

广发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：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2023 年 8 月 23 日

公告日期：2023 年 8 月 18 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	3
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人	5
五、	基金主要当事人简介	6
六、	基金合同摘要	11
七、	基金财务状况	11
八、	基金投资组合	12
九、	重大事件揭示	16
十、	基金管理人承诺	16
十一、	基金托管人承诺	16
十二、	备查文件目录	17
附件：	基金合同摘要	18

一、 重要声明与提示

《广发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》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，广发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”）的管理人广发基金管理有限公司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。本基金托管人中国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。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2023年7月24日刊登在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）及广发基金管理有限公司网站（www.gffunds.com.cn）上的《广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式指数基金，特定风险还包括：标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、参与转融通证券出借业务的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险等等。本基金还面临投资股指期货、股票期权、资产支持证券等特定品种的特有风险。

本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数恒生消费指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。此外，本基金投资境外市场，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境外市场的风险。

《基金合同》生效后，若连续50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5000万元情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会，本基金面临终止清盘的风险。根据《基金合同》约定，在

《基金合同》生效后，若连续 30、40、45 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人将发布提示性公告。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所及登记结算机构的相关业务规则，确保具备相关专业知识后方可参与本基金的申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及现金替代、现金差额等相关的交收方式已经认可。

当基金资产规模接近或达到外汇额度使用上限时，基金管理人有权暂停基金的申购，届时投资者可能面临申购失败的风险和基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。

根据本基金现行适用的清算交收和申赎处理规则，投资者当日申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回，即 T 日申购的 ETF 份额且日间完成 RTGS（实时逐笔全额结算）交收，T 日可卖出与赎回，而 T 日申购的 ETF 份额且日终完成逐笔全额非担保交收的，T+1 日方可卖出和赎回；T 日竞价买入的基金份额，T 日可以赎回或卖出。由于登记结算机构对现金替代采取非净额结算交收模式，当投资者赎回申请被登记结算机构确认后，被赎回的基金份额即被记减，但此时投资者尚未收到赎回现金替代款。投资者投资本基金时需具有证券账户，证券账户是指深圳证券交易所 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本基金由广发基金管理有限公司独立管理，未聘请境外投资顾问。

投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》《基金产品资料概要》及《基金合同》，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

二、 基金概览

- 1、基金名称：广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
- 2、场内简称：恒生消费ETF
- 3、基金代码：159699
- 4、2023年8月16日基金份额总额：846,164,255.00份
- 5、2023年8月16日基金份额净值：0.9831
- 6、本次上市交易份额：846,164,255.00份
- 7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

8、上市交易日期：2023年8月23日

9、基金管理人：广发基金管理有限公司

10、基金托管人：中国银行股份有限公司

11、基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

12、申购、赎回代办券商：

国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华金证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、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（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司（以上排名无先后顺序）。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，基金管理人将另行公告。基金管理人可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时公告。

三、 基金的募集与上市交易

（一） 本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可（2023）744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、发售方式：投资者可选择网下现金认购和网上现金认购2种方式。

5、发售日期：自2023年7月31日至2023年8月4日进行发售，共5个工作日。

6、发售价格：人民币1.00元。

7、发售机构

（1）网下现金发售直销机构

广发基金管理有限公司

（2）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深圳证券交易所会员单位办理，具体名单如下：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、诚通证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国新证券、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华泰证

券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、网信证券、五矿证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）

（3）网下现金发售代理机构：长江证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司等代销机构（以上排名不分先后，具体名单详见本基金相关公告）。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

9、募集资金总额及入账情况

本基金于2023年7月31日起公开募集，基金募集工作已于2023年8月4日顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本基金首次募集的资金现金部分合计为人民币846,125,000.00元。其中，首次募集期间现金有效认购资金扣除认购费用后的净认购金额为846,125,000.00元；通过管理人进行的网下现金有效认购资金在首次募集期间产生的利息折份额金额为人民币0.00元。上述资金已于2023年8月9日划至在中国银行股份有限公司开立的托管账户。另外，通过发售代理机构进行网上现金认购的有效认购资金在首次募集期内产生的利息折份额金额人民币39,255.00元，将于银行的下一季度结息日（2023年9月21日）后作为基金财产划付至上述托管账户。

