

南方恒生中国企业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：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

公告日期：二〇一八年三月十二日

目录

一、	重要声明与提示.....	4
二、	基金概览	4
三、	基金的募集与上市交易	5
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人	7
五、	基金主要当事人简介	8
六、	基金合同摘要.....	14
七、	基金财务状况.....	15
八、	基金投资组合.....	15
九、	重大事件揭示.....	19
十、	基金管理人承诺.....	19
十一、	基金托管人承诺.....	19
十二、	基金上市推荐人意见	19
十三、	备查文件目录.....	20
	附件：基金合同摘要.....	21

一、重要声明与提示

《南方恒生中国企业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〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人南方基金管理股份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。本基金托管人中国工商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、深圳证券交易所对南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资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2017年11月27日《证券时报》等报刊及南方基金管理股份有限公司网站(www.nffund.com)上公告的《南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

- 1、基金名称:南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金简称:H股ETF
- 3、基金代码:159954
- 4、基金份额总额:394,105,083.00份(截止:2018年3月8日)
- 5、基金份额净值:1.0103元(截止:2018年3月8日)
- 6、本次上市交易份额:394,105,083.00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:2018年3月15日
- 9、基金管理人:南方基金管理股份有限公司
- 10、基金托管人:中国工商银行股份有限公司
- 11、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

12、申购赎回代理券商：华泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司（排名不分先后）。

三、基金的申购赎回与上市交易

（一）本次基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2017年2月21日证监许可[2017]255号文

2、基金合同生效日：2018年2月8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：2017年11月30日至2018年1月30日。其中，网下现金发售的日期为2017年11月30日至2018年1月30日，网上现金发售的日期为2017年11月30日至2018年1月30日。

6、发售价格：人民币1.00元。

7、发售方式：投资人可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。

8、发售机构：

（1）网下现金发售机构

南方基金管理股份有限公司

（2）网上现金发售代理机构

投资者可直接通过以下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（排序不分先后）：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、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、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源、西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华

鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深交所会员可通过深交所开放式基金销售系统办理本基金的认购业务。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况

南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金管理于2017年11月30日公开募集，基金募集工作已于2018年1月30日结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的募集金额总额为394,071,000.00元人民币，有效认购款项在本基金验资确认日之前产生的利息共计34,083.00元人民币，按照本基金基金合同、招募说明书的约定，34,083.00元利息折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。募集资金已于2018年2月2日划入本基金在基金托管中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为5196户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计394,105,083.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本基金管理人南方基金管理股份有限公司基金从业人员没有认购本基金。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。

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管理办法》以及《南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金管理合同》、《南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金管理说明书》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2018年2月8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。

（二）本基金日常申购、赎回情况

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回。基金管理人在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(三) 本基金日常申购、赎回安排

本基金日常申购、赎回开放日：2018年3月15日。

(四) 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：深证上【2018】116号

2、上市交易日期：2018年3月15日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、上市交易份额简称：H股ETF

5、交易代码：159954

6、本次上市交易份额：394,105,083.00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 2018 年 3 月 8 日，本基金持有人户数为 5191 户，平均每户持有的基金份额为 75,920.84 份。

(二) 持有人结构

截至 2018 年 3 月 8 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 388,914,669.00 份，占场内基金总份额的 98.68%。机构投资者持有的基金份额为 5,190,414.00 份，占场内基金总份额的 1.32%。

(三) 截至 2018 年 3 月 8 日，前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	宗倩	23,575,895.00	5.98%
2	周瑞红	10,000,388.00	2.54%
3	赵汉新	5,000,097.00	1.27%

4	陆阿大	4,000,583.00	1.02%
5	刘金彦	2,437,135.00	0.62%
6	殷胜利	2,093,203.00	0.53%
7	李兰	2,000,330.00	0.51%
8	邹彩萍	2,000,194.00	0.51%
9	卜凤兰	2,000,038.00	0.51%
10	叶明	1,994,155.00	0.51%
合计		55,102,018.00	13.98%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一) 基金管理人

