

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市日期：2021 年 2 月 3 日

公告日期：2021 年 1 月 29 日

目录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的历史沿革与上市交易.....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	4
五、基金主要当事人简介.....	5
六、基金合同摘要.....	9
七、基金财务状况.....	9
八、基金投资组合.....	10
九、重大事件揭示.....	15
十、基金管理人承诺.....	15
十一、基金托管人承诺.....	15
十二、基金上市推荐人意见.....	16
十三、备查文件目录.....	16
附件：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）基金合同摘要.....	17

一、重要声明与提示

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“基金法”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制, 本基金管理人的董事会及董事保证本报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。

本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性, 承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见, 均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容, 请投资者详细查阅登载于本基金管理人网站 (www.citicprufunds.com.cn) 的本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

二、基金概览

- 1、基金名称: 中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)
- 2、基金类型: 股票型
- 3、基金运作方式: 契约型、开放式
- 4、基金存续期限: 不定期
- 5、基金份额总额: 截至 2021 年 1 月 27 日, 本基金的基金份额总额为 110,250,328.64 份。
- 6、基金份额净值: 截至 2021 年 1 月 27 日, 本基金的基金份额净值为 1.542 元。
- 7、本次上市交易的基金份额简称及代码: 信诚 500, 交易代码: 165511
- 8、本基金本次上市交易的基金份额总额: 22,893,800.00 份 (截至 2021 年 1 月 27 日)
- 9、上市交易的证券交易所: 深圳证券交易所
- 10、上市交易日期: 2021 年 2 月 3 日
- 11、基金管理人: 中信保诚基金管理有限公司
- 12、基金托管人: 中国建设银行股份有限公司
- 13、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

三、基金的历史沿革与上市交易

(一) 本基金的历史沿革

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 由信诚中证 500 指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

信诚中证 500 指数分级证券投资基金经中国证监会 2010 年 12 月 20 日《关于核准信诚中证 500

指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1877号）的核准，于2011年1月6日至2011年1月28日期间进行公开募集。募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认（基金部函[2011]69号），《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》于2011年2月11日起正式生效。基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》约定，信诚中证500指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止信诚中证500A份额与信诚中证500B份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于2020年12月2日在指定媒介发布《信诚中证500指数分级证券投资基金之A类份额和B类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请信诚中证500指数分级证券投资基金的两级子份额退市，并于2020年12月31日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《中信保诚中证500指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《信诚中证500指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

根据《信诚中证500指数分级证券投资基金之A类份额和B类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，以2020年12月31日为份额折算基准日，基金管理人对该日登记在册的信诚中证500A份额和信诚中证500B份额办理向场内信诚中证500份额折算的业务，并于2021年1月5日在中国证监会规定媒介上发布了《关于信诚中证500指数分级证券投资基金之信诚中证500A份额和信诚中证500B份额基金份额折算结果的公告》。

（二）基金份额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[2021]138号
- 2、上市交易日期：2021年2月3日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 4、本次上市交易的基金场内简称：信诚500
- 5、本次上市交易的基金交易代码：165511
- 6、本次上市交易的基金份额总额：22,893,800.00份（截至2021年1月27日）
- 7、基金份额净值的披露：每个交易日的次日公布基金的基金份额净值，并在深交所行情发布系统揭示。
- 8、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场外的份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）基金份额持有人户数

截至2021年1月27日，本基金份额持有人总户数为46,730.00户，其中场内持有人户数

为 7,192.00 户，场外持有人户数为 39,538.00 户；场内基金份额持有人平均每户持有的本基金场内基金份额为 3,183.23 份。

（二）基金份额持有人结构

截至 2021 年 1 月 27 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的本基金份额 1,693,452.66 份，占比 1.54%；个人投资者持有的本基金份额 108,556,875.98 份，占比 98.46%

其中，场内基金份额持有人结构如下：

场内机构投资者持有的本基金场内基金份额 1,693,452.00 份，占比 1.54%；场内个人投资者持有的本基金场内基金份额 21,200,348.00 份，占比 19.23%。

