

南方国证港股通创新药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：中信建投证券股份有限公司

公告日期：二〇二五年九月十七日

## 目录

一、	重要声明与提示.....	3
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.....	8
五、	基金主要当事人简介.....	9
六、	基金合同摘要.....	15
七、	基金财务状况.....	17
八、	基金投资组合.....	19
九、	重大事件揭示.....	23
十、	基金管理人承诺.....	24
十一、	基金托管人承诺.....	25
十二、	基金上市推荐人意见.....	26
十三、	备查文件目录.....	27
附件：	基金合同摘要.....	28

## 一、重要声明与提示

《南方国证港股通创新药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，南方国证港股通创新药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。

本基金托管人中信建投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、深圳证券交易所对南方国证港股通创新药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2025年8月29日刊登在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）以及南方基金管理股份有限公司网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）上公告的《南方国证港股通创新药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：南方国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金简称：南方国证港股通创新药 ETF；场内简称：港股通创新药 ETF 南方
- 3、基金代码：159297
- 4、基金份额总额：335,418,642.00 份（截至 2025 年 9 月 15 日）
- 5、基金份额净值：1.0008 元（截至 2025 年 9 月 15 日）
- 6、本次上市交易份额：335,418,642.00 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：2025 年 9 月 22 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：中信建投证券股份有限公司
- 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、申购赎回代办证券公司：万和证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东兴证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中国中金财富证券有限公司、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、兴业证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国新证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司（原“国泰君安”）、国泰海通证券股份有限公司（原“海通”）、国海证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国联民生证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、江海证券有限公司、浙商证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、粤开证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、联储证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司（排名不分先后）。

基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代办证券公司。

### 三、 基金的募集与上市交易

#### （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 2025 年 7 月 25 日证监许可〔2025〕1588 号文

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：2025 年 9 月 3 日至 2025 年 9 月 9 日。本次发售开通网上现金认购、网下现金认购 2 种方式。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：5 个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购。

8、发售机构：

##### （1）网下现金销售机构

1) 直销机构：南方基金管理股份有限公司

2) 发售代理机构：中信建投证券股份有限公司、平安证券股份有限公司（排名不分先后）。

##### （2）网上现金发售代理机构

1) 已经具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单如下：

爱建证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东莞证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联民生证券、国融证券、国盛证券、国泰海通证券、国投证券、国新证券、国信证券、国元证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、华源证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源、申万宏源西部、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、麦高证券、五矿证券、西部证券、西南证券、湘财证券、诚通证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、长城国瑞、长城证券、长江证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

2) 本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员可通过深圳证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。如有新增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以销售机构的公告为准。

9、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况

南方国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金于2025年9月3日至2025年9月9日公开募集，基金募集工作已于2025年9月9日结束。

经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的募集金额总额为335,418,642.00元人民币（含利息结转），有效认购款项在本基金验资确认日之前产生的利息共计17,642.00元人民币，按照本基金基金合同、招募说明书的约定，17,642.00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2025年9月12日划入本基金在基金托管人中信建投证券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6,662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335,418,642.00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运作管理办法》以及《南方国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《南方国证港股通创新药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2025年9月12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。

12、基金合同生效日：2025年9月12日

13、基金合同生效日的基金份额总额：335,418,642.00份

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上（2025）996号

2、上市交易日期：2025年9月22日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位均可参与基金交易。

4、上市交易份额简称：港股通创新药ETF南方

5、交易代码：159297

6、本次上市交易份额：335,418,642.00份

7、基金资产净值的披露：每个开放日的次日公布本基金的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统揭示。

8、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 2025 年 9 月 15 日，本基金持有人户数为 6,623 户，平均每户持有的基金份额为 50,644.52 份。

##### （二）持有人结构

截至 2025 年 9 月 15 日，本基金份额持有人结构如下：

场内个人投资者持有的基金份额为 318,426,481.00 份，占场内基金总份额的 94.93%。  
场内机构投资者持有的基金份额为 16,992,161.00 份，占场内基金总份额的 5.07%。

##### （三）截至 2025 年 9 月 15 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	张晓芹	13,500,918.00	4.03
2	王金艳	6,000,408.00	1.79
3	祝建国	3,000,233.00	0.89
4	张楠	3,000,233.00	0.89
5	无锡煤矿机械股份有限公司	3,000,233.00	0.89
6	李志民	3,000,087.00	0.89
7	中信建投证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	2,614,194.00	0.78
8	丁济珍	2,200,085.00	0.66
9	成都照月私募基金管理有限公司—照月松间指数增强私募证券投资基金	2,001,155.00	0.60
10	綦海鹰	2,000,155.00	0.60
11	罗跃红	2,000,155.00	0.60
12	张丹	2,000,155.00	0.60
13	海南夯牛私募基金管理有限公司—夯牛开元私募证券投资基金	2,000,155.00	0.60