- 1、名称：南方基金管理股份有限公司
- 2、法定代表人：张海波
- 3、总裁：杨小松
- 4、注册资本：3亿元人民币
- 5、住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦 31-33 层
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]4 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码 91440300279533137K
- 8、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
- 9、股权结构：华泰证券股份有限公司 45%；深圳市投资控股有限公司 30%；厦门国际信托有限公司 15%；兴业证券股份有限公司 10%。

10、内部组织结构及职能：

部门名称	主要职责
宏观研究与资产配置部	<ol style="list-style-type: none"> 1. 负责集团层面的宏观策略研究及大类资产配置研究 2. 建立研究资源共享平台，将各体系研究成果在集团层面实现共享 3. 整合各研究部门的标准化研究资源，向集团各部门提供研究支持 4. 负责 FOF 产品的投资管理及基金研究
权益投资部	<ol style="list-style-type: none"> 1. 负责权益公募产品的投资管理

	<p>2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
权益研究部	<p>1. 负责股票市场的行业与上市公司研究，提出投资建议并完成研究报告撰写</p> <p>2. 及时更新和维护股票池、研究数据以及研究模型</p> <p>3. 协助固定收益相关部门开展信用研究及可转债研究，并提出判断和建议</p> <p>4. 向销售市场相关部门提供研究支持服务</p>
权益专户投资部	<p>1. 负责权益专户产品的投资管理</p> <p>2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
数量化投资部	<p>1. 负责主动量化策略公募产品的投资管理</p> <p>2. 根据量化模型，完成投资策略研究及择时研究工作，并提出判断和建议</p> <p>3. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
指数投资部	<p>1. 负责被动指数公募产品的投资管理</p> <p>2. 根据量化模型，完成投资策略研究工作，并提出判断和建议</p> <p>3. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
固定收益投资部	<p>1. 负责固定收益公募产品的投资管理</p> <p>2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
固定收益专户投资部	<p>1. 负责固定收益专户产品的投资管理</p> <p>2. 向全国社保理事会提供支持服务</p> <p>3. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
现金投资部	<p>1. 负责货币、短期理财等公募产品的投资管理</p> <p>2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
固定收益研究部	<p>1. 负责可转债研究和信用研究，提出投资建议并完成研究报告撰写</p> <p>2. 向全国社保理事会提供支持服务</p> <p>3. 向销售市场相关部门提供研究支持服务</p>
国际业务部	<p>1. 负责海外市场产品的研究、投资管理；</p> <p>2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作</p> <p>3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作</p>
战略与产品 开发部	<p>1. 在战略与产品委员会的指导下，研究资产管理行业的发展战略，完成集团层面的战略规划撰写工作</p>

