天弘创业板算力基础设施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：天弘基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2026 年 09 月 16 日

公告日期：2026 年 09 月 11 日

目 录

一、重要声明与提示 2
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 10
七、基金财务状况 10
八、基金投资组合 12
九、重大事件揭示 15
十、基金管理人承诺 15
十一、基金托管人承诺 16
十二、备查文件目录 16
附件：基金合同内容摘要 18

一、重要声明与提示

《天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）《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，天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人天弘基金管理有限公司（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。本基金托管人广发证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、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，请投资者详细查阅刊登在天弘基金管理有限公司网站（www.thfund.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的《天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》等法律文件。

二、基金概览

1、基金名称：天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金

2、场内简称：创业板算力ETF天弘

3、基金代码：158061

4、2026年09月09日基金份额总额：414,066,414.00份

5、2026年09月09日基金份额净值：1.0000元

6、本次上市交易份额：414,066,414.00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：2026年09月16日

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：广发证券股份有限公司

11、申购赎回代理券商：渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国盛证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华福证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、民生证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、万和证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（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。

本公司可根据情况变更申购赎回代办券商。

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：中国证券监督管理委员会证监许可[2026]2212 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：本基金 2026 年 09 月 04 日进行发售。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售方式：网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

7、发售机构：

（1）网下现金认购的直销机构：天弘基金管理有限公司。

（2）网上现金认购的发售代理机构：投资者可直接通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。

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

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为 414,061,000.00 元人民币，认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 8,051.18 元人民币（含计入基金资产的有效资金产生的利息）。

上述有效净认购资金已于 2026 年 09 月 09 日全部划至本基金托管人广发证券股份有限公司的基金托管账户。认购款项在募集期间产生的利息于银行结息日后划入基金托管账户。

本次募集有效认购户数为 4976 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 414,066,414.00 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

在基金募集期内，基金管理人的基金从业人员认购基金份额 0 份，占基金份额总量的 0%。基金管理人高级管理人员、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。

10、基金备案情况

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《天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金基金合同》《天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2026 年 09 月 09 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，基金管理人开始正式管理本基金。

11、基金合同生效日：2026 年 09 月 09 日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：414,066,414.00 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：深圳证券交易所深证上〔2026〕1252 号。

2、上市交易日期：2026 年 09 月 16 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、场内简称：创业板算力 ETF 天弘

5、基金代码：158061

6、本次上市交易份额：414,066,414.00 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。

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 2026 年 09 月 09 日，本基金场内份额持有人户数为 4976 户，平均每户持有的基金份额为 83,212.70 份。

（二）持有人结构

截至 2026 年 09 月 09 日，本基金份额持有人结构如下：机构投资者持有的基金份额为 26,015,493.00 份，占基金总份额的 6.28%；个人投资者持有的基金份额为 388,050,921.00 份，占基金总份额的 93.72%。

（三）截至 2026 年 09 月 09 日，前十名基金份额持有人的情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占基金总份额的比例
1	高润冰	5,000,097.00	1.21%
2	西南证券股份有限公司	5,000,097.00	1.21%
3	东吴证券股份有限公司	5,000,097.00	1.21%
4	练林娣	3,145,061.00	0.76%
5	陈瑞珍	3,000,058.00	0.72%

6	种衍民	3,000,058.00	0.72%
7	武汉百胜瑞泽信息科技有限公司	3,000,058.00	0.72%
8	北京亿尚佳瑞科技有限公司	3,000,058.00	0.72%
9	查莉莉	2,970,057.00	0.72%
10	郭智雄	2,001,038.00	0.48%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基金管理人概况

名称：天弘基金管理有限公司

法定代表人：黄辰立

总经理：高阳

信息披露负责人：童建林

联系电话：022-83310208

注册资本：5.143 亿元人民币

注册地址：天津自贸试验区（中心商务区）新华路 3678 号宝风大厦（新金融大厦）16 层 02 单元 3 号房间

设立批准文号：证监基金字[2004]164 号

工商登记注册的统一社会信用代码：91120116767620408K

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事特定客户资产管理业务、中国证监会许可的其他业务。

2、股权结构

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%

天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

3、内部组织结构及职能

本基金管理人设置了合理的组织结构。本基金管理人业务部门主要分为投资研究、市场营销、风控合规、基金运营、技术保障等部门。其中，投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作；市场营销部门主要负责产品营销和市场推广等工作；风控合规主要负责公司及业务全流程合规保障、风险控制等工作；基金运营和技术保障主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。上述部门的设置为基金运作等各环节做好充分准备。

4、人员情况

本基金管理人根据业务需要进行了充足的人员配置。截至 2026 年 06 月 30 日，本基金管理人共有员工 730 人，其中 96.85%以上具有本科及以上学历。