## 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：周易

3、总裁：杨小松

4、注册资本：3.6172 亿元人民币

5、住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

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 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）1.72%、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）2.24%、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）2.25%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.32%。

### 10、内部组织结构及职能：

公司以股东、基金持有人、委托人以及相关受益人利益最大化为目标，构建了一整套赖以指导和控制公司运作的组织运营架构。在董事会和专业委员会管理之下，公司搭建了包括零售群、机构群以及投研部门、市场部门、后台运营部门等为主要结构的矩阵式组织运营架构。各部门主要职责如下：

其中，投研部门主要负责投资管理、投资研究、投资交易等相关工作，具体部门职责如下：

部门名称	主要职责
权益投资部	1. 负责权益产品的投资管理； 2. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作； 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作。
固定收益投资部	1. 负责固定收益产品的投资管理； 2. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作； 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作。
混合资产投资部	1. 负责“固收+”（固定收益资产投资+其他资产投资统称“固收+”）策略的公募产品和混合策略的非公募产品（包括专户、社保、基本养老、企业年金、职业年金、养老金产品）的投资管理； 2. 配合做好大类资产配置研究； 3. 为产品设计与市场营销提供支持。
指数投资部	1. 负责被动指数公募产品的投资管理； 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； 3. 参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作； 4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作。

<b>现金及债券指数投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责货币、债券指数基金等公募产品的投资管理；</li> <li>参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作；</li> <li>配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作。</li> </ol>
<b>FOF 投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责 FOF 投资运作管理，包括公募 FOF、养老目标 FOF、专户 FOF；</li> <li>负责投顾业务组合运作管理，包括策略开发与组合运作、业务拓展、策略输出、投前投中投后顾问式服务；</li> <li>为公司内其他部门提供资产配置、产品布局、业务拓展、基金研究等投研支持与服务。</li> </ol>
<b>数量化投资部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>承担主动量化投资职能的统一归口管理；</li> <li>负责主动量化策略产品的投资管理；</li> <li>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；</li> <li>参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作；</li> <li>配合市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作。</li> </ol>
<b>国际业务部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责海外市场产品的研究、投资管理；</li> <li>参与产品创设过程，配合产品开发部完成产品研究、测试及维护工作；</li> <li>配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户推介工作。</li> </ol>
<b>基础设施基金投资管理部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责公开募集基础设施证券投资基金产品的研究、投资和运营管理工作；</li> <li>完成基础设施基金的业务承揽、产品创设等工作；</li> <li>配合市场销售相关部门进行媒体宣传及客户推介工作。</li> </ol>
<b>权益研究部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>及时更新和维护股票池、研究数据以及研究模型；</li> <li>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；</li> <li>向销售市场相关部门提供研究支持服务。</li> </ol>
<b>固定收益研究部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>向全国社保理事会提供支持服务；</li> <li>向销售市场相关部门提供研究支持服务。</li> </ol>
<b>宏观策略部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责公司标准化研究资源的整合与共享；</li> <li>负责宏观研究和大类资产配置策略研究；</li> <li>为各投研部门、市场部门提供投资决策依据和营销支持。</li> </ol>
<b>交易管理部</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>负责组合交易和交易执行等策略的研究和制定；</li> <li>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；</li> <li>负责交易分析和新产品持续研究，提供相关交易支持。</li> </ol>