	<p>2. 研究国内外资产管理产品发展动态和创新趋势，进行产品创新、开发及储备，建设和维护公司产品库</p> <p>3. 负责公司创新业务的研究及孵化工作</p>
公募产品管理部	<p>1. 负责公募业务线产品日常管理与维护工作</p> <p>2. 负责公募业务线产品的立项、制作、报批与管理等</p>
专户产品管理部	<p>1. 负责专户产品日常管理与维护工作</p> <p>2. 负责专户业务线产品的立项、制作、报批与管理等</p>
市场管理部	<p>1. 负责公募业务线下渠道的整体管理工作，包括线下渠道发展规划、渠道开拓及渠道日常服务等</p> <p>2. 负责线下渠道的营销管理工作，包括渠道营销方案的制定、销售市场情况及销售数据分析等</p> <p>3. 负责分公司线下渠道的管理和协调工作，包括销售任务分配、考核指标下达、预算费用管理、交叉销售政策制定、培训支持等</p>
机构业务部	<p>1. 负责专户业务线机构业务的销售管理、资源共享整合</p> <p>2. 根据公司机构业务经营目标和战略进行整体营销规划</p> <p>3. 对集团的机构业务提供专业服务与支持</p>
保险机构业务部	<p>1. 负责保险机构业务的销售管理、资源共享整合</p> <p>2. 根据保险机构业务经营目标和战略进行整体营销规划</p> <p>3. 对集团的保险机构业务提供专业服务与支持</p>
养老金业务部	<p>1. 负责专户业务线养老金业务的销售管理、资源共享整合</p> <p>2. 根据公司养老金业务经营目标和战略进行整体营销规划</p> <p>3. 对集团的养老金业务提供专业服务与支持</p>
北京、上海、深圳、南京、成都分公司	<p>1. 负责组织完成所辖片区的银行、财务公司、券商、保险、企事业单位及高净值人群的客户销售与拓展</p> <p>2. 开展资产创设业务与另类产品交叉销售工作</p> <p>3. 维护相关政府、监管机构和行业协会关系，提供相关接待及后勤服务</p> <p>4. 完成公司下达的预算指标和利润指标</p>
合肥分公司 (理财中心)	<p>1. 履行理财中心相关职能</p> <p>2. 通过电话、网络等多种服务通道，为客户提供集理财咨询和资讯为一体的专业理财顾问服务</p> <p>3. 合肥理财中心隶属客户关系部</p>
互联网金融部	<p>1. 负责公募业务线上渠道的整体管理工作，包括线上渠道发展规划、平台和网站建设及维护等</p> <p>2. 负责线上渠道的营销管理工作，包括线上渠道推广、线上渠道营销方案的制定、线上销售市场情况及销售数据分析等</p>
企划部	<p>1. 负责集团品牌形象规划与实施</p> <p>2. 负责销售、宣传、活动等创意策划</p> <p>3. 为集团销售前台做好营销支持，提高公司的公众认知度和美誉度</p>
客户关系部	<p>1. 建立客户沟通平台，为客户提供专业理财咨询服务；收集客户需求和建议，处理客户投诉；</p> <p>2. 搭建客户分类分级服务体系，进行客户信息分析和挖掘；运用多种服务形式和服务手段，进行客户关系的有效维护</p>
监察稽核部	<p>1. 统筹集团层面的内控体系规划，建设并完善集团法律合规和监察稽核体系</p>

	<ul style="list-style-type: none"> 2. 负责合规及运作风险的识别、评估、控制和应急处理，确保公司各项业务合规稳健运行 3. 监督检查基金和公司运作的合法合规情况、公司内部风险控制情况、委员会的运作情况 4. 为公司各项业务发展提供法律支持
风险管理部	<ul style="list-style-type: none"> 1. 统筹集团层面的风险管理规划，建设并完善集团风险管理系統和投资监控体系 2. 负责操作风险管理：进行风险预防、评估、监控、报告，对风险处置情况进行持续跟踪 3. 负责投资风险的识别、评估、控制、应急处理及产品业绩归因分析，为公司风险管理决策提供专业支持
交易管理部	<ul style="list-style-type: none"> 1. 负责组合交易和交易执行等策略的研究和制定 2. 负责交易实施，降低交易成本、获得交易收益、防范交易过程中的风险 3. 负责交易分析和新产品持续研究，提供相关交易支持
信息技术部	<ul style="list-style-type: none"> 1. 根据集团业务发展战略要求，完成集团信息系统的规划 2. 负责集团信息系统的建设和应用开发，持续完善集团信息化建设 3. 负责集团信息系统的运行维护，提升运营效率，支持集团业务发展
运作保障部	<ul style="list-style-type: none"> 1. 统筹集团层面的基金运营管理，搭建集团层面的统一运营服务平台 2. 负责基金的投资清算、会计与估值、信息披露等基金会计工作 3. 负责基金的注册登记、清算交收、数据统计及费用核算等工作
人力资源部 党委组织部	<ul style="list-style-type: none"> 1. 统筹集团层面的人力资源规划，制定集团人力资源政策 2. 负责人力资源体系建设，实施人才招聘、培养、激励与保留，提供相关人力资源服务，支持公司业务发展 3. 人力资源部与党委组织部合署办公，协助党委开展党员干部的选拔任用、管理监督、调整配备工作
办公室 党委办公室	<ul style="list-style-type: none"> 1. 统筹集团层面的制度梳理、流程管理和文件归档工作 2. 负责公司公文流转、办公文秘、公司会议组织及会议事项督办等工作 3. 负责行政后勤、招投标采购管理、基建管理、办公安全等保障类工作 4. 负责董事会办公室、工会、公益事业等日常事务工作 5. 办公室与党委办公室合署办公，协助党委领导处理日常党务工作，贯彻并跟进党委会决议执行情况，开展党员发展培养和党员先进性教育等工作
财务部	<ul style="list-style-type: none"> 1. 负责集团预算管理工作 2. 执行集团财务规划、资本优化以及财务风险预警管理，对公司财务状况进行监控和分析 3. 负责资金管理、会计核算、财务信息披露及税务管理，支持公司业务发展

