

# 浦银安盛中证ESG120策略交易型开放式 指数证券投资基金上市交易公告书

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司  
基金托管人:华夏银行股份有限公司  
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司  
上市地点:上海证券交易所  
上市时间:2021年8月13日  
公告日期:2021年8月10日

## 一、重要声明与提示

《浦银安盛中证ESG 120策略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,浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人浦银安盛基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告书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。本基金托管人华夏银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料内容的真实性、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”)、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2021年6月15日刊登在中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)及浦银安盛基金管理有限公司网站([www.py-axa.com.cn](http://www.py-axa.com.cn))上的《浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

## 二、基金概况

- 1.基金名称:浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金
- 2.基金类型:股票型
- 3.基金的运作方式:交易型开放式
- 4.基金的存续期限:不定期
- 5.基金简称:浦银安盛中证ESG 120策略ETF
- 6.基金二级市场交易简称及交易代码:ESGETF,交易代码:516720
- 7.基金份额总额:504,337,807.00份(截至2021年8月6日)
- 8.基金份额净值:1.0000(截至2021年8月6日)
- 9.本次上市交易基金份额总额:504,337,807.00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:2021年8月13日
- 12.基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
- 13.基金托管人:华夏银行股份有限公司
- 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: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.基金募集申请的注册机构和注册文号:中国证监会证监许可〔2021〕1103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:2021年6月18日至2021年7月16日
  - 5.发售价格:1.00元人民币
  - 6.发售方式:本基金通过基金份额发售机构向投资者公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式认购本基金。
  - 7.基金份额发售机构
    - (1)网上现金发售代理机构  
网上现金发售通过具有基金代销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。
    - (2)网下现金、网下股票发售机构
      - (i)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和网下股票认购。
      - (ii)发售代理机构(含网下现金及网下股票认购)  
光大证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、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、中信证券华南股份有限公司、中泰证券股份有限公司、长江证券股份有限公司。
  - 8.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
  - 9.募集资金总额及认购情况:截至2021年7月22日,本次募集的有效净认购金额为人民币504,328,853.00元,本基金募集期间有效认购资金按活期适用利率计算产生的利息共计人民币8,954.00元,实收基金(本息)共计人民币504,337,807.00元,折合504,337,807.00份基金份额。现金认购资金于2021年7月22日划入本基金托管账户,网下认购股票于2021年7月21日划至本基金证券账户。
  - 10.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》等相关法律、法规的规定以及《浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关规定,本基金募集结果符合备案条件,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2021年7月22日获中国证监会书面确认,基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。
  - 11.基金合同生效日:2021年7月22日
  - 12.基金合同生效日的基金份额总额:504,337,807.00份

## (二)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〔2021〕339号。
  - 2.上市交易日期:2021年8月13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:ESGETF。
  - 5.基金一级市场交易代码:516720。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交易。
  - 6.基金申购、赎回简称:ESGETF。
  - 7.基金申购、赎回代码:516721。
- 本基金管理人自2021年8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:华泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、海通证券股份有限公司。
- 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。
- 8.本次上市交易的基金份额总额:504,337,807.00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。
  - 10.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,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过网站、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,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情况

- (一)持有人户数  
截至2021年8月6日,本基金份额持有人总户数为2,903户,平均每户持有的场内基金份额为173,729.87份。
- (二)持有人结构  
截至2021年8月6日,本基金份额持有人结构如下:

机构投资者持有的本基金份额259,330,954.00份,占比51.42%;个人投资者持有的本基金份额245,006,853.00份,占比48.58%。

本基金管理人的从业人员未持有本基金基金份额,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研发部门负责人未持有本基金,本基金的基金经理未持有本基金。

(三)截至2021年8月6日,本基金前十名基金份额持有人情况如下:

序号	持有人名称	持有基金份额(份)	占基金总份额的比例
1	浦银安盛基金-上海银行-浦银安盛博悦2号FOF集合资产管理计划	35,001,458.00	6.94%
2	工银安盛人寿保险有限公司	30,002,500.00	5.95%
3	浦银安盛基金-上海伴兴实业发展有限公司-浦银安盛盛明8号单一资产管理计划	15,000,624.00	2.97%
4	长城证券股份有限公司	12,000,000.00	2.38%
5	太平养老溢鑫混合型养老金产品-招商银行股份有限公司	10,000,972.00	1.98%
	太平养老溢鑫混合型养老金产品-中国建设银行股份有限公司	10,000,972.00	1.98%
	太平养老溢鑫混合型养老金产品-交通银行股份有限公司	10,000,972.00	1.98%
8	浦银安盛基金-尊享盈新策略2号-浦银安盛盛卓7号单一资产管理计划	10,000,416.00	1.98%
	长安国际信托股份有限公司-长安信托-交银致远策略优选6号集合资金信托计划	10,000,416.00	1.98%
10	华宝证券股份有限公司	10,000,000.00	1.98%
	华泰证券股份有限公司	10,000,000.00	1.98%

