

南方上海金交易型开放式证券投资基金 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：二〇二二年三月十一日

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 | 16 |
| 七、 | 基金财务状况 | 17 |
| 八、 | 基金投资组合 | 18 |
| 九、 | 重大事件揭示 | 21 |
| 十、 | 基金管理人承诺 | 22 |
| 十一、 | 基金托管人承诺 | 23 |
| 十二、 | 基金上市推荐人意见 | 24 |
| 十三、 | 备查文件目录 | 25 |
| 附件： | 基金合同摘要 | 26 |

一、 重要声明与提示

《南方上海金交易型开放式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，南方上海金交易型开放式证券投资基金（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上海金交易型开放式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2021年12月15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）上公告的《南方上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书》。

二、 基金概览

- 1、基金名称：南方上海金交易型开放式证券投资基金
- 2、基金简称及场内简称：南方上海金 ETF（场内简称：金 ETF）
- 3、基金代码：159834
- 4、基金份额总额：113,561,376.00 份（截止：2022 年 3 月 9 日）
- 5、基金份额净值：4.0953 元（截止：2022 年 3 月 9 日）
- 6、本次上市交易份额：113,561,376.00 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：2022 年 3 月 16 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、申购赎回代理机构：

（1）现金申购赎回代理机构：华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、方正证券股份有限公司（排名不分先后）。

（2）黄金现货实盘合约申购赎回代理机构：华泰证券股份有限公司。

基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代理机构。

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：中国证监会 2020 年 11 月 11 日证监许可(2020)3027 号文准予募集注册，中国证监会证券基金机构监管部 2021 年 9 月 30 日机构部函(2021)3153 号文准予延期募集

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：2021 年 12 月 20 日至 2022 年 2 月 28 日。本次发售开通网上现金认购、网下现金认购、黄金现货实盘合约认购 3 种方式。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售期限：45 个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购、黄金现货实盘合约认购。

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：国信证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、长江证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司（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、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、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、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、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、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、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、申万宏源证券、申万宏源西部证券、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、网信证券、五矿证券、西部证券、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、甬兴证券、粤开证券、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：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

南方上海金交易型开放式证券投资基金于 2021 年 12 月 20 日至 2022 年 2 月 28 日公开募集，基金募集工作已于 2022 年 2 月 28 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 465,167,163.00 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 18,163.00 元人民币，按照本基金基金合同、招募说明书的约定，18,163.00 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 2022 年 3 月 3 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 6,436 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 465,167,163.00 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《南方上海金交易型开放式证券投资基金基金合同》、《南方上海金交易型开放式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 2022 年 3 月 3 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：2022 年 3 月 3 日

13、基金合同生效日的基金份额总额：465,167,163.00 份

14、基金份额折算

根据《南方上海金交易型开放式证券投资基金基金合同》、《南方上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书》和《关于南方上海金交易型开放式证券投资基金基金份额折算的公告》的有关规定，南方基金管理股份有限公司确定 2022 年 3 月 8 日为南方上海金交易型开放式证券投资基金的基金份额折算基准日。本次基金份额折算前基金份额总额为 465,167,163.00 份，折算前基金份额净值为 1.0000 元。

根据基金份额折算公式，本次基金份额折算比例为 0.244135668，折算后基金份额总额为 113,561,376.00 份，折算后基金份额净值为 4.0961 元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司于 2022 年 3 月 9 日完成了变更登记。

（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【2022】223 号
- 2、上市交易日期：2022 年 3 月 16 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：金 ETF
- 5、交易代码：159834
- 6、本次上市交易份额：113,561,376.00 份
- 7、基金资产净值的披露：每个工作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 2022 年 3 月 9 日，本基金持有人户数为 6,384 户，平均每户持有的基金份额为 17,788.44 份。

（二）持有人结构

截至 2022 年 3 月 9 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 92,875,147.00 份，占场内基金总份额的 81.78%。场内机构投资者持有的基金份额为 20,686,229.00 份，占场内基金总份额的 18.22%。