本次募集有效认购户数为7,987户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次以现金认购方式收到首次募集有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币846,125,000.00元，折合846,125,000.00份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币39,255.00元，折合39,255.00份基金份额。以上收到的资金共计人民币846,164,255.00元，折合846,164,255.00份基金份额。基金管理人的基金从业人员未认购本基金，符合《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》《关于基金从业人员投资证券投资基金有关事项的规定》规定的基金合同生效的相关条件。

10、募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》《广发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8月10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。

11、基金合同生效日：2023年8月10日

12、基金合同生效日的基金份额总额：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846,164,255.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

（二）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2023]747号。

2、上市交易日期：2023年8月23日。

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

4、基金场内简称：恒生消费ETF。

5、基金代码：159699。

投资者在深圳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、本次上市交易份额：846,164,255.00份。

7、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。

8、基金净值的披露：

基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金上市交易后，基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深圳证券交易所，深圳证券交易所于每个估值日的下一个工作日通过行情系统揭示。

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8月16日，本基金份额持有人户数为7,938户，平均每户持有的基金份额106,596.66份。

（二） 持有人结构

截至2023年8月16日，本基金份额持有人结构如下：

个人投资者持有的基金份额为786,251,967.00份，占基金总份额的92.92%；

机构投资者持有的基金份额为59,912,288.00份，占基金总份额的7.08%。

（三）截至 2023 年 8 月 16 日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占基金份额的比例
1	长城证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	6,320,269.00	0.75%

2	黄良驹	5,000,291.00	0.59%
3	李焕芝	4,000,077.00	0.47%
4	中泰证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	3,443,258.00	0.41%
5	华峥亮	3,007,233.00	0.36%
6	张西勇	3,000,233.00	0.35%
7	熊立武	3,000,204.00	0.35%
8	潘英杰	3,000,058.00	0.35%
9	卓臻（深圳）私募证券基金管理有限公司一牛牛优选卓臻二十号私募证券投资基金	2,998,145.00	0.35%
10	张士江	2,228,043.00	0.26%

五、 基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况

名称：广发基金管理有限公司

法定代表人：孙树明

总经理：王凡

注册资本：14,097.8万元人民币

注册地址：广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2003]91号

工商登记注册的法人营业执照文号：914400007528923126

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

2、股东及其出资比例

股东名称	出资比例
广发证券股份有限公司	54.533%
烽火通信科技股份有限公司	14.187%
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	14.187%
广州科技金融创新投资控股有限公司	7.093%
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	3.87%

嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	2.23%
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.55%
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.19%
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.16%
合 计	100%

3、内部组织结构及职能

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规要求，建立组织架构健全、职能划分明晰、制衡监督有效、内部运作协调、激励约束合理的公司治理架构，保持公司规范运作，保护基金份额持有人利益。公司设置了健全、清晰的组织架构，并根据业务需要进行了合理的职能分工。

公司组织架构主要分为投研条线、市场条线和中后台条线。其中，投研条线包括主动权益、指数投资、量化投资、固定收益投资、国际投资、资产配置、宏观策略、行业研究等职能部门，负责按各自专业分工开展投资研究、投资管理等工作。市场条线包括产品设计、零售业务、机构业务、互联网金融业务、养老金业务、战略与创新业务等职能部门，负责按各自所属客户群体开展产品设计、客户推广和客户服务等工作；中后台条线包括风险管理板块、业务支持板块和管理支持板块，上述板块包含相应职能部门，风险管理板块主要负责投资、产品与市场、运营方面的合规管理、内审稽核、投资风险管理及数据服务等工作，业务支持板块主要负责信息安全与运维、系统开发、数据平台研发、组合交易、会计与结算、注册登记等工作，管理支持板块主要负责规划研究、财务管理、人力行政等工作。

4、基金管理业务情况

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，广发基金管理有限公司于2003年8月5日成立。公司及旗下子公司目前拥有公募基金管理、社保基金境内委托投资管理人、基本养老保险基金证券投资基金管理机构、特定客户资产管理、基金投资顾问、QDII、RQFII、QFII、QDLP、受托管理保险资金投资管理人和保险保障基金委托资产管理投资管理人等业务资格，是具备综合资产管理能力与经验的大型基金管理公司。

