

易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金 （QDII）上市交易公告书

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市日期：2024年4月22日

公告日期：2024年4月17日

目录

一、重要声明与提示	3
二、基金概览.....	5
三、基金的募集与上市交易.....	6
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.....	8
六、基金合同摘要.....	12
七、基金财务状况.....	12
八、基金投资组合.....	13
九、重大事件揭示.....	18
十、基金管理人承诺.....	18
十一、基金托管人承诺.....	19
十二、基金上市推荐人意见.....	19
十三、备查文件目录.....	19
附件 1：一级交易商.....	21
附件 2：基金合同摘要.....	37

一、重要声明与提示

易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）上市交易公告书（以下简称“本报告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，易方达基金管理有限公司（以下简称“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。本基金托管人中国银行股份有限公司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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海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。凡本报告未涉及的有关内容，请详细阅读2024年3月21日刊登在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）以及基金管理人网站（www.efunds.com.cn）上的《易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）。

本基金投资于恒生指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%，其投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资有风险，投资者在投资本基金前，请认真阅读本基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，对投资基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中可能出现的各类风险。投资本基金可能遇到的主要风险包括：本基金特有风险、投资风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险及其他风险等。本基金特有风险包括：（1）投资境外市场的特有风险，包括境外地区市场风险、汇率风险、法律和政治风险、税务风险、会计风险、引入境外托管人的相关风险等；（2）指数化投资的风险，包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、部分成份股权重较大的风险、标的指数编制方案带来的风险、标的指数变更的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数值计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险等；（3）ETF运作的风险，包括投资于境外市场并以ETF方式运作的风险、IOPV计算错误的风险和投资者参考IOPV做出投资决策的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、成份股停牌的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、申购赎回清单中设置较低的申购/赎回份额上限的风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置不合理的风险、基

金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方机构服务的风险、退市风险等；（4）通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场股票的风险；（5）本基金投资特定品种或采用特定投资方式的特有风险，包括投资于期货、期权、外汇远期合约等金融衍生品等特定品种的特有风险、参与证券借贷/正回购/逆回购的风险、金融模型风险等。

本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。投资基金可能面临的一般风险及特有风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

此外，本基金主要投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。

本基金通过境内交易所进行的证券交易采用证券公司交易和结算模式，即本基金通过境内交易所进行的证券交易将通过基金管理人选定的证券经纪机构进行，并由选定的证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易和结算模式可能增加本基金投资运作过程中的信息系统风险、操作风险、交易指令传输和资金使用效率降低的风险、无法完成当日估值的风险、交易结算风险、基金投资非公开信息泄露的风险等。

当基金资产规模接近或达到外汇额度使用上限时，基金管理人有权暂停基金的申购，届时投资者可能面临申购失败的风险和基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。

根据本基金现行适用的清算交收和申赎处理规则，投资者当日申购的基金份额，清算交收完成后方可卖出和赎回，即 T 日申购的基金份额且日间完成 RTGS（实时逐笔全额结算）交收，T 日可卖出和赎回，而 T 日申购的基金份额且日终完成逐笔全额非担保交收，T+1 日方可卖出和赎回；T 日买入的基金份额，T 日可以赎回或卖出。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所和登记结算机构关于 ETF 的相关业务规则及其不时的更新，确保具备相关专业知识和清楚了解相关规则流程后方可参与本基金的申购、赎回及交易。投资者一旦申购或赎回本基金，即表示对基金申购和赎回所涉及的登记方式以及申购赎回所涉及现金替代、现金差额等相关的交收方式及业务规则已经认可。

本基金由易方达基金管理有限公司独立管理，未聘请境外投资顾问。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。