11、人员情况：

截止到 2017 年 12 月，我公司共有员工 585 人，博士 18 人、硕士 391 人、本科 157 人、其他 19 人。

12、信息披露负责人：常克川

咨询电话：400-889-8899

13、基金管理业务情况简介：

截至 2017 年 12 月，南方基金管理股份有限公司旗下共管理 153 只开放式基金及多只专户产品、社保投资组合和企业年金投资组合，管理总资产规模约 7268.43 亿元人民币，旗下管理的开放式基金有南方稳健、南方宝元、南方避险、南方现金、南方积配、南方高增、南稳贰号、南方绩优、南方成份、南方多利、南方全球、南方隆元、南方盛元、南方价值、南方恒元、南方 300 联接、南方 500、深成 ETF、南方深成、南方策略、小康 ETF、南方小康、南方广利、南方金砖、南方成长、南方 10 年国债、南方平衡混合、380ETF、南方 380、南方香港、南方消费、南方金利、南方润元、南方理财 14 天、南方高端装备、南方理财 60 天、南方安心、南方收益宝、500ETF、300ETF、南方永利、南方中票、南方稳利、南方丰元、南方聚利、南方医保、南方现金通、南方新优享、南方通利、中国梦基金、南方薪金宝、南方天元、南方启元、500 医药、南方绝对收益、理财金、恒指 ETF、南方产业活力、南方双元、南方创新经济、500 工业、500 原料、南方利淘、大数据 100、南方改革机遇、南方利鑫、南方利众、南方丰合、改革基金、高铁基金、大数据 300、500 信息、南方量化成长、互联基金、南方利达、南方消费活力、南方国策动力、南方香港成长、南方顺达、南方利安、南方荣光、南方顺康、南方弘利、南方瑞利混合、南方沪港深价值、南方益和保本、南方君选、南方日添益、亚洲美元债、南方驱动混合、南方安享绝对收益、南方新兴混合、南方卓享绝对收益、创业板 EF、南方创业板、南方原油、南方甄智混合、南方品质混合、南方荣毅、南方荣欢、南方荣冠、500 信息联接、南方转型混合、南方安泰养老、南方颐元、南方多元、1000ETF、南方天天利、南方荣发、南方卓元、南方安裕养老、南方荣安、南方中证 500 增强、南方宣利、南方安颐养老、南方睿见混合、南方和利、南方教育股票、南方宏元、南方军工混合、南方全指证券联接、证券基金、南方荣优、南方智慧混合、国企精明、南方和元、南方文旅混合、南方荣尊、南方纯元、南方荣知、南方高元、南方安康混合、银行基金、南方银行联接、南方安睿混合、南方荣年、恒生联接、南方智造股票、南方金融混合、南方祥元、有色金属、南方天天宝、南方房地产联接、南方量化混合、房地产、南方有色金属联接、南方兴利、南方兴盛混合、南方全天候策略、美国 REIT、南方安福混合、南方互联混合、南方优享分红混合；以及多个专户产品、全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。

14、本基金基金经理简介

孙伟先生，管理学学士，具有基金从业资格、金融分析师（CFA）资格、注册会计师（CPA）资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010