场外基金份额持有人结构如下：

场外机构投资者持有的本基金场外基金份额 0.66 份，占比 0.00%；场外个人投资者持有的本基金场外基金份额 87,356,527.98 份，占比 79.23%。

（三）截至 2021 年 1 月 27 日，本基金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（份）	占场内总份额的比例（%）
1	安信证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	728,116.00	3.18
2	广州市广百股份有限公司	460,843.00	2.01
3	杨胜华	414,335.00	1.81
4	张凤英	407,339.00	1.78
5	加建民	406,000.00	1.77
6	杨晓梅	364,750.00	1.59
7	段肖力	304,000.00	1.33
8	余方	243,948.00	1.07
9	冯建强	231,239.00	1.01
10	隋熙凤	219,734.00	0.96
合计		3,780,304.00	16.51

（四）截至 2021 年 1 月 27 日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 109,608.84 份，占该基金总份额的比例为 0.10%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为 27,379.69 份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为 0 份。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：中信保诚基金管理有限公司
- 2、法定代表人：张翔燕
- 3、总经理：唐世春

4、注册资本：2 亿元人民币

5、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

6、设立日期：2005 年 9 月 30 日

7、设立批准文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142 号

8、工商登记注册的法人营业执照文号：91310000717858768L

9、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务

10、股东及持股比例：公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。

11、内部组织结构及职能：投研交条线：包括权益投资部、固定收益部、量化部、量化二部、多策略与投资组合部、投行部、特定资产投资部、研究部、交易部。主要负责权益投资、研究；固定收益投资、研究；量化投资、研究；FOF 投资、研究；投行业务开发、拓展及定增产品投资；特定资产投资；宏观经济、行业、上市公司等研究；交易执行工作。

市场条线：包括渠道部、机构一部、机构二部、电子商务部、产品部、营销策划部。主要负责渠道销售；机构客户的开发和维护；维护并持续开发公司网站和网上交易系统、同时进行网站内容的建设和网络推广及网络销售；新产品的的设计、报批及产品运作中部分牵头；公司产品的宣传推广方案设计并组织实施、公司品牌管理工作。（或：主要负责渠道业务、机构业务、电商业务、产品、营销策划与支持和服务等工作。）

大后台：包括基金运营部、信息技术部、人力资源部、财务部、监察稽核部、风险管理部。负责公司基金运营；软件开发及系统维护；人力资源管理；财务计划与管理；法务合规、风险管理等相关工作。

12、人员情况：截止 2021 年 1 月 27 日，公司共有员工 186 名，其中 69%具有硕士及以上学历。

13、本基金的基金经理：黄稚女士，理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司，担任资产管理部产品经理；于平安证券有限责任公司，担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任金融工程师、基金经理助理。现任中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）、信诚中证基建工程指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金（LOF）、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”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，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

4、基金托管人的内部控制制度

（1）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

（2）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行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。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（3）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业

务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

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

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(2) 监督流程

1) 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2) 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

(三) 基金验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼八层

办公地址：北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼八层

法定代表人：邹俊

电话：862122122888

传真：862162881889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：黄小熠、叶凯韵

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

本基金基金合同生效后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

中信保诚中证500指数型证券投资基金(LOF)2021年1月27日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产	报告期末 2021 年 1 月 27 日
资产:	
银行存款	12,171,923.67
结算备付金	1,588,172.54
存出保证金	419,199.72
交易性金融资产	158,446,994.44
其中: 股票投资	158,438,994.44
基金投资	-
债券投资	8,000.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	189,754.79
应收利息	6,357.97
应收股利	-
应收申购款	465,965.64
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	173,288,368.77
负债和所有者权益	报告期末 2021 年 1 月 27 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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	2,590,827.92
应付管理人报酬	135,437.48
应付托管费	29,796.25
应付销售服务费	-
应付交易费用	156,072.73
应交税费	3,930.22
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	402,416.27
负债合计	3,318,480.87
所有者权益:	
实收基金	85,631,094.15
未分配利润	84,338,793.75
所有者权益合计	169,969,887.90
负债和所有者权益总计	173,288,368.77