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

#### 1、基本信息

名称:浦银安盛基金管理有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道981号3幢316室

办公地址:上海市淮海中路381号中环广场38楼

法定代表人:谢伟

总经理:郁蓓华

成立时间:2007年8月5日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2007]207号

统一社会信用代码:91310000717880594D

组织形式:有限责任公司

注册资本:19.1亿元

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理,境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

#### 2、股权结构:

上海浦东发展银行股份有限公司持有51%的股权;安盛投资管理公司持有39%的股权;上海国盛集团资产管理有限公司持有10%的股权。

#### 3、内部组织结构及职能

公司设股东会、监事会和董事会。股东会由全体股东组成。监事会共有4名成员,董事会共有11名董事。董事会下设2个专门委员会:“薪酬委员会”和“合规及审计委员会”。公司管理层下设“执行委员会”,由公司高管组成,作为公司重大事项的最高议事机构,下设5个专业委员会:“投资决策委员会”、“风险控制委员会”、“产品开发委员会”、“信息技术治理委员会”和“估值委员会”。公司下设25个主要部门,以及上海、北京、深圳三个分公司,主要部门包括权益投资部、权益专户部、指数与量化投资部、FOF业务部、研究部、固定收益投资部、固定收益专户部、信用研究部、零售业务部、机构业务部、互联网金融部、市场部、产品开发部、风险管理部、法律合规部、审计部、集中交易部、基金运营部、信息技术部、战略创新部、人力资源部、董事会办公室、综合行政部、公司财务部、投顾财富管理。

#### 4、人员情况

截至2021年6月30日,公司现有员工242人,其中高管5人,投研团队67人,市场团队67人,后台运营103人,员工中拥有硕士及以上学历占66.53%。

#### 5、信息披露负责人及咨询电话:

薛香:021-23212888

#### 6、基金管理业务情况

截至2021年6月30日,基金管理人共管理78只基金。

#### 7、本基金基金经理

陈士俊先生,清华大学管理学博士。2001年7月至2003年6月,任国泰君安证券有限公司研究所金融工程研究员。2003年7月至2007年9月,任银河基金管理有限公司金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月至今,任浦银安盛基金管理有限公司指数与量化投资部总监,2010年12月10日起兼任浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金基金经理,2012年5月14日起兼任浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金经理,2017年4月27日起兼任浦银安盛中证锐联沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2018年9月5日起兼任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年1月29日起兼任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年4月1日起兼任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2020年4月30日起兼任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月12日起兼任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年9月23日起兼任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021年5月27日起兼任浦银安盛鑫福混合型证券投资基金基金经理。2021年7月22日起兼任浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。自2012年3月起兼任本公司职工监事。陈士俊先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

高钢杰先生,中国科学院天体物理博士。2010年10月至2014年3月在上海东证期货研究所、国泰君安期货研究所担任量化投资研究员。2014年3月至2018年10月在中国工商银行总行贵金属业务部工作,历任产品研发经理、代客交易经理。2018年10月加入浦银安盛基金管理有限公司,参与ETF业务筹备工作。2019年3月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年7月起担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年9月起担任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021年7月起担任浦银安盛中

证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。高钢杰先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

(二)基金托管人

1、基本情况

名称:华夏银行股份有限公司  
住所:北京市东城区建国门内大街22号(100005)  
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)  
法定代表人:李民吉  
成立时间:1992年10月14日  
组织形式:股份有限公司  
注册资本:15387223983元人民币  
批准设立机关和设立文号:中国人民银行[银复(1992)391号]  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]25号  
联系人:郑鹏  
电话:(010)85238667  
传真:(010)85238680

2、基金托管部门及主要人员情况

华夏银行于2005年2月23日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核准,获得证券投资基金托管资格,是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来,华夏银行资产托管部本着“诚实信用、勤勉尽责”的行业精神,始终遵循“安全保管基金资产,提供优质托管服务”的原则,坚持以客户为中心的服务理念,依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验,严格履行法律和托管协议所规定的各项义务,为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理室、运营室、创新与产品室6个职能处室。资产托管部共有员工49人,高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

3、证券投资基金托管情况

截至2021年6月末,托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、保险资管计划、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计11021只,证券投资基金80只,全行资产托管规模达到57584.27亿元。

