

景顺长城恒生消费交易型开放式指数证 券投资基金（QDII）上市交易公告书

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

注册登记机构：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

公告日期：二〇二三年四月十八日

上市时间：二〇二三年四月二十一日

目 录

一、重要声明与提示	1
二、基金概览.....	2
三、基金的募集与上市交易	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	8
五、基金主要当事人简介.....	10
六、基金合同摘要	21
七、基金财务状况	22
八、基金投资组合	24
九、重大事件揭示	29
十、基金管理人承诺	30
十一、基金托管人承诺	31
十二、基金上市推荐人意见.....	32
十三、备查文件目录	33
附件：基金合同摘要	34

一、重要声明与提示

《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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，景顺长城基金管理有限公司（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。本基金托管人兴业银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2023 年 3 月 22 日披露于景顺长城基金管理有限公司网站（www.igwfm.com）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）的《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》和《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》（以下简称“招募说明书”）及后续更新。

二、基金概览

(一) 基金名称：景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

(二) 证券简称：恒生消费；扩位简称：恒生消费 ETF

(三) 基金代码、二级市场交易代码：513970

(四) 截至公告日前两个工作日（即 2023 年 4 月 14 日）基金份额总额：
647,041,000.00 份。

(五) 截至公告日前两个工作日（即 2023 年 4 月 14 日）基金份额净值：
0.9994 元。

(六) 本次上市交易份额：647,041,000.00 份。

(七) 上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

(八) 上市交易日期：2023 年 4 月 21 日。

(九) 基金管理人：景顺长城基金管理有限公司。

(十) 基金托管人：兴业银行股份有限公司。

(十一) 申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：

序号	销售机构全称
1	安信证券股份有限公司
2	东吴证券股份有限公司
3	方正证券股份有限公司
4	光大证券股份有限公司
5	广发证券股份有限公司
6	国盛证券有限责任公司
7	国泰君安证券股份有限公司
8	国信证券股份有限公司
9	海通证券股份有限公司
10	恒泰证券股份有限公司
11	华安证券股份有限公司
12	华创证券有限责任公司
13	华泰证券股份有限公司
14	江海证券有限公司
15	平安证券股份有限公司
16	申万宏源西部证券有限公司
17	申万宏源证券有限公司
18	兴业证券股份有限公司
19	长城证券股份有限公司
20	招商证券股份有限公司

21	中国国际金融股份有限公司
22	中国银河证券股份有限公司
23	中国中金财富证券有限公司
24	中泰证券股份有限公司
25	中信建投证券股份有限公司
26	中信证券（山东）有限责任公司
27	中信证券股份有限公司
28	中信证券华南股份有限公司

本公司可适时增加或调整申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

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准予注册文号：中国证监会证监许可[2023]351号文准予募集注册。

2、基金运作方式：契约型、交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：2023年3月27日至2023年4月7日。其中，网下现金认购的日期为2023年3月27日至2023年4月7日；网上现金认购的日期为2023年4月4日，2023年4月6日和2023年4月7日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售期限：网下现金认购9个工作日，网上现金认购3个工作日。

7、发售方式：网上现金认购和网下现金认购2种方式。

8、发售机构

（1）发售主协调人

中信建投证券股份有限公司

（2）网下现金发售直销机构

景顺长城基金管理有限公司

（3）网上现金发售代理机构

具有基金销售业务资格，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的证券公司（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

（4）网下现金发售代理机构

序号	销售机构全称
1	安信证券股份有限公司
2	国泰君安证券股份有限公司
3	华泰证券股份有限公司
4	平安证券股份有限公司
5	粤开证券股份有限公司
6	长江证券股份有限公司
7	招商证券股份有限公司
8	中国银河证券股份有限公司
9	中泰证券股份有限公司
10	中信建投证券股份有限公司

11	中信证券（山东）有限责任公司
12	中信证券股份有限公司
13	中信证券华南股份有限公司

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

本次募集扣除认购费后的有效净认购金额为 647,041,000.00 元人民币（含所募集股票市值），其中以现金方式认购的 647,041,000.00 份基金份额所对应的募集资本人民币 647,041,000.00 元，该资金已于 2023 年 4 月 12 日汇入开立于兴业银行股份有限公司的景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管专户。通过网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息为 125,966.97 元，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