市场部门主要负责为所服务的客户群体开展市场营销、客户服务及产品开发工作，其中具体部门职责如下：

部门名称	主要职责
<b>零售服务部</b>	1. 根据公司的业务发展需要，负责公司零售业务条线统一规划、部署

	<p>的推动执行职能，对分公司零售业务工作实施条线垂直管理；</p> <p>2. 进行零售业务的合作渠道开发、维护和管理，为分公司提供培训、服务和支持，促进公募基金、零售专户等产品的销售、业务的拓展；</p> <p>3. 完成公司下达的经营任务。</p>
<b>机构服务部</b>	<p>1. 根据公司的业务发展需要，负责公司机构业务条线统一规划、部署的推动执行职能，对分公司机构业务工作实施条线垂直管理；</p> <p>2. 根据公司经营目标和营销战略，进行公司机构客户公募业务、专户业务的营销策划、销售发动、营销支持、营销推动、赋能一线和投后服务等工作；</p> <p>3. 完成公司下达的经营任务。</p>
<b>网络金融部</b>	<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>
<b>证券公司业务部</b>	<p>1. 根据公司经营目标，全面负责证券公司客户相关业务的统一规划和部署，实现与证券公司“总部对总部”的对接合作，为证券公司的各项业务需求提供全面综合的服务，并维护与证券公司的良好合作关系；</p> <p>2. 根据公司营销战略，针对证券公司的渠道进行开发与服务，开展渠道管理、产品销售与服务、营销策划与支持等各项工作；</p> <p>3. 提高公司对证券公司客户的服务质量与效果，提升证券公司渠道的销售规模与市场份额，完成公司对证券公司客户相关业务下达的各项经营任务。</p>
<b>战略客户部</b>	<p>1. 根据公司整体经营目标，整合公司资源，针对战略客户提供全面综合的资产管理及研究支持服务；</p> <p>2. 开展公募、专户和创新业务的开拓与营销，维护与战略客户的良好合作关系，提高战略客户资产保有规模，完成公司下达的经营任务指标。</p>
<b>养老金业务部</b>	<p>1. 负责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>
<b>客户关系部</b>	<p>1. 建立客户沟通平台，为客户提供专业理财咨询服务；收集客户需求和建义，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>
<b>北京、上海、深圳、南京、成都分公司</b>	<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. 为公司在当地业务的开展提供保障支持服务；</p> <p>4. 完成公司下达的预算指标和利润指标。</p>
<b>合肥分公司（理财中心）</b>	<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>*合肥理财中心隶属客户关系部</p>
<b>可持续发展部</b>	<p>1. 负责公司企业文化建设、ESG 等可持续发展事务的研究与推广；</p>

	2. 负责公司品牌形象规划与实施，打造品牌的可持续发展性； 3. 负责销售、宣传、活动等创意策划； 4. 为公司销售前台做好营销支持，提高公司的公众认知度和美誉度。
<b>产品开发部</b>	1. 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； 2. 负责公司创新业务的研究及孵化工作； 3. 负责产品的立项、制作、报批、日常管理与维护工作。

后台运营部门主要包括数智科技部、运作保障部、风险管理部、监察稽核部、办公室（党委办公室）、人力资源部（党委组织部）、财务部，主要负责数智化建设、运作保障、合规与风险管理、财务行政与人力党群等工作。

#### 11、人员情况：

截至 2025 年 8 月，我公司共有员工 1091 人，博士 30 人、硕士 905 人、本科 150 人、其他 6 人。

#### 12、信息披露负责人：鲍文革

咨询电话：400-889-8899

#### 13、基金管理业务情况简介：

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

公司股权结构稳定，公司主要股东为华泰证券股份有限公司（41.16%）、深圳市投资控股有限公司（27.44%）、厦门国际信托有限公司（13.72%）和兴业证券股份有限公司（9.15%）。

南方基金总部设在深圳，北京、上海、深圳、南京、成都、合肥六地设有分公司，在深圳和香港设有子公司——南方资本管理有限公司（深圳子公司）和南方东英资产管理有限公司（香港子公司）。南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金资产管理规模、旗下公募基金产品累计盈利和分红均位居行业前列，产品涵盖股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、QDII 型、FOF 型等。经过 27 年的发展，南方基金已成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 14、本基金基金经理简介

本基金的基金经理为张其思、叶震南。

张其思先生，波士顿大学数理金融硕士，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），具有基金从业资格。曾就职于美国 Charles River Development、Citizens Financial Group，历任固定收益部分析员、资本管理部量化分析师。2017 年 4 月加入南方基金，历任数量化投资部研究员、指数投资部研究员、国际业务部研究员。2020 年 6 月 2 日至 2021 年 3 月 26 日，任南方原油基金经理助理；2021 年 3 月 26 日至今，任南方道琼斯美国精选 REIT 指数（QDII-LOF）、南方原油（QDII-FOF-LOF）基金经理；2022 年 11 月 29 日至今，任南

方纳斯达克 100 指数发起 (QDII) 基金经理; 2024 年 5 月 21 日至今, 任南方恒生科技指数发起 (QDII) 基金经理; 2025 年 3 月 7 日至今, 任南方标普 500ETF (QDII) 基金经理; 2025 年 4 月 11 日至今, 任南方顶峰 TOPIX ETF (QDII)、南方基金南方东英沙特阿拉伯 ETF (QDII)、南方中证香港科技 ETF (QDII) 基金经理; 2025 年 4 月 18 日至今, 任南方基金南方东英富时亚太低碳精选 ETF (QDII)、南方富时亚太低碳精选 ETF 发起联接 (QDII) 基金经理; 2025 年 6 月 6 日至今, 任南方港股数字经济混合发起 (QDII) 基金经理; 2025 年 9 月 12 日至今, 任南方国证港股通创新药 ETF 基金经理。

