

华宝中证医疗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：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市日期：2019年6月17日

公告日期：2019年6月12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、 基金主要当事人介绍.....	6
六、 基金合同摘要.....	12
七、 基金财务状况.....	13
八、 基金投资组合.....	15
九、 重大事件揭示.....	18
十、 基金管理人承诺.....	19
十一、 基金托管人承诺.....	20
十二、 基金上市推荐人意见.....	21
十三、 备查文件目录.....	22

一、重要声明与提示

《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基上市交易公告书》（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《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基（以下简称“本基金”）管理人华宝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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、上海证券交易所对华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基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。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2019年4月17日的《上海证券报》、及华宝基金管理有限公司网站（www.fsfund.com）上的《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基招募说明书》以及同日发布在本公司网站（www.fsfund.com）上的《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基基金合同》（以下简称“基金合同”）。

二、 基金概览

- 1、基金名称：华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金二级市场交易简称：医疗ETF。
- 3、二级市场交易代码：512170。
- 4、基金申购赎回简称：医疗ETF。
- 5、申购赎回代码：512171。
- 6、2019年6月10日基金份额总额：249,440,158.00份。
- 7、2019年6月10日基金份额净值：1.0012元。
- 8、本次上市交易份额：249,440,158.00份。
- 9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 10、上市交易日期：2019年6月17日。
- 11、基金管理人：华宝基金管理有限公司。
- 12、基金托管人：中国银行股份有限公司。
- 13、上市推荐人：长江证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司。
- 14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、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、中银国际证券股份有限公司。
若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

三、 基金的募集与上市交易

(一) 本基金募集情况

- 1、本基金准予募集注册的机构和文号：中国证监会证监许可【2018】2018号文。
- 2、基金合同生效日：2019年5月20日。
- 3、基金运作方式：交易型开放式。
- 4、基金合同期限：不定期。
- 5、发售日期：本基金自2019年4月22日至2019年5月13日进行发售。其中，网下现金和网下股票认购的日期为2019年4月22日至2019年5月13日，网上现金认购的日期为2019年5月9日至2019年5月13日。
- 6、发售价格：人民币1.00元。
- 7、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
- 8、发售机构：
 - (1) 网下现金和网下股票发售直销机构
华宝基金管理有限公司。
 - (2) 网下现金和网下股票发售代理机构
平安证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、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、长江证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司。
 - (3) 网上现金发售代理机构
网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。
- 9、验资机构名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。
- 10、募集资金总额及入账情况
本基金自2019年4月22日起公开募集，截至2019年5月13日募集工作顺利结束。
经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资，本次募集确认的净认购金额为249,438,000.00元人民币（本次募集没有股票换购），折合基金份额249,438,000.00份；
认购款项在募集期间产生的银行利息共计2,158.00元人民币，折合基金份额2,158.00份。
本次募集认购资金已于2019年5月17日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司

开立的华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金托管专户。

本次募集有效认购户数为1,811户，按照每份基金份额初始面值1.00元人民币计算，本次募集资金折合基金份额共计249,440,158.00份，已全部计入基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

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》以及《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2019年5月20日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）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[2019]105号。

2、上市交易日期：2019年6月17日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：医疗ETF。

5、二级市场交易代码：512170。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本基金的二级市场交易。

6、基金申购赎回简称：医疗ETF。

7、申购赎回代码：512171。投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务。目前本基金的一级交易商包括：长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、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、中银国际证券股份有限公司。若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

8、本次上市交易份额：249,440,158.00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 2019 年 6 月 10 日，本基金基金份额持有人户数为 1,811 户，平均每户持有的基金份额为 137,736.14 份。

(二) 持有人结构

截至 2019 年 6 月 10 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 71,013,158.00 份，占基金总份额的 28.47%；个人投资者持有的基金份额为 178,427,000.00 份，占基金总份额的 71.53%。