本次募集有效认购户数为 3,703 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 0 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

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》、《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》和《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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 2023 年 4 月 12 日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2023 年 4 月 12 日

13、基金合同生效日的基金份额总额：647,041,000.00 份

（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[2023]84 号。

2、上市交易日期：2023 年 4 月 21 日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、本次上市交易的基金份额证券简称：恒生消费。

5、本次上市交易的基金扩位简称：恒生消费 ETF。

6、本次上市交易的基金份额交易代码：513970。

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。

7、本基金管理人自 2023 年 4 月 21 日开始办理本基金的申购和赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的申购赎回代理券商包括：

序号	销售机构全称
1	安信证券股份有限公司
2	东吴证券股份有限公司
3	方正证券股份有限公司
4	光大证券股份有限公司
5	广发证券股份有限公司
6	国盛证券有限责任公司
7	国泰君安证券股份有限公司
8	国信证券股份有限公司
9	海通证券股份有限公司
10	恒泰证券股份有限公司
11	华安证券股份有限公司
12	华创证券有限责任公司
13	华泰证券股份有限公司
14	江海证券有限公司
15	平安证券股份有限公司
16	申万宏源西部证券有限公司
17	申万宏源证券有限公司
18	兴业证券股份有限公司
19	长城证券股份有限公司
20	招商证券股份有限公司
21	中国国际金融股份有限公司
22	中国银河证券股份有限公司
23	中国中金财富证券有限公司
24	中泰证券股份有限公司
25	中信建投证券股份有限公司
26	中信证券（山东）有限责任公司
27	中信证券股份有限公司

28	中信证券华南股份有限公司
----	--------------

本公司可适时增加或调整申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

8、本次上市交易份额：**647,041,000.00** 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）持有人户数

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金份额持有人户数为 3703 户，平均每户持有的基金份额为 174,734.27 份。

（二）持有人结构

截至 2023 年 4 月 14 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 47,905,000.00 份，占基金总份额的 7.40%；个人投资者持有的基金份额为 599,136,000.00 份，占基金总份额的 92.60%。

本公司基金从业人员持有基金份额的总量为 0，占该只基金总份额的比例为 0%；

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至 2023 年 4 月 14 日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	郑玉环	7,000,000.00	1.08%
2	钱末仙	5,000,000.00	0.77%
3	上海鹤禧私募基金管理有限公司—鹤禧阿尔法一号私募证券投资基金	5,000,000.00	0.77%
4	深圳广源汇富私募证券投资基金管理有限公司—广源汇富势能转化 8 号私募证券投资基金	5,000,000.00	0.77%
5	深圳市荣保泰资本管理有限公司—保泰新丝路私募证券投资基金	5,000,000.00	0.77%
6	新余善思投资管理中心（有限合伙）—善思玺德一号私募证券投资基金	5,000,000.00	0.77%

7	张舰文	4,408,000.00	0.68%
8	陈磊	4,000,000.00	0.62%
9	郭楷	4,000,000.00	0.62%
10	姜润润	4,000,000.00	0.62%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：景顺长城基金管理有限公司

2、法定代表人：李进

3、总经理：康乐

4、注册资本：1.3 亿元人民币

5、注册地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

6、设立批准文号：中国证监会证监基金字【2003】76 号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码
91440300717869125N 号

8、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

9、股权结构：长城证券股份有限公司，持有股份 49%；景顺资产管理有限公司，持有股份 49%；开滦(集团)有限责任公司，持有股份 1%；大连实德集团有限公司，持有股份 1%。

10、内部组织结构及职能：

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。

公司设立了两个专门机构：风险管理委员会和投资决策委员会。风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司设置如下部门：股票投资部、固定收益部、混合资产投资部、量化及指数投资部、ETF 与创新投资部、国际投资部、养老及资产配置部、专户投资部、研究部、机构业务部、养老金业务部、零售业务部、互联网金融部、市场服务部、产品开发部、交易管理部、基金事务部、信息技术部、总经理办公室、风险管理部、人力资源部、财务行政部、法律监察稽核部。各部门的职责如下：