基金不同于银行储蓄，基金投资人投资于基金有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

二、基金概览

（一）基金名称与基金代码

易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

1. 基金代码：513210
2. 基金简称：易方达恒生 ETF（QDII）
3. 场内简称：恒生 E
4. 扩位证券简称：恒生 ETF 易方达

（二）基金份额总额：

2024 年 4 月 15 日，本基金总份额 319,942,000.00 份。

（三）基金份额净值：

2024 年 4 月 15 日，基金份额净值 0.9924 元。

（四）本次上市交易份额：319,942,000.00 份。

（五）上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

（六）上市交易日期：2024 年 4 月 22 日。

（七）基金管理人：易方达基金管理有限公司。

（八）基金托管人：中国银行股份有限公司。

（九）基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司。

（十）上市推荐人：广发证券股份有限公司。

（十一）目前，本基金的申购、赎回代办证券公司（以下简称“一级交易商”）如下：

序号	一级交易商	序号	一级交易商
1	渤海证券股份有限公司	28	华金证券股份有限公司
2	财达证券股份有限公司	29	华泰证券股份有限公司
3	财通证券股份有限公司	30	华鑫证券有限责任公司
4	德邦证券股份有限公司	31	江海证券有限公司
5	东北证券股份有限公司	32	开源证券股份有限公司
6	东方财富证券股份有限公司	33	联储证券股份有限公司
7	东方证券股份有限公司	34	平安证券股份有限公司
8	东莞证券股份有限公司	35	上海证券有限责任公司
9	东海证券股份有限公司	36	申万宏源西部证券有限公司
10	东吴证券股份有限公司	37	申万宏源证券有限公司

11	东兴证券股份有限公司	38	万联证券股份有限公司
12	方正证券股份有限公司	39	西部证券股份有限公司
13	光大证券股份有限公司	40	湘财证券股份有限公司
14	广发证券股份有限公司	41	信达证券股份有限公司
15	国海证券股份有限公司	42	兴业证券股份有限公司
16	国金证券股份有限公司	43	甬兴证券有限公司
17	国联证券股份有限公司	44	招商证券股份有限公司
18	国盛证券有限责任公司	45	浙商证券股份有限公司
19	国泰君安证券股份有限公司	46	中国银河证券股份有限公司
20	国投证券股份有限公司	47	中国中金财富证券有限公司
21	国新证券股份有限公司	48	中泰证券股份有限公司
22	国信证券股份有限公司	49	中信建投证券股份有限公司
23	海通证券股份有限公司	50	中信证券（山东）有限责任公司
24	恒泰证券股份有限公司	51	中信证券股份有限公司
25	华安证券股份有限公司	52	中信证券华南股份有限公司
26	华宝证券股份有限公司	53	中原证券股份有限公司
27	华福证券有限责任公司		

基金管理人可根据情况变更一级交易商，并在基金管理人网站公示。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1. 基金募集申请的注册机构和准予注册文号：2023 年 11 月 9 日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》（证监许可〔2023〕2522 号）。

2. 基金运作方式：交易型开放式。

3. 基金合同期限：不定期。

4. 发售方式：网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

5. 发售日期及发售期限：本基金自 2024 年 3 月 25 日至 2024 年 4 月 3 日进行发售，共 8 个工作日。其中网下现金认购的日期为 2024 年 3 月 25 日至 2024 年 4 月 3 日，网上现金认购的日期为 2024 年 3 月 28 日至 2024 年 4 月 3 日。

6. 发售价格：1.00 元人民币。

7. 发售机构

（1）直销机构

网下现金认购发售直销机构：易方达基金管理有限公司直销中心。

（2）非直销销售机构

网上现金认购发售代理机构：具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位。

网下现金认购发售代理机构：长江证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

8. 验资机构：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

（二）基金合同生效

本基金自 2024 年 3 月 25 日起公开募集，截至 2024 年 4 月 3 日，募集工作已经顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 319,942,000.00 元人民币，有效净认购金额产生的利息折份额金额共计 0.00 元人民币。上述资金已于 2024 年 4 月 10 日划入本基金托管账户。网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管账户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额，将于下一个银行结息日后划入基金托管账户。

按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，募集期间募集及利息结转的基金份额共计 319,942,000.00 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。在基金募集期内，基金管理人的基金从业人员认购基金份额 0.00 份，占基金份额总量的 0.0000%。基金管理人高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。易方达基金管理有限公司未使用自有资金认购本基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并获中国证监会书面确认，基金合同于 2024 年 4 月 10 日正式生效，该日基金份额总额为 319,942,000.00 份。自基金合同生效之日起，基金管理人正式开始管理本基金。

（三）日常申购、赎回情况

本基金日常申购、赎回开放日：2024年4月22日。

（四）基金上市交易

1. 基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书【2024】42号。

2. 上市交易日期：2024 年 4 月 22 日。

3. 上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4. 本次上市交易的基金份额场内简称：恒生 E，扩位证券简称：恒生 ETF 易方达，基金代码：513210。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