（三）截至 2022 年 3 月 9 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 | 申万宏源证券有限公司 | 7,812,813.00 | 6.88 |
| 2 | 上海季胜投资管理有限公司一季胜激光一号私募证券投资基金 | 2,441,427.00 | 2.15 |
| 3 | 广发期货有限公司 | 2,441,404.00 | 2.15 |
| 4 | 任建平 | 1,953,275.00 | 1.72 |
| 5 | 中国中金财富证券有限公司 | 1,953,142.00 | 1.72 |
| 6 | 王宁红 | 1,953,123.00 | 1.72 |
| 7 | 寻冬生 | 1,855,562.00 | 1.63 |
| 8 | 谭茂伟 | 1,757,920.00 | 1.55 |
| 9 | 招商证券股份有限公司 | 1,708,999.00 | 1.50 |
| 10 | 朱有芹 | 1,320,871.00 | 1.16 |

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：杨小松（代为履行法定代表人职责）
- 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、机构群以及权益投资条线、固定收益投资条线、资产配置条线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：

| 部门名称 | 主要职责 |
|-------|---|
| 宏观策略部 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 负责公司标准化研究资源的整合与共享 2. 负责宏观研究和大类资产配置策略研究 3. 为各投研部门、市场部门提供投资决策依据和营销支持 |
| 权益投资部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 |
| 权益研究部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 2. 及时更新和维护股票池、研究数据以及研究模型 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 4. 向销售市场相关部门提供研究支持服务 |

| | |
|--------------------|--|
| 指数投资部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 |
| 数量化投资部 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 承担主动量化投资职能的统一归口管理 2. 负责主动量化策略产品的投资管理 3. 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 4. 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 5. 配合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 | <ol style="list-style-type: none"> 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 |
| 现金投资部 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 负责货币、短期理财等公募产品的投资管理 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 |
| 固定收益研究部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 2. 向全国社保理事会提供支持服务 3. 向销售市场相关部门提供研究支持服务 |
| 基础设施基金投资管理部 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 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 2. 联合南方资本、产品开发部完成基础设施基金的业务承揽、产品创设等工作 3. 配合市场销售相关部门进行媒体宣传及客户推介工作 |
| 国际业务部 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 负责海外市场产品的研究、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 | <ol style="list-style-type: none"> 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 4. 二级部门 FOF 投资部负责 FOF 产品的投资管理及提供投顾策略的输出 |
| 产品开发部 | <ol style="list-style-type: none"> 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. 负责零售群、机构群产品的立项、制作、报批、日常管理与维护工作 |

| | |
|--------------------------|--|
| 零售服务部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 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，保障公司零售客户的资产管理规模持续发展 |
| 机构服务部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 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 3. 提高公司机构客户在公募业务和专户业务的市场份额，完成公司对上述业务下达的经营任务 |
| 战略客户部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 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 |
| 养老金业务部 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 负责专户业务线养老金业务的销售管理、资源共享整合 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 3. 对集团的养老金业务提供专业服务与支持 |
| 北京、上海、深圳、南京、成都分公司 | <ol style="list-style-type: none"> 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 2. 开展资产创设业务与另类产品交叉销售工作 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 4. 完成公司下达的预算指标和利润指标 |
| 合肥分公司（理财中心） | <ol style="list-style-type: none"> 1. 履行理财中心相关职能 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 3. 合肥理财中心隶属客户关系部 |
| 网络金融部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 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 |
| 可持续发展部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 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 |

| | |
|------------------------|---|
| 客户关系部 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 建立客户沟通平台，为客户提供专业理财咨询服务；收集客户需求和意见，处理客户投诉 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 |
| 监察稽核部 | <ol style="list-style-type: none"> 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 2. 负责合规风险和除投研交易外的其他业务操作风险的组织协调与管理工作 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 | <ol 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统和投资监控体系 2. 负责市场风险、投研交易类操作风险、信用风险、流动性风险等风险的组织协调与管理工作，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. 提供风险管理金融工程方面的支持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 | <ol 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 | <ol 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 | <ol 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 | <ol 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 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 统筹集团层面的战略规划、组织评价、检查督办、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 | <ol 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 2022 年 1 月，我公司共有员工 817 人，博士 21 人、硕士 589 人、本科 193 人、其他 14 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：

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。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；南方资本下设南方股权子公司，主要从事私募股权投资业务。

截至 2021 年 12 月 31 日，南方基金母子公司合并资产管理规模 17610 亿元。其中南方基金母公司规模 16383 亿元，位居行业前列。南方基金公募基金规模 10564 亿元，客户数量 1.69 亿，累计向客户分红超过 1501 亿元，管理公募基金共 274 只，产品涵盖股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、QDII 型、FOF 型等。南方基金非公募业务规模 5819 亿元，在行业中持续保持优势地位。南方资本子公司规模 459 亿元，南方东英子公司规模 765 亿元。南方基金已发展成为产品种类丰富、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