（1）股票投资部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内股票

选择和组合的投资管理。

(2) 固定收益部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行固定收益类标的选择和组合的投资管理，并完成固定收益的研究。

(3) 混合资产投资部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行固收加类产品的投资组合管理，并完成固收加类相关标的的研究。

(4) 量化及指数投资部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则，以严谨的量化投资流程为依托，进行各类主动量化、指数增强及 Smart Beta 产品的投资管理，并完成相关研究。

(5) ETF 与创新投资部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则，以严谨的投资流程为依托，进行各类资产类别的 ETF 及 ETF 联接、指数型、Smart Beta 及其他指数化创新型产品的投资管理和研究业务，并参与指数类业务相关的各类创新实践。

(6) 国际投资部：主要负责与 QDII、QFII 等国际业务相关的投资管理、国际合作和培训等业务。

(7) 养老及资产配置部：负责养老目标基金、FOF 基金投资研究及资产配置等相关业务。

(8) 专户投资部：负责完成一对一、一对多等特定客户资产管理产品的投资管理。

(9) 研究部：负责对宏观经济、行业公司及市场的研究。

(10) 机构业务部：负责开发和维护机构客户，并负责公司基金产品在机构客户中的销售。

(11) 养老金业务部：负责申请养老金业务资格，养老金客户拓展及销售，及其它养老金业务的服务及管理工作。

(12) 零售业务部：负责公司产品在各银行、券商等渠道的销售；总部业务部负责银行总行及券商总部的开发及关系维护，并负责公司产品在券商总部等渠道的销售。

(13) 互联网金融部：负责开发、维护及运营互联网金融业务的渠道及平台，以及互联网金融渠道及平台的基金销售工作。

(14) 市场服务部：负责公司市场营销策略、计划制定及推广，电子商务和

客户服务管理等工作。

(15) 产品开发部：负责基金产品及其他投资产品的设计、开发、报批等工作。

(16) 交易管理部：负责完成投资部下达的交易指令，并进行事前的风险控制。

(17) 基金事务部：负责公司产品的注册登记、清算和估值核算等工作。

(18) 信息技术部：负责根据信息技术治理委员会制定的信息技术规划，公司的计算机设备维护、系统开发、网络运行、信息安全保证及运维管理工作。

(19) 总经理办公室：主要受总经理委托，协调各部门的工作，负责公司日常经营性管理、办公秩序监督及项目跟进，并协助总经理进行公司整体战略的研究制定、实施与执行等。

(20) 风险管理部：负责基金业绩评价及分析、风险评估、控制及管理。

(21) 人力资源部：负责公司各项人力资源管理工作，包括招聘、薪资福利、人才发展、绩效管理、培训、员工关系、企业文化、从业资格管理、高管及基金经理资格管理等。

(22) 财务行政部：负责公司财务管理及日常行政事务管理。

(23) 法律监察稽核部：负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核，并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。公司已经建立了健全的内部控制制度、内部稽核制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

11、人员情况：

截至 2023 年 3 月 31 日，公司现有员工 356 人，其中 281 人具有硕士及以上学历。

12、信息披露负责人：杨皦阳

电话：0755—82370388

13、基金管理业务情况简介：

截至 2023 年 3 月 31 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 169 只开放式基金和多只特定客户资产管理计划，产品类型较为完备且涵盖高中低各类风险等级。

14、本基金基金经理

汪洋先生，理学硕士。曾任美国 KeyBank 利率衍生品部首席数量分析师，华泰联合证券股份有限公司金融工程部高级研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，汇添富基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理，博时基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理兼基金经理。2021 年 10 月加入本公司，现任 ETF 与创新投资部总经理、基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。

本基金基金经理汪洋先生兼任景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城纳斯达克科技市值加权指数发起式证券投资基金（QDII）、景顺长城创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金及景顺长城创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

（二）基金托管人情况

1、基金托管人概况

（1）基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证

券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。截至 2021 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 8.60 万亿元，实现营业收入 2212.36 亿元，同比增长 8.91%，全年实现归属于母公司股东的净利润 826.80 亿元。