5. 本次上市交易份额：319,942,000.00 份。

6. 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 2024 年 4 月 15 日，本基金份额持有人户数为 4,767 户，平均每户持有的基金份额为 67,116.01 份。

（二）持有人结构

截至 2024 年 4 月 15 日，本基金总份额 319,942,000.00 份，全部为上市交易份额。其中机构投资者持有的份额为 8,351,000.00 份，占本次上市交易基金份额比例为 2.61%；个人投资者持有的份额为 311,591,000.00 份，占本次上市交易基金份额比例为 97.39%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至 2024 年 4 月 15 日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额 （份）	占基金总份额比 例
1	高润冰	4,700,000.00	1.47%
2	余小青	2,800,000.00	0.88%
3	贾开琼	2,400,000.00	0.75%
4	李振琴	1,528,000.00	0.48%
5	林晋	1,500,000.00	0.47%
6	吴丽华	1,400,000.00	0.44%
7	张丽娅	1,200,000.00	0.38%
8	陈俊杰	1,200,000.00	0.38%
9	熊玲瑶	1,200,000.00	0.38%
10	黄慧兰	1,100,000.00	0.34%
11	陈春华	1,100,000.00	0.34%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1. 名称：易方达基金管理有限公司
2. 法定代表人：刘晓艳

3. 总经理：刘晓艳；执行总经理：吴欣荣
4. 注册资本：13,244.2 万元人民币
5. 注册地址：广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层
6. 设立批准文号：证监基金字[2001]4 号
7. 工商登记注册的法人营业执照文号：91440000727878666D
8. 经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理
9. 股权结构：

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	22.6514%
广发证券股份有限公司	22.6514%
盈峰集团有限公司	22.6514%
广东省广晟控股集团有限公司	15.1010%
广州市广永国有资产经营有限公司	7.5505%
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	1.5087%
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	1.6205%
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	1.5309%
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	1.7558%
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	1.4396%
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	1.5388%
总计	100%

10. 内部组织结构及职能与人员情况

自成立以来，公司严格按照法律法规和中国证监会的各项规定及要求，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，保持公司规范运作，维护基金份额持有人的利益，并且根据业务发展变化，公司设置并适时调整内部组织架构。

目前，公司内部组织架构主要分为投资条线、市场条线、基础设施条线和投资顾问条线。其中，投资条线包括主动权益板块、指数投资板块、量化投资板块、固定收益板块、国际投资板块、多资产投资板块、FOF 投资板块、另类投资板块，各业务板块下设相应职能部门，负责按各自专业分工开展投资研究、投资管理、投资交易等工作。市场条线包括零售服务板块、一般机构板块、养老金板块和海外机构板块，各业务板块下设相应职能部门，负责按各自所服务的客户群体开展营销推广和客户服务等工作。基础设施条线包括金融科技板块、合规与风控板块、数据治理与服务板块、发展研究板块、产品与发展板块、基金运营板块和公司运营板块，各业务板块下设相应职能部门，根据各自职责开展金融科技、合规与风控、数据治理与服务、发展研究、产品研究与宣传策划、基金核算与登记结算、财务行政与人力党群等工作。投资顾问条线下设相应职能部门，主要负责投资顾问业务。

公司根据业务发展需要进行合理的人员配置，重视人才队伍建设和人才发展，截至 2024 年 3 月底，公司硕士及以上人数占全体员工人数比例超过 80%，形成了一支高素质、专业化的人才队伍。

11. 信息披露负责人：王玉

电话：020-85102688

12. 基金管理业务介绍

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、国际投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

13. 本基金基金经理

PAN LINGDAN（潘令旦）先生，理学硕士，本基金的基金经理。现任易方达基金管理有限公司基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。曾任德意志银行（英国）量化业务分析师、估值分析师，德意志资产管理公司基金经理，瑞士银行联合集团伦敦分行资产管理部基金经理，贝莱德投资管理（英国）有限公司基金经理。PAN LINGDAN（潘令旦）历任基金经理的基金如下：

