑州分行党委书记、行长，河南省分行党委副书记、副行长（主持工作）。杨先生为高级经济师，研究生学历，

管理学博士。

杨洪先生，现任中信银行资产托管部总经理，硕士研究生学历，高级经济师，教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997 年加入中信银行，相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长，总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长，总行行政管理部总经理。

3、基金托管业务经营情况

2004 年 8 月 18 日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至 2019 年半年末，中信银行托管 140 只公开募集证券投资基金，以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII 等其他托管资产，托管总规模达到 8.79 万亿元人民币。

4、基金托管人的内部风险控制制度说明

(1) 内部控制目标。强化内部管理，确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；建立完善的规章制度和操作规程，保证基金托管业务持续、稳健发展；加强稽核监察，建立高效的风险监控体系，及时有效地发现、分析、控制和避免风险，确保基金财产安全，维护基金份额持有人利益。

(2) 内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会，负责全行的风险控制和风险防范工作；托管部内设内控合规岗，专门负责托管部内部风险控制，对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

(3) 内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度，涵盖证券投资基金托管业务的各个环节，保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

(4) 内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规

范等，从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展；建立了安全保管基金财产的物质条件，对业务运行场所实行封闭管理，在要害部门和岗位设立了安全保密区，安装了录像、录音监控系统，保证基金信息的安全；建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度，确保所托管的基金财产独立运行；营造良好的内部控制环境，开展多种形式的持续培训，加强职业道德教育。

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

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。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。基金托管人发现基金管理人重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

（三）基金上市推荐人

中银国际证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

客服电话：400-620-8888

网址：<https://www.bocichina.com>

（四）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

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

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：陈露

经办注册会计师：陈露、许培菁

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 2020 年 8 月 11 日的资产负债表（未经审计）如下：

中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

2020年8月11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 2020 年 8 月 11 日
资产：	
银行存款	127,732,857.49
结算备付金	2,005,156.11
存出保证金	36,859.97
交易性金融资产	246,965,446.53
其中：股票投资	246,941,646.53
基金投资	
债券投资	23,800.00
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	105,954.68
应收股利	
应收申购款	
其他资产	2,400.00
资产总计	376,848,674.78
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	51,328.95
应付托管费	5,703.21
应付销售服务费	
应付交易费用	229,074.93
应交税费	0.01
应付利息	
应付利润	
预提费用	
其他负债	32,638.81
负债合计	318,745.91
所有者权益：	
实收基金	377,857,400.00
未分配利润	-1,327,471.13
所有者权益合计	376,529,928.87
负债和所有者权益总计	376,848,674.78

注：报告截止日 2020 年 8 月 11 日，本基金份额净值：0.9965 元，本基金份额总额：377,857,400.00 份。

八、基金投资组合

截至 2020 年 8 月 11 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	246,941,646.53	65.53
	其中：股票	246,941,646.53	65.53
2	固定收益投资	23,800.00	0.01
	其中：债券	23,800.00	0.01
	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	129,738,013.6	34.43
6	其他各项资产	145,214.65	0.04
7	合计	376,848,674.78	100

（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：本基金本报告期末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	3,358,962.00	0.89
B	采矿业	6,157,285.00	1.64
C	制造业	127,368,566.53	33.83
D	电力、热力、燃气及水的生产和供应业	4,811,334.00	1.28
E	建筑业	4,535,196.00	1.20
F	批发和零售业	5,260,113.00	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	6,312,414.00	1.68
H	住宿和餐饮业	276,606.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,568,992.00	3.34
J	金融业	55,732,338.00	14.80

K	房地产业	8,699,508.00	2.31
L	租赁和商务服务业	4,219,692.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	1,767,960.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	671,490.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	356,790.00	0.09
Q	卫生和社会工作	2,432,924.00	0.65
R	文化、体育和娱乐业	2,047,572.00	0.54
S	综合	363,904.00	0.10
	合计	246,941,646.53	65.58