(三)上市推荐人

光大证券股份有限公司  
住所:上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人:刘秋明  
电话:021-2216 9999  
网址:www.ebscn.com  
客户服务电话:95525

(四)基金验资机构

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01

室

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:李丹  
电话:(021)23238888  
联系人:赵珏  
经办注册会计师:薛竞、赵珏

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要请见附件。

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2021年8月6日,本基金资产负债表如下(未经审计):

单位:人民币元

资产	2021年8月6日
资产:	
银行存款	332,474,067.86
结算备付金	1,624,090.91
存出保证金	-
交易性金融资产	12,831,942.00
其中:股票投资	12,831,942.00
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	157,367,574.35
应收利息	117,913.32
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	8,954.00
资产总计	504,424,542.44
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	-
应付赎回款	-

应付管理人报酬	41,477.81
应付托管费	8,295.57
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	17,668.80
负债合计	67,442.18
所有者权益:	
实收基金	504,337,807.00
未分配利润	19,293.26
所有者权益合计	504,357,100.26
负债和所有者权益总计	504,424,542.44

注:截至2021年8月6日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额504,337,807.00份。

## 八、基金投资组合

截至2021年8月6日,本基金的投资组合如下:

### 1. 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	12,831,942.00	2.54
	其中:股票	12,831,942.00	2.54
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	334,098,158.77	66.23
8	其他资产	157,494,441.67	31.22
9	合计	504,424,542.44	100.00

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。

### 2. 按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,210,634.00	2.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,350.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,000.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,926,918.00	0.38
J	金融业	677,040.00	0.13
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	12,831,942.00	2.54

### 3. 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	002371	北方华创	10,300	3,872,800.00	0.77
2	300450	先导智能	25,600	2,045,184.00	0.41
3	600570	恒生电子	36,900	1,926,918.00	0.38
4	603501	韦尔股份	6,000	1,853,820.00	0.37
5	600019	宝钢股份	151,000	1,126,460.00	0.22
6	002304	洋河股份	6,200	1,054,496.00	0.21
7	601336	XD新华保	12,000	465,840.00	0.09
8	601601	中国太保	8,000	211,200.00	0.04
9	600309	万华化学	1,000	112,500.00	0.02
10	600276	恒瑞医药	2,000	109,600.00	0.02

### 4. 按债券品种分类的债券投资组合

截至2021年8月6日,本基金未持有债券。

### 5. 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

截至2021年8月6日,本基金未持有债券。

### 6. 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

截至2021年8月6日,本基金未持有资产支持证券。

### 7. 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

截至2021年8月6日,本基金未持有贵金属。

### 8. 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

截至2021年8月6日,本基金未持有权证。

### 9. 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至2021年8月6日,本基金未持有股指期货。

### 10. 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至2021年8月6日,本基金未持有国债期货。

### 11. 投资组合报告附注

11.1 自基金合同生效日至2021年8月6日,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

11.3 其他资产构成

序号	类别	金额(元)
1	应付债券	
2	应付利息	157,362,275.20
3	应付股利	
4	其他应付款	117,913.52
5	其他流动资产	
6	其他资产	8,554.00
7	其他	-
8	其他	
9	其他	171,094,443.62

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
截至2021年8月6日,本基金未持有债券。  
11.5 报告期末前十名股票中持有流通受限情况的说明  
截至2021年8月6日,本基金前十名股票中不存在流通受限情况

### 九、重大事件提示

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

### 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理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》及其他法律法规、基金合同的约定,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、上海证券交易所的监督。  
(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承诺:  
(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的约定,设立专门的基金托管部,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。  
(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的约定,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算和支付等进行监督和复核。  
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的约定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。  
(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,并将纠正结果报告中国证监会。

### 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为光大证券股份有限公司  
上市推荐人就本基金上市交易事宜出具意见如下:  
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》规定的有关要求;  
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

下列文件存放在本基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。  
(一)中国证监会准予浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金注册的文件;  
(二)《浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;  
(三)《浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;  
(四)《浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;  
(五)《关于浦银安盛基金管理有限公司申请募集浦银安盛中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书》;  
(六)基金管理人业务资格证件、营业执照;  
(七)基金托管人业务资格证件、营业执照;  
(八)中国证监会要求的其他文件。