历任基金经理的基金	任职时间	离任时间
易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接（QDII）	2023-06-21	-
易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）	2023-06-21	-
易方达恒生国企联接（QDII）	2023-06-21	-
易方达恒生国企（QDII-ETF）	2023-06-21	-
易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）	2023-06-21	-
易方达恒生科技 ETF（QDII）	2023-06-21	-
易方达标普 500 指数（QDII-LOF）	2023-09-23	-
易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）	2023-09-23	-
易方达恒生 ETF（QDII）	2024-04-10	-

（二）基金托管人

1. 基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

基金托管部门负责人：顾林

信息披露负责人：许俊

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

2. 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3. 证券投资基金托管情况

截至2023年12月31日，中国银行已托管1075只证券投资基金，其中境内基金1018只，QDII基金57只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）上市推荐人

广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：林传辉

联系人：黄岚

客户服务电话：95575 或 02095575

网址：www.gf.com.cn

（四）一级交易商

一级交易商内容见附件1。

基金管理人可根据情况变更一级交易商，并在基金管理人网站公示。

(五) 基金验资机构

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

主要经营场所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：(010) 58153000

传真：(010) 85188298

经办注册会计师：赵雅、李飘飘

联系人：赵雅

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件 2。

七、基金财务状况

(一) 基金募集期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

(二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至本报告公告前无重要财务事项发生。

(三) 基金资产负债表

资产	本报告期末（2024年4月15日；单位：人民币元）
资产：	
货币资金	316,442,274.56
结算备付金	2,710,275.48
存出保证金	87,140.59
交易性金融资产	80,428,223.94
其中：股票投资	80,428,223.94
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	
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	91,907.47
资产总计	399,759,822.04
负债和净资产	
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	82,228,247.20
应付赎回款	
应付管理人报酬	21,840.33
应付托管费	4,368.07
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	4,065.40
负债合计	82,258,521.00
净资产：	
实收基金	319,942,000.00
未分配利润	-2,440,698.96
净资产合计	317,501,301.04
负债和净资产总计	399,759,822.04

八、基金投资组合

本基金目前处于建仓期，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。

截至 2024 年 4 月 15 日，本基金的投资组合情况如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	80,428,223.94	20.12

	其中：普通股	79,800,185.67	19.96
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	628,038.27	0.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	319,152,550.04	79.84
8	其他资产	179,048.06	0.04
9	合计	399,759,822.04	100.00

注：本基金于2024年4月15日通过港股通交易机制投资的港股市值为70,632,565.95元，占净值比例22.25%。

(二) 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国香港	80,428,223.94	25.33
合计	80,428,223.94	25.33

注：1. 国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2. ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

(三) 报告期末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	5,177,770.80	1.63
材料	962,616.12	0.30
工业	3,042,612.77	0.96
非必需消费品	19,483,713.21	6.14
必需消费品	2,574,094.17	0.81
保健	1,468,410.78	0.46
金融	25,621,045.00	8.07
信息技术	3,615,493.26	1.14
电信服务	11,674,252.15	3.68
公用事业	2,840,716.65	0.89
房地产	3,967,499.03	1.25
合计	80,428,223.94	25.33

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

(四) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

(1) 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	HSBC Holdings Plc	汇丰控股有限公司	5 HK	香港证券交易所	中国香港	120,000	6,940,009.74	2.19
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	中国香港	25,100	6,920,481.34	2.18

3	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	94,600	6,032,283.28	1.90
4	Meituan	美团	3690 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	49,500	4,555,298.48	1.43
5	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	95,000	4,065,775.09	1.28
6	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	902,000	3,937,961.88	1.24
7	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	51,500	3,192,997.76	1.01
8	Industrial and Commercial Bank of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	651,000	2,376,314.77	0.75
9	CNOOC Limited	中国海洋石油	883 HK	香港	中国 香港	130,000	2,281,996.94	0.72

		有限公司		证券交易所				
10	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	香港证券交易所	中国香港	146,200	2,187,637.44	0.69

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金于 2024 年 4 月 15 日未持有债券。

（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五名债券投资明细

本基金于 2024 年 4 月 15 日未持有债券。

（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十名资产支持证券投资明细

本基金于 2024 年 4 月 15 日未持有资产支持证券。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Apr24	-	-
2	股指期货	MINI HSI IDX FUT Apr24	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”适用于金融资产与金融负债相抵销的情形，故将“其他衍生工具期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为-1,594.16 元，已包含在结算备付金中。