(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	601318	中国平安	121,800	9,350,586.00	2.48
2	600519	贵州茅台	5,303	8,710,230.53	2.31
3	000858	五粮液	21,600	4,514,400.00	1.20
4	600036	招商银行	115,800	4,347,132.00	1.15
5	000333	美的集团	55,200	3,935,760.00	1.05
6	600276	恒瑞医药	42,000	3,854,760.00	1.02
7	000651	格力电器	54,000	3,016,980.00	0.80
8	600030	中信证券	96,000	3,005,760.00	0.80
9	002475	立讯精密	47,400	2,473,332.00	0.66
10	600887	伊利股份	68,400	2,462,400.00	0.65

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券		
	其中：政策性金融债		
4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	中期票据		
7	可转债（可交换债）	23,800.00	0.01
8	同业存单		
9	其他		
10	合计	23,800.00	0.01

（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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113038	隆 20 转债	130	13,000.00	0.00
2	128126	赣锋转 2	108	10,800.00	0.00

（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、报告期内，中信证券股份有限公司因营业部内部控制不完善等原因，被中国证监会采取行政监管措施。

基金管理人通过进行进一步了解后，认为该处罚不会对上述证券的投资价值构成实质性的影响。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、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

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	36,859.97
2	应收证券清算款	

3	应收股利	
4	应收利息	105,954.68
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	2,400.00
9	合计	145,214.65

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：

（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；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

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)中国证监会准予中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件;

(二)《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(三)《中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(四)《中银中证 800 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。

中银基金管理有限公司

二〇二〇年八月十三日

附件：基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

（1）依法募集资金；

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

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律、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）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，为基金的利益依法为基金进行融资和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) 向基金份额持有人介绍、发送或传递关于本基金的信息；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人，同时将已冻结的股票解冻；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价的现金部分；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 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》、《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监管机构，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。

(三) 基金份额持有人的权利和义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资

价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购款项或认购股票、申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

(10) 同意基金管理人向其介绍、发送或传递有关本基金的信息；

(11) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

未来，若本基金推出本基金的联接基金，则鉴于本基金和本基金联接基金（即“中银中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，以下简称“联接基金”）的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会

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：

- （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，但基金合同另有约定的除外；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规或监管机构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，但基金合同另有约定除外；

（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）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被证券交易所终止上市的除外；

（13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规、相关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、上海证券交易所和登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务的规则；
- (6) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、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) 在其他境内外证券交易所上市、增加场外申购赎回方式、开通跨系统转托管业务或暂停、停止场外申购赎回业务；
- (9) 增加、减少、调整基金份额类别设置；
- (10) 本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回；
- (11) 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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或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、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用纸质、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

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

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

(2) 通讯开会

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

(六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除基金合同另有约定外,转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基

金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（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 2 日内在指定媒介上公告。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）对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，本部分对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，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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，本基金可进行收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金的收益分配采取现金分红的方式；

3、当基金累计报酬率超过同期业绩比较基准累计报酬率达到 1.0% 以上时，可进行收益分配；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率；

6、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）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 日内在指定媒介公告。

（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者自行承担。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、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、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 9、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，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 0.05% 的年费率计提。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

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

3、基金的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可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、计算方法及支付方式在招募说明书中列示。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。

基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—8 及第 10-11 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、基金的投资范围和投资限制

（一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、股票期权、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金，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)。

本基金还可参与融资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。

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%；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。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（二）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) 每个交易日日终在扣除股指期货、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、存出保证金和应收申购款等；

(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%；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 本基金参与股指期货交易的，应当符合下列投资限制：

1) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 在任何交易日日终，持有的买入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；

3) 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%；

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；

5) 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%；

(11) 因未平仓的股票期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽股票期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的股票期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征；

(12) 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%；

(13) 本基金参与转融通证券出借业务，应当符合下列投资限制：

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第（14）项流动性受限资产的范围；

2) 参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 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；

4) 最近 6 个月日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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第（13）条规定的，基金管理人不得新增出借业务。

(14) 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；

(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) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(17) 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(2)、(10)、(13)、(14)、(15)情形之外,因证券/期货市场波动、上市公司合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 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其他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。

六、基金资产净值的计算和公告方式

（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。

基金资产净值和基金份额净值的公告

《基金合同》生效后，在基金份额上市交易前或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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在基金份额上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个交易日/开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日/开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

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上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用、律师费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律（不含港澳台立法）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。