开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

3、托管业务部部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、基金证券业务处、信托保险业务处、理财私募业务处、产品管理处、稽核监察处、投资监督管理处、运行管理处等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2022 年 9 月 30 日，兴业银行共托管证券投资基金 617 只，托管基金的基金资产净值合计 24055.27 亿元，基金份额合计 23181.41 亿份。

（三）上市推荐人

名称：长城证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层长城证券

法定代表人：张巍

联系人：刘秉鑫

客户服务电话：95514

（四）一级交易商

序号	销售机构全称	销售机构信息
1	安信证券股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦 法定代表人：黄炎勋 联系人：郑向溢、彭洁联 电话：0755-81682517、0755-81682531 客服电话：95517/4008-001-001

		网址: http://www.essence.com.cn/
2	东吴证券股份有限公司	注册地址: 苏州工业园区星阳街 5 号 办公地址: 苏州工业园区星阳街 5 号 法定代表人: 范力 联系人: 陆晓 电话: 0512-62938521 传真: 0512-62938527 客户服务电话: 95330 网址: www.dwzq.com.cn
3	方正证券股份有限公司	注册地址: 湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 2701-3717 办公地址: 湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 2701-3717 法定代表人: 施华 联系人: 胡创 电话: 010-5699 2402 传真: 010-5699 2426 客服热线: 95571 网址: www.foundersc.com
4	光大证券股份有限公司	注册地址: 上海市静安区新闸路 1508 号 办公地址: 上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人: 刘秋明 联系人: 郁疆 电话: 021-22169999 客户服务电话: 95525 网址: www.ebscn.com
5	广发证券股份有限公司	注册地址: 广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址: 广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 法定代表人: 林传辉 客服电话: 95575、020-95575 或致电各地营业网点 网址: www.gf.com.cn
6	国盛证券有限责任公司	注册地址: 江西省南昌市新建区子实路 1589 号 办公地址: 南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼 法定代表人: 徐丽峰 联系人: 占文驰 电话: 0791-88250812 客户服务电话: 956080 网址: www.gszq.com
7	国泰君安证券股份有限公司	注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

		办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦 法定代表人：贺青 联系人：钟伟镇 联系电话：021-38032284 服务热线：021-38676666 网址：www.gtja.com
8	国信证券股份有限公司	注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 法定代表人：张纳沙 联系人：李颖 电话：0755-82130833 客户服务电话：95536 网址：www.guosen.com.cn
9	海通证券股份有限公司	注册（办公）地址：上海市广东路 689 号 法定代表人：周杰 联系人：李笑鸣 电话：021-23219000 传真：021-23219100 客服电话：95553 网址：www.htsec.com
10	恒泰证券股份有限公司	注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼 办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼 法定代表人：祝艳辉 联系人：熊丽 电话：0471-4972675 传真：无 客户服务电话：956088 网址：www.cnht.com.cn
11	华安证券股份有限公司	注册（办公）地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 法定代表人：章宏韬 联系人：范超 电话：0551-65161821 传真：0551-65161825 客户服务电话：95318 网址：www.hazq.com
12	华创证券有限责任公司	注册地址：贵州省贵阳市中华北路 216 号 办公地址：贵州省贵阳市中华北路 216 号 法定代表人：陶永泽

		联系人：程剑心 电话：18698005056 传真：0851-8-6850539 客户服务电话：95513 网址：http://www.hczq.com/
13	华泰证券股份有限公司	注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号 办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场；广东省深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 10 楼 法定代表人：张伟 联系人：庞晓芸 电话：0755-82492193 客户服务电话：95597 网址：www.htsc.com.cn
14	江海证券有限公司	注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号 法定代表人：赵洪波 联系人：周俊 电话：0451-85863726 传真：0451-82337279 客户服务电话：956007 网址：www.jhzq.com.cn
15	平安证券股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层 法人代表：何之江 联系人：李倩倩 客户服务电话：95511-8 网址：http://stock.pingan.com
16	申万宏源西部证券有限公司	注册（办公）地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室 法定代表人：王献军 联系人：梁丽 联系电话：0991-2307105 客户服务电话：95523、4008895523 传真：010-88085195 网址：www.swhysc.com
17	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层 法定代表人：杨玉成 联系人：陈宇 联系电话：021-33388999 客户服务电话：95523、4008895523 传真：021-33388224