（九）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基金投资明细

本基金于 2024 年 4 月 15 日未持有基金。

（十）投资组合报告附注

1. 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2. 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3. 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	87,140.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	91,907.47
7	其他	-
8	合计	179,048.06

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于2024年4月15日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

本基金于2024年4月15日前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金自发售后至本报告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

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

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

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

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

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。

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。

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。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为,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

本基金上市推荐人为广发证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见:

1. 本基金上市符合《基金法》《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;
2. 基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

- (一) 中国证监会准予易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的文件;
- (二) 《易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》;
- (三) 《易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金(QDII)招募说明书》;
- (四) 《易方达恒生交易型开放式指数证券投资基金(QDII)托管协议》;
- (五) 法律意见书;
- (六) 基金管理人业务资格批件和营业执照;
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点:基金管理人、基金托管人处。

查阅方式:投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

易方达基金管理有限公司

2024年4月17日

附件 1：一级交易商

1. 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：安志勇

联系人：王星

联系电话：022-28451922

客户服务电话：956066

传真：022-28451892

网址：www.ewww.com.cn

2. 财达证券股份有限公司

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23-26层

法定代表人：翟建强

联系人：李卓颖

联系电话：0311-86272212

客户服务电话：95363（河北省内）；0311-95363（河北省外）

传真：0311-66006200

网址：<https://www.95363.com>

3. 财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼

办公地址：浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼

法定代表人：章启诚

联系人：蔡还

联系电话：021-58871097

客户服务电话：95336

网址：www.ctsec.com

4. 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心N1幢9层

法定代表人：武晓春

联系人：张琳

联系电话：021-68761616

客户服务电话：400-8888-128

传真：021-68767692

网址：<http://www.tebon.com.cn>

5. 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

联系电话：021-20361166

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

6. 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦16楼

法定代表人：戴彦

联系人：陈亚男

联系电话：021-23586583

客户服务电话：95357

网址：<http://www.18.cn>

7. 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦

办公地址：上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦

法定代表人：金文忠

联系人：黄子健

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

网址：<http://www.dfzq.com.cn>

8. 东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：陈照星

联系人：梁微

联系电话：0769-22115712

客户服务电话：95328

传真：0769-22115712

网址：www.dgzq.com.cn

9. 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：王文卓

联系人：王一彦

联系电话：021-20333333

客户服务电话：95531、400-8888-588

传真：021-50498825

网址：www.longone.com.cn

10. 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

联系电话：0512-62938521

客户服务电话：95330

传真：0512-65588021

网址：www.dwzq.com.cn

11. 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦B座）

法定代表人：李娟

联系人：李然

联系电话：010-66559039

客户服务电话：95309

传真：010-66559054

网址：www.dxzq.net