浦银安盛基金管理有限公司  
二〇二一年八月十日

### 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人的权利、义务  
(一)基金份额持有人的权利、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》当事人,且其在持有本基金基金份额期间,享有对本基金份额持有人的权利,并承担对本基金份额持有人的义务。  
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)依法转让或赠与时其持有的基金份额;  
(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,自主作出投资决策,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,并主动缴纳交易申请款项,并承担相应法律责任;  
(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金合同约定的《基金合同》终止的有限责任;  
(6)不得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决议;  
(8)返还基金交易过程中因任何原因获得的非正当利益;  
(9)提供基金管理人、基金托管人、基金服务机构依法要求提供的信息,以及及时的更新和补充,并保证真实、准确、完整;  
(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、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)担任或委托其符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记结算业务并获取《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、赎回与转换申请;  
(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、转换和非交易过户的业务规则;  
(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确保基金资产估值、基金份额认购价格、申购对价、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,不得向他人泄露,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、基金托管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簿、报表、记录和其他相关资料15年以上;  
(17)确需向基金投资者提供的各项文件或资料在限定时间发出,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情况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、《基金合同》和《托管协议》规定履行自己的义务,基金托管人违反法律法规、《基金合同》和《托管协议》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人处理时,应当对第三人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,募集期间网上股票认购所冻结的股票应予以解冻;  
(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。  
(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,依法依法律法规、《基金合同》和《托管协议》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,应及时向中国证监会、中国证监会派出机构和基金托管人报告;
- (4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、资金账户及其他投资所需账户,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,保证其所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、账目核对等方面相互独立;
- (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)保持与基金管理人、基金托管人的基金资产的账目核对,并及时作好记账凭证;
- (6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户,按照《基金合同》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》、《托管协议》及其他有关规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露,因审计、法律等外部专业顾问提供情况除外;
- (8)复核、审查基金管理人计算的基金净值信息、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宜;
- (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,说明基金管理人是否遵守法律法规及《基金合同》、《托管协议》的规定,信息披露是否真实、准确;对基金管理人未执行《基金合同》、《托管协议》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- (11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
- (12)以基金管理人或基金托管人的名义接收并保存基金份额持有人名册;
- (13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价;
- (15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- (16)按照法律法规、《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监管机构,并通知基金管理人;
- (19)因违反《基金合同》、《托管协议》导致基金财产损失的,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和《基金合同》、《托管协议》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,基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设立日常机构。  
未来,若本基金推出与本基金的联接基金,则:  
鉴于本基金和本基金的联接基金(即“浦银实盘中证ESG 120策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金”(暂定名,最终以中国证监会注册结果为准))以及基金管理人根据基金募集管理协议管理联接基金(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持有持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算基金份额持有人大会表决权时,联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决权数,在本基金基金份额持有人大会决议生效时,联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人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基金份额和本基金的前一基金份额拥有平等的表决权。  
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系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,须先通知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议生效后方可召开联接基金的基金份额持有人大会,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。

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的,以届时有效的法律法规为准。

### (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、《基金合同》或中国证监会另有规定的无需召开基金份额持有人大会的除外:
  - (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)调高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
  - (6)变更基金类别;
  - (7)本基金与其他基金的合并;
  - (8)变更基金投资目标、范围或策略;
  - (9)变更基金份额持有人大会程序;
  - (10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - (11)基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5000万元情形的,基金管理人提出持续运作、转换运作方式,或其他基金合同或者终止基金合同等解决方案;
  - (12)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)的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)终止基金份额的上市,但因本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)对基金合同当事人权利义务产生重大影响的其他事项;
  - (15)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,履行适当程序后无需召开基金份额持有人大会:
  - (1)法律法规要求增加的基金费用的收取;
  - (2)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;
  - (3)因相应法律法规、上海证券交易所或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)增加、取消或调整基金份额类别设置,对基金份额分类办法及规则进行调整;
  - (5)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;
  - (6)基金推出新业务或服务;
  - (7)基金管理人、相关证券交易所、登记机构、销售机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、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);
  - (8)在对基金份额净值和赎回费率无实质性不利影响的前提下,标的指数更名或调整指数编制方法,以及因此相应变更业绩比较基准;
  - (9)调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成;
  - (10)调整基金净值信息、申购赎回清单的内容、申购赎回清单的计算和公告的时间或频率;
  - (11)募集并管理以本基金为目标ETF的一只或多只联接基金,基金份额持有人申请上市交易,在其他证券交易所上市,调整场外申购赎回方式,开通跨系统转托管业务或暂停、停止场外申购赎回业务;
  - (12)调整基金的收益分配原则和支付方式;
  - (13)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (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,应当自书面提议之日起10日内召开基金份额持有人大会;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,并应当至少提前30日向中国证监会备案。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)、授权方式(包括但不限于纸质授权、电话授权、短信授权及网络授权方式等)、送达时间和地点;
  - (5)会务联系方式;
  - (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.采取通讯开会方式召开基金份额持有人大会的,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及投票方式(包括但不限于纸质投票、网络投票及短信投票等),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、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均有权出席,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会议:
    - (1)召集人需要通知的其他事项。
    - 2.采取通讯开会方式召开基金份额持有人大会的,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及投票方式(包括但不限于纸质投票、网络投票及短信投票等),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、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。