公司坚持“专业创造价值、客户利益为上”的理念，致力成为多资产、多策略、多市场的领先全能资产管理机构，为投资者创造长期、稳定、可持续的回报，为我国资本市场的繁荣与发展贡献力量。

5、信息披露负责人：程才良

咨询电话：020-83936666

6、截止2023年7月31日，广发基金管理有限公司总人数895人，其中博士学位27人、硕

士学位616人和学士学位220人。

7、本基金基金经理

刘杰先生，工学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理，广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理(自2014年4月1日起任职)、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日起任职)、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年4月25日起任职)、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2017年5月25日起任职)、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金经理(自2022年4月1日起任职)、广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理(自2022年4月27日起任职)、广发中证香港创新药交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理(自2022年7月1日起任职)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2022年11月15日起任职)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2022年11月16日起任职)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2022年11月16日起任职)、广发北证50成份指数型证券投资基金基金经理(自2022年12月28日起任职)、广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)基金经理(自2023年3月8日起任职)、广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理(自2023年8月10日起任职)。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日至2016年1月17日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2018年4月25日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自2017年8月4日至2018年11月30日)、广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2016年1月25日至2019年11月14日)、广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2019年11月14日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2019年11月14日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2016年8月30日至2019年11月14日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2016年9月26日至2019年11月14日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年1月25日至2019年11月14日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2018年4月26日至2019年11月14日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自

2018年8月6日至2020年2月28日)、广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2020年5月21日至2021年7月2日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自2018年8月6日至2021年9月16日)、广发粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2019年12月16日至2021年9月16日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2019年9月20日至2021年11月17日)、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2019年11月6日至2021年11月17日)、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日至2022年3月31日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自2019年5月9日至2022年4月28日)、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年8月20日至2023年2月22日)、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2016年1月18日至2023年2月22日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自2021年8月11日至2023年3月7日)。

(二) 基金托管人

1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托

管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3、证券投资基金托管情况

截至2023年6月30日，中国银行已托管1053只证券投资基金，其中境内基金1002只，QDII基金51只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

4、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

5、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

（三）验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

法人代表：毛鞍宁

联系电话：020-28812888

传真：020-28812618

经办注册会计师：昌华、黄浩松

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

截至公告日前两个工作日即 2023 年 8 月 16 日，本基金的资产负债表（未经审计）如下：

金额单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资 产：		负债：	
银行存款	491,032,556.46	短期借款	-
结算备付金	272,798,484.74	交易性金融负债	-
存出保证金	38,008,047.80	衍生金融负债	-
交易性金融资产	419,727,239.35	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	419,727,239.35	应付证券清算款	389,300,215.36
基金投资	-	应付赎回款	-
债券投资	-	应付管理人报酬	69,418.48
资产支持证券投资	-	应付托管费	13,883.70
贵金属投资	-	应付销售服务费	-
其他投资	-	应付投资顾问费	-
衍生金融资产	-	应交税费	-
买入返售金融资产	-	应付利息	-
应收证券清算款	-	应付利润	-
应收股利	-	递延所得税负债	-
应收申购款	-	其他负债	399,336.66
递延所得税资产	-	负债合计	389,782,854.20
其他资产	100,415.71	所有者权益：	
-	-	实收基金	846,164,255.00

-	-	未分配利润	-14,280,365.14
-	-	所有者权益合计	831,883,889.86
资产总计：	1,221,666,744.06	负债和所有者权益总计	1,221,666,744.06

八、 基金投资组合

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

截至公告日前两个工作日即 2023 年 8 月 16 日，广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（本基金基金合同自 2023 年 8 月 10 日起生效，本报告期自 2023 年 8 月 10 日至 2023 年 8 月 16 日）的投资组合报告如下：

（一）报告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	419,727,239.35	34.36
	其中：普通股	419,727,239.35	34.36
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	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	763,831,041.20	62.52
	其他各项资产	38,108,463.51	3.12
	合计	1,221,666,744.06	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 419,727,239.35 元，占基金资产净值比例 50.46%。