12. 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座16-19层

法定代表人：施华

联系人：丁敏

联系电话：010-59355997

客户服务电话：95571

传真：010-56437030

网址：www.foundersc.com

13. 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：刘秋明

联系人：郁疆

联系电话：021-22169999

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

14. 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：林传辉

联系人：黄岚

客户服务电话：95575或02095575

网址: www.gf.com.cn

15. 国海证券股份有限公司

注册地址: 广西壮族自治区桂林市七星区辅星路13号

办公地址: 广西壮族自治区南宁市青秀区滨湖路46号国海大厦

法定代表人: 何春梅

联系人: 王宁基

联系电话: 0755-82022112

客户服务电话: 95563或0771-95563

网址: www.ghzq.com.cn

16. 国金证券股份有限公司

注册地址: 成都市青羊区东城根上街95号

办公地址: 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦

法定代表人: 冉云

联系人: 杜晶、黎建平

联系电话: 028-86690057

客户服务电话: 95310

网址: www.gjq.com.cn

17. 国联证券股份有限公司

注册地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号

办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦

法定代表人: 葛小波

联系人: 郭逸斐

联系电话: 0510-82832051

客户服务电话: 95570

传真: 0510-82830162

网址: www.glsc.com.cn

18. 国盛证券有限责任公司

注册地址: 江西省南昌市新建区子实路1589号

办公地址: 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大厦

法定代表人: 徐丽峰

联系人：占文驰

联系电话：0791-88250812

客户服务电话：956080

传真：0791-86281443

网址：www.gszq.com

19. 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法定代表人：朱健

联系人：芮敏祺

客户服务电话：95521

传真：021-38670666

网址：www.gtja.com

20. 国投证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦

法定代表人：段文务

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-81682519

客户服务电话：95517

网址：<https://www.essence.com.cn/>

21. 国新证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街4号2幢1层A2112室

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12至18层

法定代表人：张海文

联系人：孙燕波

联系电话：010-85556048

客户服务电话：95390

传真：010-85556088

网址：www.crsec.com.cn

22. 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦

法定代表人：张纳沙

联系人：于智勇

联系电话：0755-82130833

客户服务电话：95536

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

23. 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

办公地址：上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场

法定代表人：周杰

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23180000

客户服务电话：95553

传真：021-23187700

网址：www.htsec.com

24. 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：祝艳辉

联系人：熊丽

联系电话：0471-4972675

客户服务电话：956088

网址：www.cnht.com.cn

25. 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市滨湖新区紫云路1018号

办公地址：安徽省合肥市滨湖新区紫云路1018号

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客户服务电话：95318

传真：0551-65161825

网址：www.hazq.com

26. 华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层

法定代表人：刘加海

联系人：刘之蓓

联系电话：021-20515392

客户服务电话：400-820-9898

传真：021-20515530

网址：www.cnhbstock.com

27. 华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层

办公地址：上海市浦东新区滨江大道5129号N1座

法定代表人：苏军良

联系人：王虹

联系电话：021-20655183

客户服务电话：95547

传真：021-20655196

网址：www.hfzq.com.cn

28. 华金证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区天目西路128号19层1902室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号27层

法定代表人：燕文波

联系人：秦臻

联系电话：021-20655438

客户服务电话：956011

网址: www.huajinsc.cn

29. 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路228号

办公地址: 南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人: 张伟

联系人: 胡子豪

联系电话: 021-50531281

客户服务电话: 95597

传真: 025-83387523

网址: www.htsc.com.cn

30. 华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道7888号东海国际中心一期A栋

2301A

办公地址: 上海市黄浦区福州路666号6楼

法定代表人: 俞洋

联系人: 刘熠

联系电话: 021-54967387

客户服务电话: 95323 (全国)、400-109-9918 (全国)

传真: 021-54967293

网址: www.cfsc.com.cn

31. 江海证券有限公司

注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址: 黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人: 赵洪波