叶震南先生, 厦门大学财务学专业硕士, 金融风险管理师 (FRM), 具有基金从业资格。2018 年 7 月加入南方基金, 任国际业务部研究员; 2022 年 3 月 4 日至 2023 年 10 月 24 日, 任南方中国新兴经济 9 个月持有期混合 (QDII) 基金经理助理; 2023 年 10 月 24 日至今, 任南方港股医药行业混合发起 (QDII) 基金经理; 2025 年 9 月 12 日至今, 任南方国证港股通创新药 ETF 基金经理。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人情况

名称: 中信建投证券股份有限公司 (以下简称“中信建投证券”)

住所: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人: 刘成

联系人: 邱珂磊

联系电话: 010-56135357

办公地址: 北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层/18 层, 北京市朝阳区光华路 10 号院中信大厦 82 层

成立时间: 2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号: 中国证监会证监机构字[2005]112 号

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 人民币 77.57 亿元

存续期间: 持续经营

基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监许可【2015】219 号

中信建投证券成立于 2005 年 11 月 2 日, 是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证券公司。公司注册于北京, 注册资本 77.57 亿元, 并设有中信建投期货有限公司、中信建投资本管理有限公司、中信建投(国际)金融控股有限公司、中信建投基金管理有限公司、中信建投投资有限公司等 5 家子公司。自成立以来, 中信建投证券各项业务快速发展, 在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券金融、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势, 并搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险管理、合规管理等专业高效的业务支持体系。凭借高度的敬业精神与突出的专业能力, 中信建投证券主

要业务指标及盈利能力目前均位居行业前列。

## 2、基金托管部门及主要人员情况

中信建投证券托管部管理团队和业务骨干具有丰富的证券投资基金托管业务运作经验，业务人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，可为托管客户提供个性化产品处理能力。

## 3、证券投资基金托管情况

中信建投证券于2015年2月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，中信建投证券始终遵循“诚信、专注、成长、共赢”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护基金份额持有人的合法权益，为基金份额持有人提供高质量的托管服务。

## 4、基金托管人的内部控制制度

### （1）内部控制目标

严格遵守国家有关法律、法规、监管规则和公司内部规章制度，防范和化解基金托管业务经营风险，确保托管资产的完整和安全，切实保护基金份额持有人权益，确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律、法规、监管规则及相关合同、协议的规定，查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证托管业务安全、有效、稳健运行。

### （2）内部控制组织结构

中信建投证券设有风险管理委员会，负责全公司风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内控稽核岗，配备专职监察稽核人员，在托管部行政负责人的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

### （3）内部控制制度及措施

中信建投证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保障托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

## 5、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （1）监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

### （2）监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和托

管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会

（三）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、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：高鹤、邓雯

联系人：高鹤

## 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。

南方国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 9 月 15 日资产负债表（未经审计）如下：

资产	本期末 2025 年 09 月 15 日
资产：	-
货币资金	335,421,124.06
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	48,682,892.69
其中：股票投资	48,682,892.69
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	-
债权资产支持证券投资	-
债权其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	17,642.00
资产总计	384,121,658.75
负债和净资产	本期末 2025 年 09 月 15 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	48,434,332.10
应付赎回款	-

应付管理人报酬	4,135.35
应付托管费	1,378.45
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	1,153.16
负债合计	48,440,999.06
净资产：	-
实收基金	335,418,642.00
其他综合收益	-
未分配利润	262,017.69
净资产合计	335,680,659.69
负债和净资产总计	384,121,658.75

注：报告截止日 2025 年 9 月 15 日，基金份额净值 1.0008 元，基金份额总额 335,418,642.00 份。

## 八、 基金投资组合

本基金目前仍处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。截止到 2025 年 9 月 15 日，南方国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金的投资组合如下：

### 8.1 基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	48,682,892.69	12.67
	其中：股票	48,682,892.69	12.67
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	335,421,124.06	87.32
8	其他各项资产	17,642.00	0.00
9	合计	384,121,658.75	100.00

### 8.2 按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例 (%)
能源		
材料		
工业		
非必需消费品		
必需消费品		
医疗保健	48,682,892.69	14.50
金融		
科技		
通讯		
公用事业		