年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员；2014 年 12 月至 2015 年 5 月，担任南方恒生 ETF 的基金经理助理；2015 年 5 月至 2016 年 7 月，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月至今，任改革基金、高铁基金、500 信息基金经理；2016 年 5 月至今，任南方创业板 ETF、南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月至今，任 500 信息联接、深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月至今，任南方全指证券 ETF 联接、南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月至今，任南方中证银行 ETF、南方银行联接基金经理。

罗文杰女士，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，曾任南方基金数量化投资部基金经理助理，现任指数投资部兼数量化投资部总经理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2016 年 12 月至今，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2017 年 7 月至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月至今，任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基金经理；2017 年 11 月至今，任南方策略、南方量化混合基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称“中国工商银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100140）

首次注册登记日期：1984 年 1 月 1 日

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

法定代表人：易会满

基金托管业务批准文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

托管部门信息披露联系人：赵会军

传真：(010) 66105798

中国工商银行客服电话：95588

2、基金托管部门及主要人员情况

截至 2017 年末，中国工商银行资产托管部共有员工 230 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年末，中国工商银行共托管证券投资基金 815 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 54 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：陈熹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：陈熹、薛竟

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

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或佣金比例收取。

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。

南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金管理人 2018 年 3 月 8 日资产负债表如下：

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	123,957,921.09	短期借款	
结算备付金	38,970,245.48	交易性金融负债	
存出保证金	7,514,747.84	衍生金融负债	
交易性金融资产	300,203,177.86	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	300,203,177.86	应付证券清算款	72,332,291.40
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	43,416.58
基金投资		应付托管费	8,683.32
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	262,964.04
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	174,452.52	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	39,855.93
其他资产	34,081.71	负债合计	72,687,211.27
		所有者权益：	
		实收基金	394,105,083.00
		未分配利润	4,062,332.23
		所有者权益合计	398,167,415.23
资产合计：	470,854,626.50	负债与持有人权益总计：	470,854,626.50

注：本基金份额为 394,105,083.00 份，基金份额净值为 1.0103 元。

八、 基金投资组合

截止到 2018 年 3 月 8 日，南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金管理人 2018 年 3 月 8 日资产负债表如下：

(一) 基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	300,203,177.86	63.76%
	其中：股票	300,203,177.86	63.76%
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		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	162,928,166.57	34.60%
7	其他各项资产	7,723,282.07	1.64%
8	合计	470,854,626.50	100.00%

(二) 按行业分类的股票投资组合

1、指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
原材料	4,293,067.55	1.08%
医疗保健	4,641,575.58	1.17%
信息技术	6,114,630.65	1.54%
日常消费品	617,492.70	0.16%
能源	32,056,923.65	8.05%
金融	209,086,116.49	52.51%
公用事业	4,765,542.30	1.20%
工业	12,397,057.88	3.11%
非日常生活消费品	12,607,594.65	3.17%
房地产	4,788,111.04	1.20%
电信业务	8,835,065.37	2.22%
合计	300,203,177.86	75.40%

注：以上分类采用 GICS 行业分类标准。

2、积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金未持有积极投资。

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量(股)	公允价值 (人 民币元)	占基 金资 产净 值比 例 (%)
----	--------------	--------------	----------	------------	----------------------	-------	--------------------	----------------------------------

1	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398.HK	香港联交所	香港	5,520,000.00	30,342,864.82	7.62%
2	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318.HK	香港联交所	香港	446,000.00	30,240,191.52	7.59%
3	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	0939.HK	香港联交所	香港	4,545,000.00	29,715,928.11	7.46%
4	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988.HK	香港联交所	香港	8,426,000.00	28,769,493.42	7.23%
5	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628.HK	香港联交所	香港	789,000.00	14,616,052.21	3.67%
6	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	0386.HK	香港联交所	香港	2,706,000.00	13,979,066.11	3.51%
7	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3968.HK	香港联交所	香港	414,000.00	11,428,700.18	2.87%
8	Agricultural Bank of China Limited	中国农业银行股份有限公司	1288.HK	香港联交所	香港	2,934,000.00	10,159,861.65	2.55%
9	Petrochina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	0857.HK	香港联交所	香港	2,238,000.00	9,682,672.98	2.43%
10	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601.HK	香港联交所	香港	279,600.00	8,655,116.70	2.17%