(三) 截至 2019 年 6 月 10 日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有份额（份）	占基金总份额比例（%）
1	川财证券有限责任公司	8,000,079.00	3.21%
2	华宝证券有限责任公司	8,000,079.00	3.21%
3	文登市森鹿制革有限公司	8,000,000.00	3.21%
4	长城证券有限责任公司	8,000,000.00	3.21%
5	中信证券股份有限公司	7,980,000.00	3.20%
6	光大证券股份有限公司	7,500,000.00	3.01%
7	招商证券股份有限公司	7,000,000.00	2.81%
8	中国建银投资证券有限责任公司	4,000,000.00	1.60%
9	中国中投证券有限责任公司	4,000,000.00	1.60%
10	石家庄格胜普经济信息咨询有限公司	2,000,000.00	0.80%

五、 基金主要当事人介绍

(一) 基金管理人

1、公司概况

名称：华宝基金管理有限公司

法定代表人：孔祥清

总经理：HUANG Xiaoyi Helen（黄小薏）

注册资本：人民币 1.5 亿元

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2003]19 号

工商登记注册的法人营业执照文号：310000400334472

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

成立日期：2003 年 3 月 7 日

股东名称及其出资比例：中方股东华宝信托有限责任公司持有 51%的股份，外方股东 Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持有 49%的股份。

2、内部组织结构及职能

公司下设 31 个部门，包括：研究部、国内投资部、固定收益部、机构投资部、量化投资部、国际业务部、多元资产管理部、养老金部、监察稽核部、风险管理部、北京分公司、深圳分公司、营销中心（西部、北方、东部、南方）、机构及海外销售部、产品开发部、专户营销部、互金策划部、互金展业部、客户服务部、营销管理部、战略规划部、交易部、清算登记部、信息技术部、财务部、人力资源部、综合管理部、党群工作部。

各部门主要职责概述如下：

研究部：从事宏观经济、行业及上市公司、投资策略等方面的研究并为基金投资决策及新产品开发提供基础支持，包括宏观研究、策略研究、行业研究、金融工程研究和债券研究。

国内投资部：负责公募基金资产投资国内证券市场的日常管理和运作，在认真研究和充分论证的基础上，拟定基金投资策略和投资组合方案，经投资决策委员会批准后具体实施，并对实施过程中出现的问题进行反馈和调整。

机构投资部：负责专户资产帐户等非公募基金的投资管理业务和投资咨询业务。

国际业务部：负责公司 QDII 公募基金资产投资海外证券市场的日常管理和运作。

量化投资部：负责管理主动和被动量化基金产品、开展数量化投资策略研究。

固定收益部：主要职责是搜寻债券投资机会，并制定和实施相应的债券投资策略；进行债券分析，包括宏观经济趋势、利率政策、相对价值、信用债券；投资组合构造、优化和管理，包括风险控制、流动性管理。

多元资产管理部：负责跨资产研究；基金等资管理产品研究；负责投资组织策略开发与投资交易运作；开展业务营销工作。

养老金部：负责公司社保基金、年金管理资格的申请；制定社保基金、企业年金的发展战略与规划、产品设计与创新；制定相关投资策略，开展投资管理运作；负责社保基金、企业年金的市场推广与客户开发等。

产品开发部：负责公司产品开发研究，在法律、法规和政策许可的条件下，根据市场需求的变化和特点，不断开发新的基金品种、拓展公司的业务范围，寻找公司新的利润增长点。

北京分公司：主要负责维护公司在北方地区机构销售。

深圳分公司：主要负责维护公司在南方地区机构销售。

机构及海外销售部：主要负责维护公司在华东地区机构销售。

营销中心：主要负责维护公司各大区域的渠道销售。

互金融业部：负责互联网金融商务拓展；互联网金融运维统筹；互联网金融直销展业。

互金策划部：负责互联网金融产品研发；互联网金融内容产生；投顾支持；公司企宣。

机构及海外销售部：主要职能是负责向机构客户销售公募产品和提供相关服务，为特定客户进行一站式服务，拓展客户资源、提高机构销售在公司和业内的市场份额。业务范围包括：公募基金销售、专项资产委托管理、QDII 海外投资及为大型机构提供其他理财或投资咨询服务等。