		网址: www.swhysc.com
18	兴业证券股份有限公司	注册地址: 福州市湖东路 268 号 办公地址: 上海市浦东新区长柳路 36 号 法定代表人: 杨华辉 联系人: 乔琳雪 联系电话: 021-38565547 传真: 0591-38507538 客户服务电话: 95562 网址: www.xyzq.com.cn
19	长城证券股份有限公司	注册(办公)地址: 深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼 10-19 层长城证券 法定代表人: 张巍 联系人: 陈静 联系电话: 0755-83558761 客户服务电话: 95514 网址: www.cgws.com
20	招商证券股份有限公司	注册(办公)地址: 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 法定代表人: 霍达 联系人: 黄婵君 电话: 0755-82943666 传真: 0755-83734343 客户服务电话: 400-8888-111, 95565 网址: www.newone.com.cn
21	中国国际金融股份有限公司	注册(办公)地址: 北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层 法定代表人: 沈如军 联系人: 杨涵宇 电话: 010-65051166 客户服务电话: 400 910 1166 网址: www.cicc.com.cn
22	中国银河证券股份有限公司	办公地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦 注册地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101 邮编: 100073 法定代表人: 陈亮 客服电话: 4008-888-888、95551 联系人: 辛国政 电话: 010-80928123 公司网址: www.chinastock.com.cn
23	中国中金财富证券有限公司	注册地址: 深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-4608 办公地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣

		超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 法人代表：高涛 客服电话：95532 公司网站： https://www.ciccwm.com/ciccwmweb/
24	中泰证券股份有限公司	注册（办公）地址：济南市市中区经七路 86 号 法定代表人：李峰 联系人：刘洋 电话：021-20315085 客户服务电话：95538 网址： www.zts.com.cn
25	中信建投证券股份有限公司	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 办公地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层 法定代表人：王常青 联系人：陈海静 电话：(010) 85156499 客户服务电话：4008888108/95587 网址： www.csc108.com
26	中信证券（山东）有限责任公司	注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 法定代表人：陈佳春 联系人：赵如意 联系电话：0532-85725062 客户服务电话：95548 网址： sd.citics.com
27	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：王一通 电话：010-60838888 传真：010-60833739 客服电话：95548 网址： www.cs.ecitic.com
28	中信证券华南股份有限公司	注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 法定代表人：胡伏云 联系人：宋丽雪 联系电话：020-88836999 客户服务电话：95548

		传真：020-88836984 网址：www.gzs.com.cn
--	--	--------------------------------------

（五）基金验资机构

法定名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：单峰、郭劲扬

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

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

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至 2023 年 4 月 14 日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
	2023 年 4 月 14 日
资 产：	
银行存款	546,487,874.36
结算备付金	100,688,263.97
存出保证金	-
交易性金融资产	191,034,978.37
其中：股票投资	191,034,978.37
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	838,211,116.70
负债和净资产	本报告期末

	2023 年 4 月 14 日
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	-
应付清算款	191,347,783.41
应付赎回款	-
应付管理人报酬	17,724.40
应付托管费	5,317.32
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	155,781.09
负债合计	191,526,606.22
净资产：	
实收基金	647,041,000.00
其他综合收益	-
未分配利润	-356,489.52
净资产合计	646,684,510.48
负债和净资产总计	838,211,116.70

注：1、截至 2023 年 4 月 14 日，基金份额净值 0.9994 元，基金份额总额 647,041,000.00 份。

2、本报告期自 2023 年 4 月 12 日起至 2023 年 4 月 14 日止。本基金合同于 2023 年 4 月 12 日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

本基金目前仍处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

截至 2023 年 4 月 14 日，景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的投资组合如下：

（一）期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	191,034,978.37	22.79
	其中：普通股	191,034,978.37	22.79
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	647,176,138.33	77.21
8	其他资产	-	-
9	合计	838,211,116.70	100.00

注：基金管理人将在上市前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约定。

（二）期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	191,034,978.37	29.54
合计	191,034,978.37	29.54

（三）报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

1. 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
原材料	243,178.98	0.04
周期性消费品	101,824,777.41	15.75
非周期性消费品	69,014,038.29	10.67
综合	-	-
能源	-	-
金融	-	-
基金	-	-
工业	17,484,248.61	2.70
信息科技	-	-
公用事业	-	-
通讯	2,468,735.08	0.38
合计	191,034,978.37	29.54