房地产		
政府		
合计	48,682,892.69	14.50

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有积极投资的股票。

## 8.3 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

### 8.3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	06160	百济神州	27,200	4,968,406.40	1.48
2	01177	中国生物制药	621,000	4,945,683.25	1.47
3	01801	信达生物	55,500	4,845,840.20	1.44
4	09926	康方生物	39,000	4,591,300.70	1.37
5	01093	石药集团	424,000	4,081,545.86	1.22
6	01530	三生制药	127,000	3,711,691.84	1.11
7	03692	翰森制药	78,000	2,583,096.41	0.77
8	06990	科伦博泰生物-B	3,600	1,673,549.24	0.50
9	01548	金斯瑞生物科技	84,000	1,308,042.58	0.39
10	00867	康哲药业	89,000	1,242,028.54	0.37

### 8.3.2 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

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有境内积极投资股票。

## 8.4 按债券品种分类的债券投资组合

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有债券投资。

## 8.5 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

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有债券投资。

## 8.6 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

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有资产支持证券。

## 8.7 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

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有贵金属。

## 8.8 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

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有贵金属。

## 8.9 本基金投资的股指期货交易情况说明

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有股指期货。

### 8.9.1 本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有股指期货。

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 8.10 投资组合报告附注

**8.10.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。**

基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.10.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。**

本基金投资的前十名股票（如有）没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 8.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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	-
6	其他应收款	17,642.00

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,642.00

#### 8.10.4 持有的处于转股期的可转换债券明细

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.10.5 前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.10.5.1 指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有流通受限股票。

##### 8.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截止 2025 年 9 月 15 日，本基金未持有积极投资股票。

## 九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

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

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

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就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《证券投资基金法》、《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《证券投资基金法》、《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；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将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国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- (二)《南方国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三)《南方国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四)《南方国证港股通创新药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

2025年9月17日

**附件：基金合同摘要**

## 一、基金合同当事人的权利、义务

## (一) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券和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、赎回和非交易过户等业务规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金相关费率结构和收费方式；
- (17) 自行或委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

- (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、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并披露基金净值信息，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，但依法向监管机构、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不少于法律法规规定的最低年限；
  - (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内发出，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前提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，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金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，但依法向监管机构、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、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；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法律法规规定的最低年限；

(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；

(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、《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。

### (三) 基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件;
- (2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;
- (3) 关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
- (4) 缴纳基金认购款项、应付申购对价及法律法规和《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。除基金合同另有约定外，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 ETF 的联接基金的基金合同生效后，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份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金的基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。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。

#### （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，但本基金合同另有约定的除外；
- （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) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、变更收费方式；
- (3) 基金管理人、相关证券交易所、登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户、信息披露等业务的规则，基金推出新业务或服务；
- (4) 增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整；
- (5) 因相应的法律法规、深圳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；
- (6) 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；
- (7) 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，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

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

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

### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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、在法律法规或监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规或监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其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。除基金合同另有约定外，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。

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

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则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、在符合有关基金分红条件的前提下，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基金管理人发布的公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、基金管理人可每季度评估是否进行收益分配。基金管理人可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，在符合基金收益分配条件下，可安排收益分配。收益分配条件、评估时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

3、本基金的收益分配方式为现金分红；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整。

#### （四）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。

#### （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日内在规定媒介公告。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

### 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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

- 4、《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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货/期权交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市初费及年费；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、因参与融资及转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；
- 11、因投资港股通股票而产生的各项合理费用；
- 12、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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式从基金财产中支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式从基金财产中支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—12 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。

## 五、基金财产的投资范围和投资限制

### （一）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通股票”）、存托凭证，下同）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、创业板、

科创板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票、港股通股票、存托凭证)、金融衍生品(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金根据相关规定可参与融资、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。

在建仓完成后,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 90%,且不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

## (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 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;

(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) 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;

(9) 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；

(10) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(11) 本基金参与金融衍生品交易，每个交易日日终，在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，本基金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、应收申购款等；

(12) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，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%；

4) 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；

5) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(13) 本基金参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

1) 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%；

2) 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；

3) 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；

(14) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的 30%，其中出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 本基金在任何交易日日终，参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

3) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按市值加权平均计算；

4) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

(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，法律法规或监管部门另有要求的除外；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第（6）、（8）、（9）、（14）项另有约定外，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。

本基金参与转融通证券出借业务，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第（14）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

基金管理人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。期间，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。

## 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）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，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。

如法律法规或监管部门对上述限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律、行政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。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

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。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。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定披露。

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，由基金管理人按规定对外公布。

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于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，经履行适当程序，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。

### （二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请符合《证券法》规定的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。

6、基金管理人与基金托管人协商一致或基金财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符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### (七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。

### 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深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市，仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费、律师费由败诉方承担。

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（为《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。

#### 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》正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，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。