营销管理部：负责公募基金销售渠道管理和维护；公募基金销售团队的考核管理；销售会务管理。

客户服务部：负责 Call Center 的管理和客户服务工作，协助互联网金融的网上互动服务。

专户营销部：负责向机构客户、高端个人客户和渠道销售特定资产管理产品（即专户产品），提高公司在业内特定资产管理业务的市场份额。

战略规划部：负责公司战略发展规划及中长期发展目标的制定和实施、协助管理层与股东间的沟通交流、牵头公司重大项目的开展。

交易部：负责接受基金经理下达的投资指令，在确认投资指令的有效性后加以执行；及时整理交易记录，按照有关规定存档；及时反馈与交易相关的信息等。

清算登记部：负责基金交易的资金调拨、交易清算；组织基金会计核算，对基金名下所发生的证券投资、资金往来等各种事项进行全面、及时、真实的会计核算；与托管行核对帐目，定期公布相关财务会计报表和会计报告；负责基金绩效评估；负责开放式基金的注册登记等。

信息技术部：负责公司信息系统的日常维护；交易、清算、咨讯所需电脑信息的收集、整理和备份；负责设计、建立及维护开放式基金的业务运作系统；负责公司内部办公电脑软硬件的配置、维护，信息集成系统的安装、开通与调试。

人力资源部：负责公司的人力资源管理政策的制定与落实。

综合管理部：负责公司的行政及后勤管理；文档与会议管理；负责公司的企业文化建设；负责公司的安全保卫工作。

财务部：负责公司的财务会计工作，账务处理，编制公司财务报告；承办公司自有资金的运作等。

党群工作部：负责执行党总支各项工作要求；负责党总支各类文件及会议管理；具体落实相关党务工作；指导工会、共青团等群众组织的工作开展。

监察稽核部：根据公司业务发展，负责公司内控的评估及相应制度完善，对公司新业务、新产品的合规性提出意见建议，对公司的投资业务、市场业务、与基金相关事务及公司行为的合规监控，对公司投资管理、市场营销、公司运营等业务的合规稽核，对公司的各类信息披露的审核及部分内容的报送，负责公司各类法律事务、反洗钱事务，落实公司风险控制委员会相关合规管理的决议，根据公司管理层的指示，就公司合规和内控工作与公司内外部相关机构的协调、沟通。

风险管理部：负责公司投资组合的风险评估，根据投资组合风险评估结果向投资决策机构提供风险管理建议，对公司新的基金、专户产品的风险特征进行分析并提出风险管理措施建议，落实公司风险控制委员会相关风险管理的决议，根据公司管理层的指示，负责就公司的风险管理与公司内外部相关机构的协调、沟通。