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

2. 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

（四）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股票及存托凭证投资明细

1. 报告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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量(股)	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Anta Sports Products Ltd.	安踏体育	02020 HS	深港通联合市场	中国香港	203,000	20,066,198.61	3.10
2	Yum China Holdings, Inc.	百胜中国	09987 HS	深港通联合市场	中国香港	42,250	18,555,353.94	2.87
3	Li Ning Company Limited	李宁	02331 HS	深港通联合市场	中国香港	329,500	17,336,378.24	2.68
4	Techtronic Industries Co. Ltd.	创科实业	00669 HS	深港通联合市场	中国香港	233,500	16,856,732.53	2.61
5	Nongfu Spring Co., Ltd.	农夫山泉	09633 HS	深港通联合市场	中国香港	301,000	11,312,052.57	1.75
6	China Mengniu Dairy Company Limited	蒙牛乳业	02319 HS	深港通联合市场	中国香港	315,000	9,222,779.48	1.43
7	Shenzhou	申洲国际	02313	深港通联合市场	中国香港	123,600	9,138,928.87	1.41

	International Group Holdings Limited		HS	合市场	港			
8	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒	00291 HS	深港通联 合市场	中国香港	164,000	8,929,730.63	1.38
9	Haier Smart Home Co.,Ltd.	海尔智家	06690 HS	深港通联 合市场	中国香港	364,800	7,763,548.29	1.20
10	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒 股份	00168 HS	深港通联 合市场	中国香港	94,000	6,864,055.26	1.06

2.报告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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合
截至 2023 年 4 月 14 日，本基金未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金未持有债券。

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

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金未持有资产支持证券。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金未持有金融衍生品。

(九)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基金投资
明细

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金未持有基金投资。

(十)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. 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池。

3. 本基金截止 2023 年 4 月 14 日，其他资产构成如下：

无。

4. 持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5. 基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

1) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

2) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2023 年 4 月 14 日，本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

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

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

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

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

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

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，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，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长城证券股份有限公司。

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

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会准予景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集注册的文件

（二）《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》

（三）《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

（四）《景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

（八）中国证监会要求的其他文件

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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 4 月 18 日

附件：基金合同摘要

景顺长城恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

基金合同内容摘要

（基金合同条款及内容应以基金合同正本为准）

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

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参与

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、基金合同、相关证券交易所及登记机构相关业务规则的规定的的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、收益分配等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（17）选择、更换或撤销境外投资顾问、境外证券服务机构；

（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；计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因向审计、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) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资人申购或赎回之基金份额的投资人应收对价；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不少于法定最低期限；

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集的认购款项连同认购款项的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) 委托境外证券服务机构代理买卖证券的,应当严格履行受信责任,并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理;

(28) 与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排,应当严格按照《试行办法》第三十条规定的原则进行;

(29) 进行境外证券投资,应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定;

(30) 确保境外证券投资项下资金累计净汇出额不得超过外管局批准的境外证券投资额度;

(31) 法律法规、中国证监会及外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户和期货结算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) 选择、更换或撤销境外托管人并为之签署有关协议;

(8) 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、证券账户和期货结算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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、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不少于法定最低期限；

(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；
- (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》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责；境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致的基金财产受损的，基金托管人承担相应责任；在决定境外托管人是否存在过错、疏忽等不当行为时，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议适用法律及当地的法律法规、证券市场惯例决定；
- (23) 保护基金份额持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、外管局报告；
- (24) 按照监管规定每月结束后 10 个自然日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；
- (25) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
- (26) 基金托管人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资

金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于法定最低期限；

(27) 及时将公司行为信息通知基金管理人；

(28) 法律法规、中国证监会及外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购款项、应付申购对价和赎回对价及《基金合同》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) 遵守基金管理人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

(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、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以增设日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

(二) 若以本基金为目标基金且基金管理人和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金的基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基