5、基金管理业务介绍

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2004]164 号文批准，于 2004 年 11 月 8 日正式成立，注册资本金为 5.143 亿元人民币。公司总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司，并在北京设有子公司。自成立以来，始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。截至 2026 年 06 月 30 日，本基金管理人（含专户和子公司产品）资产管理总规模 13,205.56 亿元。其中，公募基金资管规模 12,956.80 亿元；专户规模 192.21 亿元；子公司产品规模 56.55 亿元。截至 2026 年 06 月 30 日，共管理运作 267 只公募基金，业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。

6、本基金基金经理

洪明华先生，计算机应用技术硕士，10 年证券从业经验。历任朗讯科技（中国）有限公司软件工程师、路孚特（中国）科技有限公司（原路通世纪（中国）科技有限公司）高级软件工程师、嘉实基金管理有限公司高级软件工程师，2016 年 10 月加盟本公司。历任天弘中证人工智能主题指数型发起式证券投资基金基金经理（2025 年 07 月 30 日至 2026 年 08 月 02 日）、天弘国证港股通科技指数证券投资基金基金经理（2025 年 09 月 23 日至 2025 年 11 月 04 日）。现任本公司基金经理、基金经理助理。天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2025 年 07 月 30 日起任职）、天弘中证沪港深云计算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（2025 年 07 月 30 日起任职）、天弘中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘中证芯片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（2025 年 07 月 19 日起任职）、天弘中证半导体材料设备主题指数型发起式证券投资基金基金经理（2025 年 07 月 30 日起任职）、天弘国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2025 年 11 月 21 日起任职）、天弘国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2025 年 11 月 05 日起任职）、天弘上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2026 年 01 月 15 日起任职）、天弘上证科创板芯片设计主题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（2026 年 06 月 05 日起任职）、天弘中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2026 年 09 月 04 日起任职）、天弘中证人工智能主题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（2026 年 08 月 03 日起

任职）、天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2026年09月09日起任职）。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：广发证券股份有限公司

住所：广东省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：广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

法定代表人：林传辉

成立时间：1994年1月21日

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510号

注册资本：人民币7,824,845,511元

存续期间：长期

信息披露负责人：罗琦

联系电话：020-66338888

广发证券是国内首批综合类证券公司，先后于2010年和2015年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所有限公司主板上市（股票代码：000776.SZ，1776.HK）。截至2026年6月30日，公司共设立证券营业部331家。

广发证券具有完备的业务体系、均衡的业务结构，突出的核心竞争力。拥有投资银行、财富管理、交易及机构和投资管理四大业务板块，具备全业务牌照。公司锻造综合金融服务实力，主要经营指标连续多年稳居中国券商前列，在多项核心业务领域中形成了领先优势，研究、资产管理、财富管理等业务位居前列。截至2026年6月30日，集团总资产11,929.62亿元，归属于上市公司股东的所有者权益为1,767.88亿元，2026年上半年营业收入为268.83亿元，营业利润为159.85亿元，归属于上市公司股东的净利润为116.52亿元。

2、主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘洋先生于2000年7月获得北京大学理学学士，并于2003年7

月获得北京大学经济学硕士学位。

广发证券资产托管部主要人员均具备多年基金、证券、银行等金融机构从业经历或会计师事务所审计经验，从业经验丰富，具备基金从业资格，熟悉基金托管工作。资产托管部员工学历均在本科以上，专业背景涵盖了金融、法律、会计、统计、计算机等领域，是一支诚实勤勉、积极进取的专业从业人员队伍。

3、基金托管业务经营情况

广发证券于 2014 年 5 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。截至 2026 年 6 月 30 日，广发证券托管的公开募集证券投资基金共 135 只。

（三）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

经办注册会计师：蒋燕华、费泽旭

联系人：蒋燕华

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

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

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金2026年09月09日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资 产	本期末 2026年09月09日
资 产：	
货币资金	414,071,351.53
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
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	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	8,051.18
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	414,079,402.71
负债和净资产	**本期末 2026年09月09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	—
应付赎回款	—
应付管理人报酬	—
应付托管费	—
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	625.44
负债合计	625.44
净资产：	
实收基金	414,066,414.00
未分配利润	12,363.27
净资产合计	414,078,777.27
负债和净资产总计	414,079,402.71

八、基金投资组合

本基金目前处于建仓期，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约定。

截至2026年09月09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	-	-
	其中：股票	-	-

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	414,071,351.53	100.00
8	其他资产	8,051.18	0.00
9	合计	414,079,402.71	100.00

2 按行业分类的股票投资组合

2.1 （指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

截至2026年09月09日，本基金未持有指数投资股票。

2.2 （积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

截至2026年09月09日，本基金未持有积极投资股票。

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

3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

截至2026年09月09日，本基金未持有指数投资股票。

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

截至2026年09月09日，本基金未持有积极投资股票。

4 按债券品种分类的债券投资组合

截至2026年09月09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2026年09月09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2026年09月09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2026年09月09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2026年09月09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2026年09月09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2026年09月09日，本基金未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本基金未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

11.2 本基金未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同约定之备选股票库的情况。

11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,051.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,051.18

11.4 基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2026年09月09日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2026年09月09日，本基金未持有指数投资股票。