八、基金投资组合

截至 2021 年 1 月 27 日 (报告期末), 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	158,438,994.44	91.43
	其中：股票	158,438,994.44	91.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,000.00	0.00
	其中：债券	8,000.00	0.00
	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	13,760,096.21	7.94
8	其他资产	1,081,278.12	0.62
9	合计	173,288,368.77	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境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,198,609.80	0.71
B	采矿业	4,700,677.54	2.77
C	制造业	104,709,187.41	61.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,283,928.10	1.93
E	建筑业	2,096,288.00	1.23
F	批发和零售业	5,560,219.65	3.27
G	交通运输、仓储和邮政业	2,670,944.08	1.57
H	住宿和餐饮业	689,388.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,650,679.17	6.85
J	金融业	8,209,753.40	4.83
K	房地产业	3,945,316.16	2.32
L	租赁和商务服务业	1,575,069.20	0.93
M	科学研究和技术服务业	1,434,381.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	1,342,279.41	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0.00
P	教育	71,688.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,752,798.00	1.03
R	文化、体育和娱乐业	1,156,992.00	0.68
S	综合	733,578.00	0.43
	合计	156,781,776.92	92.24

2、报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	1,363,115.55	0.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,011.84	0.01
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	18,435.96	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,987.51	0.06
J	金融业	80,921.76	0.05
K	房地产业	7,983.21	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	50,007.40	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	4,699.44	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,054.85	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	1,657,217.52	0.98

3、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

(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

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	300274	阳光电源	27,400	2,863,300.00	1.68
2	600089	特变电工	99,000	1,401,840.00	0.82
3	600143	金发科技	48,000	1,387,200.00	0.82
4	300012	华测检测	44,600	1,286,264.00	0.76
5	600426	华鲁恒升	30,400	1,271,632.00	0.75
6	603882	金域医学	7,300	1,248,592.00	0.73
7	300496	中科创达	7,900	1,186,975.00	0.70
8	002074	国轩高科	27,400	1,145,320.00	0.67
9	300285	国瓷材料	20,600	1,039,270.00	0.61
10	601233	桐昆股份	40,800	1,023,264.00	0.60

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

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	688063	派能科技	1,288	290,057.60	0.17
2	688686	奥普特	854	249,154.50	0.15
3	688595	芯海科技	2,643	147,320.82	0.09

4	300869	康泰医学	862	91,527.16	0.05
5	688229	博睿数据	730	83,256.50	0.05

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,000.00	0.00

(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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113621	彤程转债	80	8,000.00	0.00

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

(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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2106	IC2106	2	2,489,280.00	120,480.00	-
公允价值变动总额合计(元)					120,480.00
股指期货投资本期收益(元)					0.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					46,912.62

注:按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。

2、本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。

(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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

(十一) 投资组合报告附注

1、基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体均没有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。

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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	419,199.72
2	应收证券清算款	189,754.79
3	应收股利	-
4	应收利息	6,357.97
5	应收申购款	465,965.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,081,278.12

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

本基金本报告期末持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688063	派能科技	290,057.60	0.17	锁定期股票
2	688686	奥普特	249,154.50	0.15	锁定期股票
3	688595	芯海科技	147,320.82	0.09	锁定期股票
4	300869	康泰医学	91,527.16	0.05	锁定期股票
5	688229	博睿数据	83,256.50	0.05	锁定期股票

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前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、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之后履行托管人职责做出如下承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，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，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、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三) 基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的

规定,将及时以书面形式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关重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

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

(一) 备查文件目录

- 1、中国证监会核准信诚中证 500 指数分级证券投资基金募集的文件
- 2、原《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》
- 3、原《信诚中证 500 指数分级证券投资基金托管协议》
- 4、《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- 5、《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- 6、关于申请募集信诚中证 500 指数分级证券投资基金之法律意见书
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 8、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点: 中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

(三) 查阅方式:

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅,也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2021 年 1 月 29 日

附件：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一) 基金份额持有人的权利

投资人购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，投资人自取得依据《基金合同》募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》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。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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；
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. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