（二）报告期末在各个国家（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	419,727,239.35	50.46
合计	419,727,239.35	50.46

注：（1）国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

（2）ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

（三）报告期末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（%）
能源	-	-
医疗保健	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
通讯业务	-	-
信息技术	-	-
金融	-	-
非日常生活消费品	218,443,961.54	26.26
日常消费品	160,440,956.48	19.29
工业	39,952,705.65	4.8
原材料	889,615.68	0.11
合计	419,727,239.35	50.46

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

（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

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	数量 （股）	公允价值 （人民币 元）	占基金资产 净值比例 （%）
----	--------------	--------------	----------	------------	----------------	-----------	--------------------	----------------------

					区)			
1	Yum China Holdings Inc	百胜中国	9987 HK	香港交易所	中国香港	111,000	43,200,046.71	5.19
2	Techtronic Industries Co Ltd	创科实业	669 HK	香港交易所	中国香港	531,500	39,952,705.65	4.80
3	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	2020 HK	香港交易所	中国香港	462,400	34,141,589.53	4.10
4	Li Ning Co Ltd	李宁	2331 HK	香港交易所	中国香港	808,500	29,308,737.84	3.52
5	Nongfu Spring Co Ltd	农夫山泉	9633 HK	香港交易所	中国香港	686,400	27,187,626.87	3.27
6	China Mengniu Dairy Co Ltd	蒙牛乳业	2319 HK	香港交易所	中国香港	1,077,000	25,218,796.68	3.03
7	China Resources Beer Holdings Co Ltd	华润啤酒	291 HK	香港交易所	中国香港	552,000	22,930,720.60	2.76
8	Shenzhou International Group Holdings Ltd	申洲国际	2313 HK	香港交易所	中国香港	281,800	20,067,941.19	2.41
9	Haier Smart Home Co Ltd	海尔智家	6690 HK	香港交易所	中国香港	830,600	17,576,833.27	2.11
10	Haidilao International Holding Ltd	海底捞	6862 HK	香港交易所	中国香港	665,000	13,674,770.39	1.64

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

(五) 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末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**

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

（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

本基金本报告期末未持有基金。

（十）投资组合报告附注

1、本报告期内，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、本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	38,008,047.80
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	39,255.00
7	待摊费用	61,160.71
8	其他	—
9	合计	38,108,463.51

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、 重大事件揭示

本基金自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

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

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

基金托管人就该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》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，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、基金合同的规定和约定，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、基金管理费的计提和支付、基金托管费的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时通知基金管理人限期纠正，并在限期内随时对通知事项进行复查，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。

十二、 备查文件目录

以下备查文件存放于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）中国证监会批准广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）募集的文件

（二）《广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》

（三）《广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》

（四）《广发恒生消费交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

（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

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。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。

广发基金管理有限公司

2023年8月18日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（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、结算机构办理基金登记、结算业务并获得《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融券、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、非交易过户和收益分配等业务规则；

(17) 在不违反法律法规和监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人以基金资产作为质押进行融资；

(18) 选择、更换或撤销基金境外投资顾问、证券经纪代理商等；

(19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 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、赎回和登记结算事宜；

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

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

（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，基金管理人承担其为基金募集承担之一切费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）基金管理人确保境外证券投资项下资金累计净汇出额不得超过国家外汇管理局批准的境外证券投资额度；

(28) 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，为基金开设证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 选择、更换境外托管人，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和证券账户，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，但向监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》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律法规规定的最低期限；

（12）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（13）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；

（14）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；

（15）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；

（16）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；

（17）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；

（18）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；

（19）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；

（20）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（21）保存基金的资金汇出、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律法规规定的最低期限；

（22）对基金的境外财产，基金托管人可授权境外资产托管人代为履行其承担的职责，并对境外资产托管人处理有关本基金事务的行为承担相应责任。境外资产托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；在决定境外托管人是否有过错、疏忽等不当行为，应根据适用法律及境外投资地的市场惯例

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）安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取应得收入；