11.5.2 积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至2026年09月09日，本基金未持有积极投资股票。

11.6 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

（一）2026年09月04日发布天弘基金管理有限公司关于天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告。

（二）2026年09月10日发布天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告。

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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、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公司住所和深圳证券交易所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会准予本基金募集注册的文件

（二）《天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

（四）《天弘创业板算力基础设施交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（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

天弘基金管理有限公司

二〇二六年九月十一日

附件：基金合同内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利和义务

1、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及转融通证券出借业务；

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

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

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

17）决定本基金证券交易结算模式的转换（包括由证券公司交易结算模式转换为托管人结算模式，或由托管人结算模式转换为证券公司交易结算模式）。若本基金采用“证券公司交易结算模式”的，基金管理人有权选择代表本基金进行场内交易、作为结算参与人代理本基金进行结算的证券经纪商，并签订证券经纪服务协议；

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，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，但监管机构、司法机关等有权机关要求提供或因向审计、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定最低期限；

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（税后）在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；募集期间网下股票认购所冻结的股票应予以解冻。相关机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；

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，按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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。

2、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，如发现基金管理人有违反《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，为基金开设托管账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确

保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但监管机构、司法机关等有权机关要求提供或因向审计、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、基金份额申购、赎回对价的现金部分；

9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《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，保存期限应符合法定最低要求；

12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；

15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会，并通知基金管理人；

19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

1）分享基金财产收益；

2）参与分配清算后的剩余基金财产；

3）依法并按照基金合同和招募说明书的规定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、基金产品资料概要等信息披露文件；

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

3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

4）交纳基金认购款项或认购股票、申购对价、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）遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

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

11）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

在本基金成功募集并运作之后，如基金管理人管理本基金的联接基金的：

鉴于本基金和本基金联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金联接基金的基金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，本基金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，本基金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本基金联接基金份额占本基金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。

本基金联接基金的基金管理人不应以本基金联接基金的名义代表本基金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，但可接受本基金联接基金的特定基金份额持有人的委托以本基金联接基金的基金份额持有人代理人的身份参加本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

本基金联接基金的基金管理人代表本基金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，须先遵照本基金联接基金基金合同的约定召开本基金联接基金的基金份额持有人大会，本基金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，由本基金联接基金的基金管理人代表本基金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。

1、召开事由

（1）除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》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）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除外；

11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

12）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额

持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

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重大变化；

5）履行适当程序后，基金推出新业务或服务；

6）调整本基金份额类别的设置；

7）基金管理人、证券交易所、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、基金交易、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）募集并管理以本基金为目标 ETF 的联接基金、在其他证券交易所上市、开通场外申购赎回、跨系统转托管等业务；

9）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；

10）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。

2、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。

3、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。

4、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或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或系统。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二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

4）上述第 3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

（3）在不违反法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

5、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 7 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。

6、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。除法律法规、监管机构另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在符合上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

7、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异议，

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。

8、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。

9、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，经与基金托管人协商一致，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

（三）基金收益分配原则、执行方式

1、本基金收益分配方式采用现金分红；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合以下有关基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况

进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准：

（1）本基金可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率和/或基金的可供分配利润进行评价，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或者基金可供分配利润金额大于 0 元时，基金管理人可进行收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

6、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，按规定在规定媒介公告。

（四）管理费、托管费计提方法、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×0.50%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.10%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支取日期顺延。

（五）与基金财产管理、运用有关的其他费用的提取、支付方式与比例

1、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；

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

3、基金份额持有人大会费用；

4、基金的证券/期货/期权交易、结算等费用；

5、基金的银行汇划费用；

6、基金上市费及年费、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、数据费、收益分配中发生的费用；

7、基金相关账户的开户费用、账户维护费用；

8、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。

上述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。

（六）基金财产的投资目标、投资范围、投资限制

1、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。

2、投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。此

外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、金融衍生工具（国债期货、股指期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。国债期货、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。

3、投资限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

（2）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的

20%；

（4）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（6）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（8）基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（9）本基金参与股指期货、国债期货交易，需遵循下述投资比例限制：

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，持有的买入股指期货及国债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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；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；

本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

（10）本基金参与股票期权交易，应当符合下列要求：基金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；

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

（12）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（13）在最近 6 个月内日均基金资产净值不低于 2 亿元的前提下，本基金可参与转融通证券出借业务。本基金参与转融通证券出借业务的，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适用本条第（11）款的限制规定；同时，本基金参与出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 30%，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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（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）本基金投资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，法律法规或监管机构另有规定从其规定；

（16）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（6）、（11）、（13）、（14）项情形之外，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。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基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告。

（七）基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。为避免基金份额持有人利益因基金份额净值的小数点保留精度受到不利影响，基金管理人可提高基金份额净值的精度。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

（八）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

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

2、《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以及法律法规、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。

3、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 个工作日内成立基金财产清算小组，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财产；

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。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。

5、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。

6、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。基金财产清算报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。

7、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，且保存期限应符合法定最低要求。

（九）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，任何一方均应将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方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（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

（十）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。