(二) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 提供基金管理人和监管机构要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；
3. 交纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
4. 在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；
5. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
6. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
7. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
8. 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(三) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3. 销售基金份额；
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理基金份额申购和赎回申请；
8. 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；
9. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13. 依法召集基金份额持有人大会；
14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(四) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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、勤勉尽责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，确保所管理的基金财产和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.计算并公告基金份额净值、确定基金份额的申购、赎回价格；
- 9.采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10.按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12.编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 13.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；
- 14.保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- 15.按照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收益；
- 16.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；
- 17.依据《基金法》等的规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 18.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者实施其他法律行为；
- 19.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；
- 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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21.基金托管人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托管人追偿；
- 22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- 23.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；
- 24.执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 26.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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(五)基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- 1.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收入；

2. 监督基金管理人对本基金的投资运作;
3. 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;
4. 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;

5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

6. 依法召集基金份额持有人大会;
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料;
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(六) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的义务为:

1. 安全保管基金财产;
2. 设立专门的基金托管部, 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. 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立;
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得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;
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应予保密, 不得向他人泄露;
8. 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;
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
10. 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;
11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额的申购、赎回价格;
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作;
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
15. 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款项;

16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17.因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19.参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；

20.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；

21.执行生效的基金份额持有人大会决议；

22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23.建立并保存基金份额持有人名册；

24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(七)基金合同当事各方的权利义务以基金合同为依据，不因基金财产账户名称变更而有所改变。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表在授权范围内有权代表基金份额持有人在基金份额持有人大会中行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(二)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)转换基金运作方式；

(3)变更基金类别；

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；

(5)变更基金份额持有人大会程序；

(6)更换基金管理人、基金托管人；

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

(8)本基金与其他基金的合并；

(9)终止基金份额的上市，但因本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；

(10)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同或其他相关法律文件,不需召开基金份额持有人大会:

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率;

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(5)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;

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(三)召集人和召集方式

1.除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时,由基金托管人召集。

2.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,应当自行召集。

3.单独或合计持有基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项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,单独或合计持有基金份额10%以上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。

4.单独或合计持有基金份额10%以上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,单独或合计持有基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5.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。

(四)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.基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前30日在指定媒介公告。

基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

- (1)会议召开的时间、地点和出席方式;
- (2)会议拟审议的主要事项;
- (3)会议形式;
- (4)议事程序;
- (5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日;
- (6)代理投票的授权委托书的内容要求(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;
- (7)表决方式;
- (8)会务常设联系人姓名、电话;
- (9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (10)召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。在法律法规和监管机构允许的情况下,表决方式亦可采用网上表决、电话表决等其他表决方式。

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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人经有效通知而拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

(五)基金份额持有人出席会议的方式

1.会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

(3)通讯方式开会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提交至召集人指定的地址或系统。通讯方式开会应按照本基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式进行表决。

(4)会议的召开方式由召集人确定,但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

2. 召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金份额的50%以上(含50%，下同)；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

(2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经有效通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金份额的50%以上

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

(六) 议事内容与程序

1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提

案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4)单独或合并持有权益登记日基金份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2)通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3.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。

(七)决议形成的条件、表决方式、程序

1.基金份额持有人所持每一基金份额有一票表决权。

2.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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)各自所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)各自所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会决定的事项,应当在五日内依法报中国证监会核准或者备案,并予以公告。

4.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,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.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。

(八)计票

1.现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则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推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,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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3)如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议

意见之日起生效。

2.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。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决议。

3.基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒介公告。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。

(十)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

三、基金合同解除和终止的事由、程序

(一)本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

1.基金份额持有人大会决定终止的;

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;

4.中国证监会规定的其他情况。

(二)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1)基金合同终止之日起30个工作日内,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

2.基金财产清算程序

基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:

(1)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;

(2)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;

(3)对基金财产进行清理和确认;

(4)对基金财产进行估价和变现;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;

- (6)聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁;
- (9)公布基金财产清算结果;
- (10)对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

4.基金财产按下列顺序清偿:

- (1)支付清算费用;
- (2)交纳所欠税款;
- (3)清偿基金债务;
- (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前,不得分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

6.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。

四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,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,对各方当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

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。

五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。