注：基金对以上证券代码采用当地交易市场代码。

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十名股票及存托凭证投资明细
无。

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有债券。

(五) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有债券。

(六) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有贵金属。

(八) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有权证。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有股指期货。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,514,747.84
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	174,452.52
5	应收申购款	
6	其他应收款	34,081.71
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	7,723,282.07

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有可转换债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2018 年 3 月 8 日，本基金未持有流通受限股票。

九、重大事件揭示

无。

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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

- (一) 严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理办法》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《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理办法》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《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理办法》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、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、 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) 中国证监会准予南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- (二) 《南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《南方恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

南方基金管理股份有限公司

2018年3月12日

附件：基金合同摘要**一、基金合同当事人的权利、义务****(一) 基金份额持有人**

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或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、基金销售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、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人的利益；
- (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及债权人权利，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/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、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价格、申购、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资产净值，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、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，但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(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 15 年以上；

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集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。

当本基金使用合格机构投资者额度进行投资时：

(1) 确保基金管理人发送的交易数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据真实、准确、完整；

(2) 确保基金管理人向基金托管人发送的基金认购、申购和赎回数据符合《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定，并保证该数据的真实、准确和完整；

(3) 委托境外证券服务机构代理买卖证券的，应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；

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

(5) 进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

(6) 如需在基金托管人选择的机构之外保管、登记基金财产，应严格审查，保证基金财产的安全，以及相关资产收益准确、按时归入基金财产；

(三) 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人的利益；

(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、更换或撤销境外托管人；
 - (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，但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；
 - (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；
 - (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；
 - (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》和《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；
 - (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
 - (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

- (19) 因违反《基金合同》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。

当本基金使用合格机构投资者额度进行投资时

- (1) 对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责。境外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；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 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，并按相关规定进行国际收支申报；
- (5) 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；
- (6) 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 20 年；
- (7) 按照规定监督基金管理人的投资运作，确保基金按照有关法律法规和基金合同约定的投资目标和限制进行管理；
- (8) 按照有关法律法规和基金合同的约定执行基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 确保基金的份额净值按照有关法律法规和基金合同规定的方法进行计算；
- (10) 确保基金按照有关法律法规和基金合同的规定进行申购、认购、赎回等日常交易；
- (11) 确保基金根据有关法律法规和基金合同确定并实施收益分配方案；

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本基金的基金份额持有人和本基金联接基金的基金份额持有人组成，上述两类持有人可以委托其合法授权代表参会并表决。本基金的基金份额持有人持有的每一基金份额为一参会份额，每一参会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相同的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，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。

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、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、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，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况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) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，通过合格境内机构投资者的额度进行投资，并依据合格境内机构投资者境外证券投资的相关法律法规的要求对《基金合同》和招募说明书进行必要修改；

(6) 基金管理人、相关交易所和登记机构等在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务的规则；

(7) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下增加或调整基金份额类别设置；

(8) 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、通讯开会方式召开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召集人通知的非

现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

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少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、在法律法规或监管机构允许前提下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，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同等表决权。

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、与其他基金合并、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，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。

(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 个工作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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 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。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《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；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采取现金分红方式；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，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、分配数额及比例、分配方式等内容。

(五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作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收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

(六) 基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

四、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数使用费（包括为

指数公司缴纳的相关税费等);

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、审计费、诉讼费和仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券/期货交易费用、所投资基金的交易费用和管理费用及在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用 (out-of-pocket fees);

8、基金的银行汇划费用;

9、基金上市费及年费;

10、基金相关账户的开户及维护费用;

11、基金依照有关法律法规应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息及费用)(简称“税收”);

12、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用;

13、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等;

14、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用;

15、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 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,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、公休假等,支付日期顺延。

本基金的管理费的具体使用由基金管理人支配;如果委托境外投资顾问,基金的管理费可以部分作为境外投资顾问的费用,具体支付由基金管理人与境外投资顾问在有关协议中进行约定。

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 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,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，支付日期顺延。