孙伟先生，北京大学工商管理硕士，特许金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA），具有基金从业资格。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、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证

券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理。

龚涛先生，伦敦城市大学人工智能博士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于巴克莱资本（伦敦）、摩根大通（伦敦）、中信期货、华泰期货、易方达基金，历任中信期货量化研究团队负责人、华泰期货研究总监兼量化组负责人、易方达基金指数与量化投资部投资经理。2019 年 5 月加入南方基金指数投资部；2019 年 7 月 12 日至 2020 年 12 月 1 日，任互联基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方中证 100、南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任互联基金基金经理；2021 年 1 月 22 日至今，任新能源 ETF 基金经理；2021 年 8 月 24 日至今，任南方中证新能源联接基金经理；2021 年 9 月 29 日至今，任南方中证科技 100ETF 基金经理；2021 年 11 月 12 日至今，兼任投资经理；2021 年 11 月 15 日至今，任南方中证物联网主题 ETF 基金经理；2021 年 11 月 26 日至今，任长江保护主题 ETF 基金经理；2021 年 12 月 10 日至今，任南方上证科创板 50 成份 ETF 基金经理；2021 年 12 月 17 日至今，任南方富时中国国企开放共赢 ETF 基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理。

（二）基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

2、主要人员情况

截至 2021 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 214 人，平均年龄 34 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。

3、基金托管业务经营情况

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 2021 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1288 只。自 2003 年以来，本行连续十八年获得香港《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 80 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：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系人：曹阳

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：张振波、曹阳

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。

南方上海金交易型开放式证券投资基金 2022 年 3 月 9 日资产负债表如下：

| 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 | 34,949,000.00 | 短期借款 | 0.00 |
| 结算备付金 | 383,139,883.40 | 短期借款 | 0.00 |
| 存出保证金 | 24,576.00 | 交易性金融负债 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | - | 衍生金融负债 | 0.00 |
| 股票投资 | - | 卖出回购金融资产款 | 0.00 |
| 债券投资 | - | 应付证券清算款 | 409,600 |
| 资产支持证券投资 | - | 应付赎回款 | 0.00 |
| 贵金属投资 | 47,368,874.80 | 应付管理人报酬 | 38,232.33 |
| 权证投资 | - | 应付托管费 | 7,646.45 |
| 基金投资 | - | 应付销售服务费 | 0.00 |
| 衍生金融资产 | - | 应付投资顾问费 | - |
| 可供出售金融资产减值准备 | - | 应付交易费用 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | - | 应付税费 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | - | 应付利息 | 0.00 |
| 应收利息 | 27,133.49 | 应付利润 | 0.00 |
| 应收股利 | - | 应付代减持资产 | - |
| 应收申购款 | - | 其他负债 | 1,151.29 |
| 其他资产 | 18,163.00 | 负债合计 | 456,630.07 |
| | - | 所有者权益 | - |
| | - | 实收基金 | 465,167,163.00 |
| | - | 资本公积 | - |
| | - | 未分配利润 | -96,162.38 |
| | - | 所有者权益合计 | 465,071,000.62 |
| 资产总计 | 465,527,630.69 | 未分配负债和所有者权益合计利润 | 465,527,630.69 |

注：报告截止日 2022 年 3 月 9 日，基金份额净值 4.0953 元，基金份额总额 113,561,376.00 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 2022 年 3 月 9 日，南方上海金交易型开放式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（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-----------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | 47,368,874.80 | 10.18 |
| 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 | 418,088,883.40 | 89.81 |
| 8 | 其他资产 | 69,872.49 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 465,527,630.69 | 100.00 |

8.2 按行业类别分类的股票投资组合

8.3 按行业分类的境内股票投资组合

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有境内股票投资。

8.4 按行业分类的港股通投资股票投资组合

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有港股通股票投资。

8.5 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有境内股票投资。

8.6 按债券品种分类的债券投资组合

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有境内债券投资。

8.7 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有境内债券投资。

8.8 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有资产支持证券。

8.9 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

| 序号 | 贵金属代码 | 贵金属名称 | 数量（份） | 公允价值 （元） | 占基金资产 净值比例 （%） |
|----|-------|---------|---------|-------------------|----------------------|
| 1 | Au99 | Au99.99 | 113,010 | 46,953,394.8 0 | 10.10 |
| 2 | SHAU | SHAU | 1,000 | 415,480.00 | 0.09 |