金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（三）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （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。但根据法律法规或中国证监会的要求调整该等报酬标准的除外；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （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，但被上海证券交易所决定终止上市的除外；
- （13）对《基金合同》当事人权利、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) 调整基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;
- (3) 因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定,应当对《基金合同》进行修改;
- (4) 基金管理人、证券交易所、登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、收益分配、非交易过户等业务的规则(包括但不限于申购赎回清单的调整、开放日及开放时间的调整等);
- (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) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成;
- (7) 调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率;
- (8) 本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回;
- (9) 增加、减少、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、开通或终止人民币以外的其他币种的申购、赎回及相应业务规则调整;
- (10) 基金推出新业务或服务;
- (11) 按照本基金合同的约定,变更本基金的标的指数和基金名称、调整业绩比较基准;
- (12) 按照法律法规或《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(四) 会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集;
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集;
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合;
- 4、代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要

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

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

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

（五）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

（六）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连

续公布相关提示性公告；

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

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额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，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行，且除书面授权外，基金份额持有人之间的授权亦可根据召集人在大会通知中规定的方式，通过电话、网络等方式进行。

(七) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第九条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

(2) 通讯开会

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

(八) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时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投资者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。

（九）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进

行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（十）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（十一）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）收益分配原则

1、每份基金份额享有同等分配权；

2、基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率（使用估值汇率折算，下同）达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；

3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：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；

4、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，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

- 5、本基金收益分配方式为现金分红；
- 6、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 7、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性不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

（二）基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率。

基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）。

即：

基金份额净值增长率

$$= \left(\frac{\text{收益评价日基金份额净值}}{\text{基金上市前一日基金份额净值}} - 1 \right) * 100\%$$

（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）

标的指数同期增长率

$$= \left(\frac{\text{收益评价日标的指数收盘值}}{\text{基金上市前一日标的指数收盘值}} - 1 \right) * 100\%$$

（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）

截至收益评价日基金份额净值增长率减去标的指数同期增长率的差额超过 1%时，基金管理人可以进行收益分配。

2、当基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，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确定收益分配数额。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）收益分配方案的确定与公告

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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（五）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

四、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费，含境外托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金上市费及年费、注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 7、因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等）；
- 8、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 9、证券、期货结算账户开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用（基金托管人及境外托管人垫付资金所产生的合理费用）；
- 12、基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；

13、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；

14、按照国家有关规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，基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式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 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

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，基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式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、上述“一、基金费用的种类”中第 3—14 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、标的指数许可使用费，本基金的标的指数许可使用费由基金管理人承担；
- 5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照中国或所投资市场所在国家或地区的法律法规的规定履行纳税。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中国或所投资市场所在国家或地区有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金资产的投资范围和投资限制

（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，以期获得与标的指数收益相似的回报。

（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。其余资产可投资于其他金融产品或工具：

境外投资工具包括：已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

境内投资工具包括：本基金可少量投资于部分非成份股（包含港股通标的股票、主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、衍

生工具（股指期货、股票期权）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或港股通机制投资香港市场股票。

本基金为对冲外币的汇率风险，可以投资于境外外汇远期合约、结构性外汇远期合约、外汇期权及外汇期权组合、外汇互换协议、与汇率挂钩的结构性投资产品等金融工具。

本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

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。

基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产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，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资策略

本基金采用完全复制的被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或者因法律法规限制时，或其他原因导致无法有效负责和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合管理进行适当性变更和调整，力争降低跟踪误差。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整、港股通交易机制

等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于标的指数的成份股、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%，金融衍生品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。

2、股票投资策略

（1）股票投资组合构建

本基金原则上将采用完全复制法构建股票投资组合，以拟合、跟踪标的指数的收益表现。

（2）股票投资组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据标的指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行实时调整。

1) 定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

2) 不定期调整

① 当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；

② 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

③ 特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

上述特殊情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份

股长期停牌；③标的指数成份股流动性严重不足；④成份股上市公司存在重大违规行为，有可能面临重大的处罚或诉讼。

（3）本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

（4）本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

3、金融衍生品投资策略

（1）境内金融衍生品投资策略

1) 股指期货投资策略

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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

2) 股票期权投资策略

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他股票期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

（2）境外金融衍生品投资策略

为更好地实现本基金的投资目标，本基金将在条件允许的情况下投资于远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品，以期降低跟踪误差水平。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的金融衍生品进行交易。