本基金的托管费的具体使用由基金托管人支配；如果委托境外托管人，其中可以部分作境外托管人的费用，具体支付由基金托管人与境外托管人在有关协议中进行约定。

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（包括为指数公司缴纳的相关税费等）。

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。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—15 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、法规和基金投资所在地的法律法规执行；基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

五、基金财产的投资范围和投资限制

(一) 投资范围

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（包括沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及包括深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）。基金在境内可投资于货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具。基金在境外可投资于境外证券市场的股票、公募基金、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、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证、期权等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金投资标的指数成份股、备选成份

股的资产不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%。正常情况下，基金投资港股通股票的资产不低于基金资产净值的 80%。

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。

（二）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、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%；正常情况下，基金投资港股通股票的资产不低于基金资产净值的 80%。

（2）基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。本款所称银行应当是中资商业银行在境外设立的分行或在最近一个会计年度达到中国证监会认可的信用评级机构评级的境外银行。

（3）基金持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金净值的 10%，但标的指数成份股不受此限。

（4）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的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

（5）基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量，但标的指数成份股不受此限。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

（6）基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

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

（8）同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

（9）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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

（10）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。

(11) 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(9)项、第(10)项外，若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求，但中国证监会规定的特殊情形除外。如因港股通额度不足原因导致基金持仓比例超限，基金将在额度可用后5个工作日内调整符合投资比例限制要求。中国证监会根据证券市场发展情况或基金具体个案，可以调整上述投资比例限制。

2、金融衍生品投资

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

(1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。

(2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。

(3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易的对手方（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) 基金管理人应当在本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。

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) 所有参与交易的对手方（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的对手方（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。

5、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 购买不动产；

(2) 购买房地产抵押按揭；

(3) 购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；

(4) 购买实物商品；

(5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%；

(6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；

(7) 参与未持有基础资产的卖空交易；

(8) 从事证券承销业务；

(9) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(10) 从事承担无限责任的投资；

(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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (13) 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；
- (14) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (15) 法律、行政法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他活动。

6、若法律、行政法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，本基金相应调整禁止行为和投资限制规定。

7、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、申购或赎回数额较大及港股通额度已满等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因港股通额度已满等基金管理人之外的因素致使不能在 30 个工作日内完成调整的，基金管理人应当在合理时间内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

如果法律法规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，则本基金投资不再受相关限制。

六、基金资产估值

(一) 估值日

本基金的估值日为本基金的开放日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非开放日。此外，在深圳证券交易所假期休市期间，如果香港联合交易所有交易，为了更好的反应香港市场波动对资产的影响，基金可根据具体情况在深圳证券交易所假期休市的最后一日进行估值。

(二) 估值对象

基金所拥有的股票、股指期货、债券、衍生工具和其它投资等持续以公允价值计量的金融资产及负债。

(三) 估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 上市流通的股票按估值日在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 处于未上市期间的股票应区分如下情况处理：

1) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

2) 送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价

进行估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值；

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值。

2、基金估值方法

(1) 上市流通的基金按估值日在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

(2) 非上市流通基金以估值截止时点能够取得的最新基金份额净值进行估值。

3、债券估值方法

(1) 对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

(2) 对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

4、衍生品估值方法

(1) 上市流通衍生品按估值日在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 非上市衍生品采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

5、汇率

人民币对主要外汇的汇率应当以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

若无法取得上述汇率价格信息时，以基金托管人或境外托管人（如有）所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。

6、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

7、如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

8、相关法律法规、监管部门及自律规则另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国

家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

(四) 估值程序

1、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。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于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。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

(五) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未

及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六)暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(七)基金净值的确认

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

负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按规定公布。

(八)特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

七、基金合同变更、终止与基金财产的清算

(一)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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，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，并自决议生效后两个工作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 6 个月。

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金资产清算小组认为有对基金份额持有人更为有利的清算方法，本基金财产的清算可按该方法进行，并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。相关法律法规或监管部门另有规定的，按相关法律法规或监管部门的要求办理。

(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》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人都有约束力。除非仲裁裁决另有规定，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》受中国法律管辖。

九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。