8.10 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有权证。

8.11 本基金投资的股指期货交易情况说明

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有股指期货。

8.12 本基金投资的国债期货交易情况说明

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有国债期货。

8.13 投资组合报告附注

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。

本基金本报告期末投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

8.14 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 24,576.00 |

| | | |
|---|---------|-----------|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 27,133.49 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 18,163.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 69,872.49 |

8.14.1 持有的处于转股期的可转换债券明细

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有可转换债券。

8.14.2 前十名股票中存在流通受限情况的说明

截止 2022 年 3 月 9 日，本基金未持有流通受限股票。

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上海金交易型开放式证券投资基金注册的批复
- (二)《南方上海金交易型开放式证券投资基金基金合同》
- (三)《南方上海金交易型开放式证券投资基金托管协议》
- (四)《南方上海金交易型开放式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

2022年3月11日

附件：基金合同摘要**一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务****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权利，为基金的利益行使因基金财产投资于黄金现货合约和证券所产生的权利；
- (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；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商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除管理费率、托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
- (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净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、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低于法律法规规定的最低期限；

(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。对于基金募集期间已经过户的黄金现货实盘合约，应予以退还；

(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人的利益；

(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，为基金办理黄金现货合约、证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对

所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户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、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低于法律法规规定的最低期限；

（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》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。

（三）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）缴纳基金认购资金与黄金现货实盘合约、申购与赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由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。本基金份额持有人大会不设日常机构。

若以本基金为目标 ETF 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或委派代表参加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。

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

有人大会：

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式；
- （3）调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、收益分配、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、相关证券交易所、上海黄金交易所、登记机构、销售机构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、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。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 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

本基金以使收益分配后基金累计收益率尽可能贴近上海黄金交易所上海金集中定价合约同期累计收益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。本基金的收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的收益分配采用现金方式；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金收益评价日核定的本基金累计收益率超过上海黄金交易所上海金集中定价合约同期累计收益率达到 1%以上，本基金方可进行收益分配；基金收益分配数额的确定原则在招募说明书中列明；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金的收益分配每年至多 4 次；基金合同生效不满三个月，本基金收益可不分配；
- 5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（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、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金因黄金现货合约交易、结算、仓储以及在投资人申购、赎回基金份额过程中因黄金现货合约过户所承担的费用（包括但不限于交易手续费、租借手续费、延期补偿费、过户费、仓储费）以及其他交易费用；
- 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、基金的证券交易费用；
- 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、黄金账户的开户及维护费用；
- 11、基金的黄金租借业务及质押业务相关费用；
- 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 0.5% 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

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

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 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

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

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。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货合约（包括上海金集中定价合约、黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约等）等黄金品种、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种（包括但不限于挂钩黄金价格的远期合约、期货合约、期权合约、互换协议等衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于黄金现货合约的资产不低于基金资产的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

（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）本基金投资于黄金现货合约的资产不低于基金资产的 90%；

（2）本基金持有买入黄金现货延期交收合约价值不超过基金资产净值的 10%，持有买入黄金现货延期交收合约、黄金现货实盘合约及上海金集中定价合约的价值之和不得超过基金资产净值的 100%，持有卖出黄金现货延期交收合约价值不得超过基金持有黄金现货实盘合约及上海金集中定价合约价值之和的 10%；

（3）本基金参与黄金现货延期交收合约交易后，每个交易日日终，扣除黄金现货延期交收合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（4）本基金若参与黄金租赁，需满足以下限制：

1）黄金租赁的对手方仅限于上海黄金交易所金融类会员中的银行和分类评级在 A 类以上的证券公司；

2）本基金参与出借的黄金现货合约不超过基金资产净值的 30%，出借期限最长不超过 12 个月，平均剩余期限不超过 6 个月。出借给单个交易对手的黄金现货合约不超过基金资产净值的 10%；

3）本基金发生流动性问题时，基金管理人有权提前终止租赁协议，要求交易对手方归还黄金现货合约。

（5）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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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；

（10）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（11）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因黄金市场、证券市场波动、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；

(13) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(14) 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(9)、(12)、(13)项另有约定外，因黄金市场、证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、黄金现货合约流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

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

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。

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) 办理黄金实物的出入库业务；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政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，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

（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、《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、基金财产清算小组成员：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低于法律法规规定的最低期限。

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，对当事人均有约束力。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、基金合同存放地和投资人取得合同的方式

《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。

《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。