联系人: 王金娇

联系电话: 0451-87765732

客户服务电话: 956007

传真: 0451-82337279

网址: www.jhzq.com.cn

32. 开源证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

办公地址：陕西省西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层

法定代表人：李刚

联系人：赵东会

联系电话：029-988447611

客户服务电话：95325

网址：www.kysec.cn

33. 联储证券股份有限公司

注册地址：山东省青岛市崂山区香港东路195号8号楼15层

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层

法定代表人：吕春卫

联系人：陈茜

联系电话：010-86499838

客户服务电话：956006

网址：www.lczq.com

34. 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层

法定代表人：何之江

联系人：周驰

联系电话：021-38643230

客户服务电话：95511-8

传真：021-58991896

网址：stock.pingan.com

35. 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人：李海超

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686888

客户服务电话：4008-918-918

传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008

网址：<https://www.shzq.com/>

36. 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：王献军

联系人：梁丽

联系电话：0991-2307105

客户服务电话：95523、4008895523

网址：www.swhysc.com

37. 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：张剑

联系人：陈宇

联系电话：021-33388999

客户服务电话：95523、4008895523

网址：www.swhysc.com

38. 万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼

法定代表人：王达

联系人：李敏莹

联系电话：020-38286815

客户服务电话：95322

传真：020-38286588

网址：www.wlzq.cn

39. 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城东大街319号8幢10000室

办公地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室

法定代表人：徐朝晖

联系人：张吉安

联系电话：029-87211668

客户服务电话：95582

网址：www.westsecu.com

40. 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼

法定代表人：高振营

联系人：江恩前

联系电话：021-50295432

客户服务电话：95351

网址：www.xcsc.com

41. 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：祝瑞敏

联系人：郝晓林

联系电话：010-83252192

客户服务电话：95321

传真：010-63080978

网址：www.cindasc.com

42. 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海浦东新区长柳路36号兴业证券大厦20楼

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

联系电话：021-38565547

客户服务电话：95562

网址: www.xyzq.com.cn

43. 甬兴证券有限公司

注册地址: 浙江省宁波市鄞州区海晏北路565、577号8-11层

办公地址: 浙江省宁波市鄞州区海晏北路565、577号8-11层

上海市浦东新区南泉北路429号泰康大厦31-32层

法定代表人: 李抱

联系人: 程亮

联系电话: 15620699408

客户服务电话: 400-916-0666

网址: www.yongxingsec.com

44. 招商证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道福华一路111号

办公地址: 深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人: 霍达

联系人: 业清扬

联系电话: 0755-82943666

客户服务电话: 95565、400-8888-111

传真: 0755-82943636

网址: www.cmschina.com

45. 浙商证券股份有限公司

注册地址: 浙江省杭州市上城区五星路201号

办公地址: 浙江省杭州市上城区五星路201号浙商证券大楼8楼

法定代表人: 吴承根

联系人: 高扬

联系电话: 0571-87902974

客户服务电话: 95345

传真: 0571-87901913

网址: www.stocke.com.cn

46. 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101

办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：王晟

联系人：辛国政

联系电话：010-80928123

客户服务电话：4008-888-888或95551

网址：www.chinastock.com.cn

47. 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦L4601-L4608

办公地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座4层、18-21层

法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

联系电话：0755-82026907

客户服务电话：95532

网址：<https://www.ciccwm.com>

48. 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：王洪

联系人：刘洋

联系电话：021-20315085

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

49. 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区光华路10号

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

联系电话：010-85130554

客户服务电话：95587或4008-888-108

网址：<http://www.csc108.com/>

50. 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：肖海峰

联系人：赵如意

联系电话：0532-85725062

客户服务电话：95548

网址：<http://sd.citics.com/>

51. 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：王一通

联系电话：010-60838888

客户服务电话：95548

传真：010-60836029

网址：www.cs.ecitic.com

52. 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01号）1001室（部位：自编01号）

办公地址：广州市天河区临江大道395号合利天德广场T1楼10层

法定代表人：陈可可

联系人：陈靖

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95548

传真：020-88836984

网址：www.gzs.com.cn

53. 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号

法定代表人：鲁智礼

联系人：程月艳 李盼盼

联系电话：0371-69099882

客户服务电话：95377

传真：0371-65585899

网址：www.ccnew.com

基金管理人可根据情况变更一级交易商，并在基金管理人网站公示。

附件 2：基金合同摘要

第一节 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与义务

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法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) 交纳基金认购款项或应付申购对价、现金差额及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规规定，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结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规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或基金所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法进行融资、融券及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、转换、非交易过户和收益分配等业务规则；
- (17) 在不违反法律法规和监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项，基金管理人有权代表基金份额持有人以基

金资产作为质押进行融资；

(18) 选择、更换或撤销基金境外投资顾问、证券经纪代理商等；

(19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 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办理基金份额的发售、申购、赎回和登记结算事宜；

(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、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，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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要而向其提供的情况除外；

(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 20 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的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) 基金在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金托管人的权利与义务

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

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 选择、更换或撤销境外托管人，可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责；

(8) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管（或委托境外托管人保管）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，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要而向其提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、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 20 年以上；

(12) 从基金管理人或其委托的登记结算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) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 当基金托管人将其义务委托第三方处理时，对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任。基金托管人委托的第三方机构不包括相关司法管辖区域内的证券登记、清算机构、第三方数据和信息来源机构、根据当地市场惯例无法向该服务提供方追偿的其他机构；

(21) 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；

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(23) 选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责。境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致的基金财产受损的，基金托管人承担相应责任；在决定境外托管人是否存在过错、疏忽等不当行为时，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议适用法律及当地的法律法规、证券市场惯例决定；但基金托管人已按照谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，且境外托管人已按照当地法律法规的要求托管资产的前提下，对境外托管人的破产而产生的损失，托管人不承担责任；

(24) 每月结束后 7 个工作日内，向中国证监会和外汇局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

(25) 办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；

(26) 保存基金管理人就本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(27) 法律法规及中国证监会、外汇局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第二节 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，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直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时，联接基金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基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