为了更好地跟踪标的指数，本基金还可通过投资外汇期货、外汇远期、外汇互换等来管理基金投资以及应对申购赎回过程中的汇率风险。

4、目标基金投资策略

本基金基于控制投资组合跟踪误差于流动性管理的需要，可能投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以标的指数为投资标的的指数基金（包括ETF）。本基金将通过考量基金的跟踪误差、规模、流动性、基金费用等因素，精选基金进行投资。

5、债券投资策略

出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。

此外，为更好地实现投资目标，增加基金收益，弥补基金运作成本，本基金在控制风险的前提下还将参与境外回购交易、境外证券借贷交易等投资。

6、存托凭证投资策略

本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

7、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。此外，本基金可根据届时有有效的法律法规和监管机构的有关规定开展融券业务。

为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

未来，随着全球市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改

变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数的成份股、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）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（1）、（3）、（4）项规定的投资比例的，基金管理人应当 30 个交易日内进行调整；不符合上述第（2）、（5）项规定的投资比例的，基金管理人应当 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。

（6）本基金境外投资组合应遵循以下限制：

1）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的 20%，在基金托管账户的存款可以不受上述限制；

2）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%；

3）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，持有货币市场基金可以不受上述限制；

4）本基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%；

5) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%;

6) 本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%，前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产;

7) 境外金融衍生品投资

本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：

- i) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%;
- ii) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%;
- iii) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：
 - ①所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；
 - ②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；
 - ③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。
- iv) 基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告；
- v) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

8) 本基金可以参与境外证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

- i) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；
- ii) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%;
- iii) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处

置担保物以满足索赔需要；

iv) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

①现金；

②存款证明；

③商业票据；

④政府债券；

⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证；

v) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券；

vi) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

9) 基金可以根据正常市场惯例参与境外正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

i) 所有参与正回购交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

ii) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；

iii) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；

iv) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要；

v) 基金管理人应当对本基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

10) 本基金参与境外证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过本基金总资产的 50%。

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、

现金不得计入基金总资产。

本基金投资境外投资组合的，除上述第（6）项的 5）、7）、8）、9）、10）外，若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓，以符合投资比例限制要求，但中国证监会规定的特殊情形除外。

（7）本基金境内投资组合应遵循以下限制：

1）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%；

2）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%；

3）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%；

4）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%；

5）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；

6）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；

7）本基金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，债券回购到期后不展期；

8）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

i) 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%；

ii) 本基金在任何交易日日终，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；

iii) 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本基金持有的股票总市值的 20%；

iv) 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；

v) 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%；

vi) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、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；

9) 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股票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；

10) 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%；

11) 本基金参与转融通证券出借业务，应当遵守以下交易限制：

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

11.2 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

11.3 最近 6 个月内日均基金资产净值不低于 2 亿元；

11.4 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；

12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

13) 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；

14) 本基金投资境内发行的存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

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。

本基金投资境内投资组合的，除上述第（7）项的 5）、11）、12）、13）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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第（7）项的 11）项规定的，基金管理人不得新增转融通证券出借业务。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、投资策略应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按照调整后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）购买不动产；
- （2）购买房地产抵押按揭；
- （3）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （4）购买实物商品；
- （5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- （6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （7）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （8）承销证券；
- （9）不公平对待不同客户或不同投资组合；
- （10）除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料；
- （11）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （12）从事承担无限责任的投资；
- （13）向其基金管理人、基金托管人出资；

- (14) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (15) 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；
- (16) 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，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

（五）标的指数和业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：恒生消费指数收益率（使用估值汇率折算）。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（六）风险收益特征

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

此外，本基金主要投资于香港等境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及香港等境外市场的风险。

（七）基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

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款项以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金净值信息

《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在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在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，基金管理人应当在不晚于每个交易日/开放日的次日，通过其规定网站、基金销售机构网站或营业网点披露交易日/开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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表决通过之日起生效，生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，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、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剩余财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易单元保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规规定的期限。

八、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同各方当事人应尽量通过协商、调解途径解决。如经友好协商、调解未能解决的，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，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》适用中华人民共和国法律（不含港澳台立法）并从其解释。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》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。