信息披露负责人：刘月华；021-38505888

截至 2019 年 3 月 31 日，我公司共有员工 258 人，其中博士及博士以上有 8 人，硕士 155 人，本科 84 人，专科及以下 11 人。

3、基金管理业务情况

截至 2019 年 3 月 31 日，华宝基金管理有限公司旗下共管理 67 只开放式基金，资产管理规模为 158,682,960,790.78 元。旗下管理的基金有宝康系列基金、华宝多策略基金、华宝现金宝货币市场基金、华宝动力组合基金、华宝收益增长基金、华宝先进成长基金、华宝行业精选基金、华宝海外中国成长基金、华宝大盘精选基金、华宝增强收益基金、华宝中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、华宝上证 180 价值 ETF 联接基金、华宝新兴产业基金、华宝可转债基金、华宝油气基金、华宝医药生物基金、华宝资源优选基金、华宝添益货币市场基金、华宝服务优选基金、华宝创新优选基金、华宝生态中国基金、华宝量化对冲基金、华宝高端制造基金、华宝品质生活基金、华宝稳健回报基金、华宝事件驱动基金、华宝国策导向基金、华宝新价值基金、华宝新机遇基金、华宝医疗分级基金、华宝中证 1000 分级基金、华宝万物互联基金、华宝转型升级基金、华宝核心优势基金、华宝美国消费基金、华宝宝鑫纯债基金、华宝香港中小盘基金、华宝中证全指证券公司 ETF、华宝中证军工 ETF、华宝新活力基金、华宝沪深 300 指数增强基金、华宝未来主导产业基金、华宝新起点基金、华宝红利基金、华宝新飞跃基金、华宝新优选基金、华宝香港大盘基金、华宝智慧产业基金、华宝第三产业基金、华宝银行 ETF、华宝银行 ETF 联接基金、华宝价值发现基金、华宝香港本地基金、华宝中证 500 指数增强基金、华宝香港精选基金、华宝券商 ETF 联接基金、华宝宝丰高等级债券基金、华宝绿色主题基金、华宝沪港深价值基金、华宝质量基金、华宝科技先锋基金、华宝宝裕债券基金、华宝中短债债券基金、华宝大健康基金。

4、本基金基金经理

胡洁女士，硕士。2006 年 6 月加入华宝基金管理有限公司，先后在交易部、产品开发部和量化投资部工作，现任量化投资部副总经理。2012 年 10 月至 2019 年 1 月任上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金管理人，2012 年 10 月至 2018 年 11 月任华宝上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金管理人，2015 年 5 月起任华宝中证医疗指数分级证券投资基金管理人，2015 年 6 月至 2018 年 8 月任华宝中证 1000 指数分级证券投资基金管理人，2016 年 8 月起任华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金管理人，2017 年 1 月起任华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金经理，2017 年 7 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金管理人，2018 年 11 月起任华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金管理人，2019 年 1 月起任华宝标普中国 A 股质量价值指数证券投资基金(LOF)基金经理。

(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：陈四清

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：王永民

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管理业务的商业银行，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 2019 年 3 月 31 日，中国银行已托管 710 只证券投资基金，其中境内基金 670 只，QDII 基金 40 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，秉承中国银行风险管理理念，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。2017 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、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：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

办公地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

负责人：曾顺福

联系电话：021-61418888

传真：021-63350177

联系人：曾浩

经办注册会计师：曾浩 吴凌志

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

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

本基金募集结束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 2019 年 6 月 10 日的资产负债表如下：

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

资产	本报告期末
	2019年6月10日
资产：	
银行存款	226,304,009.12
结算备付金	115,000.00
存出保证金	—
交易性金融资产	—
其中：股票投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	23,000,000.00
应收证券清算款	—
应收利息	340,718.57
应收股利	—
应收申购款	—
其他资产	40,514.50
资产总计	249,800,242.19
负债和所有者权益	本报告期末
负债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	

应付管理人报酬	34,201.95
应付托管费	6,840.39
应付销售服务费	—
应付交易费用	—
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
其他负债	16,963.16
负债合计	58,005.50
所有者权益:	
实收基金	249,440,158.00
未分配利润	302,078.69
所有者权益合计	249,742,236.69
负债和所有者权益总计	249,800,242.19

注：截至 2019 年 6 月 10 日，基金份额净值 1.0012 元，基金份额总额 249,440,158.00 份。

八、 基金投资组合

截至 2019 年 6 月 10 日，本基金的投资组合如下：

(一) 报告期末基金资产组合情况

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	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	23,000,000.00	9.21%
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	23,000,000.00	9.21%
6	银行存款和结算备付金合计	226,419,009.12	90.64%
7	其他资产	381,233.07	0.15%
8	合计	249,800,242.19	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1. 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末未持有指数投资部分的股票投资。