（25）依据法律法规的有关规定，每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况，并按基金管理人的跨境收付款指令及相关规定进行国际收支申报；

（26）办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

（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）基金份额持有人

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）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

（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) 缴纳基金认购款项、应付申购对价、现金差额及法律法规和《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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

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

本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。

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的联接基金（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特定的联接基金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特定的联接基金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。

（一）召开事由

1、除法律法规规定、基金合同或中国证监会另有约定外，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；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；

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

2、在不违反有关法律法规和《基金合同》约定，并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）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) 因相应的法律法规、深圳证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(5) 基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、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、非交易过户等业务的规则；

(6) 标的指数调整指数编制方法，以及变更基金名称、业绩比较基准；

(7) 基金推出新业务或服务；

(8) 在不违反法律法规的情况下，调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

(9) 在不违反法律法规的情况下，调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告的时间或频率；

(10) 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；

(11) 基金开通场外申购、赎回等相关业务；

(12) 管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、开通跨系统转托管等业务；

(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；

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；

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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、通讯开会或法律法规和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 50%（含 50%）。

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大会公告载明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大会公告载明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 50%（含 50%）；

（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，并与基金登记注册机构记录相符。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于第 1 款第（2）项、或者第 2 款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、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应当

有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

3、在法律法规或监管机构允许的前提下，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，在法律法规或监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、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它事项。

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 50% 以上（含 50%）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》、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自表决通过之日起生效。

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。

（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被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

1、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，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率，计算方法参见《招募说明书》；

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次；

3、本基金的收益分配采取现金分红的方式；

4、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利的影响下，基金管理人、登记结算机构可对基金收益分配原则进行调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告，而不需召开基金份额持有人大会。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额、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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

（一）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

基金管理费每日计提，按月以人民币支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（二）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月以人民币支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

五、基金资产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金主要投资于标的指数（即恒生消费指数）的成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于境内市场和境外市场依法发行的金融工具。具体而言：

针对境外投资，基金可投资于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(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF))；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、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券等固定收益投资工具；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。

针对境内投资，本基金可投资于其他股票（包括主板、科创板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、股指期货、股票期权、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。

其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。未来在法律法规允许

的前提下，履行适当的程序后，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）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%，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。其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

（二）投资限制

1、本基金境内投资应遵循以下限制：

（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资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（8）本基金参与股指期货交易的，应当符合下列要求：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%；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；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及存托凭证总市值的 20%；持有的股票及存托凭证市值和买入、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及存托凭证投资比例的有关约定；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%；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）本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（10）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；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归为流动性受限资产；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%；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；

（11）基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

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

（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本基金合同约定的投资范围保持一致；

（14）本基金参与股票期权交易的，应当符合下列风险控制指标要求：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算。

除上述第（5）、（10）、（12）、（13）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股（含存托凭证等）调整或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，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。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（10）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

2、本基金境外投资应遵循以下限制：

（1）投资比例限制

1）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) 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) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 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；

4) 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%，临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准；

(2) 金融衍生品投资

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：

1) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

2) 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%；

3) 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%；

4) 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；

5) 基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品；

(3) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1) 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；

2) 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%；

3) 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；

4) 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；

5) 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；

6) 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；

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

1) 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；

2) 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；

3) 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；

4) 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；

5) 基金管理人应当对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；

6) 基金参与证券借贷交易、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。

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。

3、本基金境内外投资均应遵循以下限制：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）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%。

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。

4、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。

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。上述期间，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。

（三）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）购买不动产；
- （5）购买房地产抵押按揭；
- （6）购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- （7）购买实物商品；
- （8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%；
- （9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- （10）参与未持有基础资产的卖空交易；
- （11）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- （12）直接投资与实物商品相关的衍生品；
- （13）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （14）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；
- （15）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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

3、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，无须基金份额持有人大会审议。

六、基金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）基金净值信息的公告方式

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过其规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当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生效后方可执行，该决议应当自通过之日起五日内报中国证监会备案，且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，《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、基金合同生效后，连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的；

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

5、《基金合同》约定的其他情形；

6、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《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，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。

八、争议的处理和适用的法律

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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律（不含港澳台立法）管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。