(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50%(含50%)。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50%,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,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,通讯开会的方式有效:

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

(4) 上条第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人所委托他人代表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,并与基金登记机构相符合。

在不违反法律法规和监管机构规定的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用网络、电话、短信或其他非书面方式向其授权代表进行授权。具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4. 在不违反法律法规和监管机构规定的情况下,经会议通知载明,本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与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

议事内容为本基金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》规定的其它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效力。

会议召集人应当推举出席会议人员的姓名、身份证号码、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。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》、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。

会议通讯方式表决时,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前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,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始前宣布在出席会议的基金份额持有人中选举一名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会,不影响计票效力。

(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,不影响计票效力。

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(若由基金管理人召集,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。

《信息披露办法》的有关规定在现媒介上公告。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或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容取消或变更的,基金管理人或基金托管人应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。

(十) 法律法规或监管机构另有规定的,基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金利润的定义

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. 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,基金管理人应计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算,计算结果参见《信息披露》。

2. 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能接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亏损为前提,收益分配后有可能使基金份额净值低于面值;

3. 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

4. 本基金收益分配方式采取现金分红方式;

5. 每一基金份额享有同等分配权;

6. 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

本基金每次收益分配方案详见届时基金管理人发布的公告。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下,基金管理人可对基金收益分配政策进行调整,此项调整无需召开基金份额持有人大会,但应于调整实施日前在指定媒介公告。

(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,按《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。

(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. 除法律法规、中国证监会另有规定外,《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事务所、律师费、审计费、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、期货交易费用或结算而产生的费用;

7. 基金的银行汇划费用;

8. 基金上市费用及年费;

9. 基金开户费和银行账户维护费;

10. 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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

2. 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%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为前一日基金资产净值

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

除管理费、托管费之外的基金费用,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. 基金管理人及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》生效前相关费用;
4. 标的指数许可使用费,指数许可使用费由基金管理人支付;
5. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各种纳税主体,其纳税义务按照国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

(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标的指数成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会注册发行的股票)、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、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、同业存单、股指期货等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)。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,本基金可将其纳入投资范围,其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金根据法律法规的规定,参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的90%,且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日终在扣除股指期货合约和国债期货合约保证金后,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。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行法定程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

(三)投资禁止行为与限制

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的90%,且不低于非现金基金资产的80%;
- (2) 本基金每个交易日终在扣除股指期货合约和国债期货合约保证金后,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;
- (3) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
- (4) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
- (5) 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%;
- (6) 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%;
- (7) 本基金管理人管理的余款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%;
- (8) 本基金投资于信用评级为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;
- (9) 本基金参与股指期货交易,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;
- (10) 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%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;
- (11) 本基金参与股指期货交易,则需遵守下列投资比例限制:

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

2) 本基金在任何交易日日终,持有的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;

3) 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%;

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) 本基金在任何交易日日内交易(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%;

12) 本基金参与转融通证券出借业务的,应当符合下列要求:

1) 参与转融通证券出借业务的资产,不得超过基金资产净值的30%,其中,出借期限在10个交易日以上的出借证券,纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围;

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过该证券有该证券总量的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;

(13) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(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) 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(2)、(3)、(8)、(12)、(14)项外,因证券市场波动、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以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。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以外的因素致使基金投资不符合第(12)项规定的,基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的,从其规定。

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

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

2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 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,但是法律法规或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) 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定或基金合同约定的其他投资。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行法定程序后,则本基金投资不再受相关限制。

3. 关联交易原则

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时,应当符合本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,按照公允市场价格执行,相关交易必须事先得到基金托管人同意,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或变更上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行,无需经基金份额持有人大会审议。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一)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。

(二)基金净值信息

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在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,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构和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、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)《基金合同》的变更

1. 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事由的,应当召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定或《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须经中国证监会备案,自表决通过之日起生效,决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

(二)《基金合同》的终止事由

- 有下列情形之一的,经履行法定程序后,《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. 基金财产清算小组成员:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3. 基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4. 基金财产清算程序:

- (1) 《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- (3) 对基金财产进行估值和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

5. 基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持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。

(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(上海国际仲裁中心),仲裁地点为上海,仲裁语言为中文。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,基金管理人及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约定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

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

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印刷成册,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。