2. 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

(三) 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投资明细

本报告期末未持有指数投资部分的股票投资。

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投资明细

本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

(八) 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1. 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

2. 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1. 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

2. 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

3. 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1. 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2. 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

3. 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	340,718.57
5	应收申购款	

6	其他应收款	40,514.50
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	381,233.07

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

(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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 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

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票投资。

九、重大事件揭示

本基金基金合同已于 2019 年 5 月 20 日正式生效，基金管理人已于 2019 年 5 月 21 日在《上海证券报》刊登《华宝中证医疗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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
- (二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
- (三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

- (一) 严格遵守《基金法》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有重大违规行为，将立即报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

- (一) 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。
- (二) 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

(一) 本基金备查文件包括下列文件:

- 1、中国证监会准予华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- 3、《华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- 4、法律意见书;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 7、中国证监会要求的其他文件。

(二) 备查文件的存放地点和投资者查阅方式:

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律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；
- (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、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，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资产净值，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、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者

能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- (23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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) 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，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金管理证券交易资金清算；

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人;
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《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；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、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、半年度和年度基金报告出具意见，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 15 年以上；
- (12) 建立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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

- 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：
 - (1) 分享基金财产收益;
 - (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
 - (3) 依法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、申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

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

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 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。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基金管理人和基金托管人一致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，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本基金的基金份额持有人大会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。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会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。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

- (2) 更换基金管理人;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 转换基金运作方式;
- (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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）;
- (9) 变更基金份额持有人大会程序;
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 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上海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、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》规定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下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、上海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) 基金管理人、相关证券交易所和登记机构等在法律法规、基金合同规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（包括申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）；
- (6) 基金推出新业务或服务；

(7) 按照指数编制公司的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费费率和计算方法；

(8) 在不违反法律法规的情况下，本基金的联接基金采取其他方式参与本基金的申购赎回；

(9) 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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式等法律法规或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）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 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或其代理人参加，方可召开。

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会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

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）本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，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）；

若本人直接出具意见或授权他人代表出具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（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具意见或授权他人代表出具意见；

（4）上述第（3）项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具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、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用网络、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召开基金份额持有人大会，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，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（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。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、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，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

(九) 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的部分，如将来法律法规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

1、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。

2、基金收益分配原则

- (1) 每一基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金基金份额的收益分配方式采用现金分红；
- (3) 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；
- (4) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- (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机构对收益分配另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的原则和有关业务规则进行调整，并及时公告。

3、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、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

4、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公

告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离基金收益评价日的时间不得超过 15 个工作日。

5、基金收益分配中发生的费用

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、运用有关费用的提取、支付方式与比例

(一) 基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金的指数许可使用费

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；

9、基金上市费及年费；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

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

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。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进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

上述“（一）基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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)。

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

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;权证、股指期货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。

(三) 投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数,实现基金投资目标。

1、组合复制策略

本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况,导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要,将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

4、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同,控制信用风险和流动性风险的前提下,选择经风险调整后相对价值较高

的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。

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，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（四）投资组合管理

本基金的指数化投资采用组合复制法，按照成份股在中证医疗指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

1、标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

2、成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

3、标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

4、申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

5、跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（五）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；
- (2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(5) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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）、权证、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%；每个交易日日终在扣除股指期货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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）；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；

- (6) 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%；

- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 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；
- (11) 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；
- (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基金合同约定的投资范围保持一致；
- (14) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
- (15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（10）、（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。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或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) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销的证券，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。

法律、行政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以变更后的规定为准。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值的计算方法

基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

2、基金资产净值的公告方式

《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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金销售机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

七、基金合同解除和终止的事由、程序

(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自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为六个月。

（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 15 年以上。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》产生的或与《基金合同》有关的一切争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人都具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖并从其解释。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成为册，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。