本基金份额持有人大会暂不设日常机构。

一、召开事由

1、除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》;
- (2) 更换基金管理人;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 转换基金运作方式;
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准;
- (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) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- (13) 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、调低赎回费率或变更收费方式;
- (3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;
- (5) 在中国证监会允许的范围内,调整有关认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务规则;
- (6) 调整基金的申购赎回方式;调整申购对价、赎回对价组成,调整申购赎回清单的内容,调整申购赎回清单计算和公告时间或频率;
- (7) 履行适当程序后,推出新业务或服务;

(8) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置等业务；

(9) 本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

(10) 调整基金收益分配原则；

(11) 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开时，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、书面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书面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的有关证明文件、受托出席会议者出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

(2) 经核对，到会者在权益登记日代表的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书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

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）到指定地点对书面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书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中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，同时提交的有关证明文件、受托出具书面意见的代理人出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记结算机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，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，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

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 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除《基金合同》另有约定外，转换基金运作方式、

更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

七、计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面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。

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

第三节 基金收益分配原则、执行方式

一、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式采用现金分红；

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基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率时，基金管理人可进行收益分配；

4、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，具体分配方案以公告为准。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

二、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。

三、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。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、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者自行承担。

第四节 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（含境外托管人的托管费，包括向其支付的相应服务费）；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 7、基金的证券、期货等交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用；
- 8、代表基金投资或其他与基金投资活动有关的费用；
- 9、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 10、基金相关账户开户费用、账户维护费用；
- 11、基金上市初费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 12、收益分配中发生的费用；
- 13、基金依照有关法律法规应当缴纳或预提的任何税收、征费及相关的利息、费用和罚金，以及直接为处理基金税务事项产生的税务代理费；
- 14、其他为基金的利益而产生的费用；
- 15、因投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票而产生的各项合理费用；
- 16、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，或采用其他基金管理人和基金托管人双方认可的方式支付。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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取，或采用其他基金管理人和基金托管人双方认可的方式支付。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—16 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、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；
- 5、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项纳税主体，其纳税义务按国家或所投资市场所在国家或地区税收法律、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。

本基金在投资和运作过程中如发生增值税等应税行为，相应的增值税、附加税费以及

可能涉及的税收滞纳金等由基金财产承担,届时基金管理人可通过本基金托管账户直接缴付,或划付至基金管理人账户并由基金管理人按照相关规定申报缴纳。如果基金管理人先行垫付上述增值税等税费的,基金管理人有权从基金财产中划扣抵偿。本基金清算后若基金管理人被税务机关要求补缴上述税费及可能涉及的滞纳金等,基金管理人有权向投资人就相关金额进行追偿。

第五节 基金财产的投资方向和投资限制

一、投资范围

本基金投资于标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证)、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金、依法发行上市的其他股票(含存托凭证)、债券、银行存款、货币市场工具、经中国证监会认可的境外交易所上市交易的期权、期货等金融衍生产品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,在投资香港市场时,本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

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,本基金可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的80%且不低于基金资产净值的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) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%;

(2) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制;

(3) 基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%;

(4) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。前项非流动性资产是指法律或《基金合同》规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产;

(5) 基金持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 10%。持有货币市场基金可以不受前述限制；

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

(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资，法律法规另有规定的，从其规定；

(8) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(9) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(10) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述 (7)、(8) 情形之外，若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施调整，以符合投资比例限制要求。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

2、金融衍生品投资

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

(1) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%；

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

(3) 基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；

2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易；

3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%;

(4) 基金管理人应当在基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告;

(5) 基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

3、本基金可以参与证券借贷交易, 并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级;

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%;

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要;

(4) 除中国证监会另有规定外, 担保物可以是以下金融工具或品种: 1) 现金; 2) 存款证明; 3) 商业票据; 4) 政府债券; 5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证;

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券;

(6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

4、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易, 并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与正回购交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级;

(2) 参与正回购交易, 应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要;

(3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红;

(4) 参与逆回购交易, 应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约, 本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要;

(5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任;

(6) 基金参与证券借贷交易、正回购交易, 所有已借出而未归还证券总市值或所有已

售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%；

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

5、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 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) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；
- (12) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (13) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (14) 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；
- (15) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

6、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。

7、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关

联交易的条件和要求进行变更的,本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致,基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更,该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

第六节 基金资产净值的计算方法和公告方式

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金净值信息的公告

《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

第七节 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

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,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法律法规及监管要求（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、注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，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。

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。

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 20 年以上。

第八节 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，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决，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。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，除非仲裁裁决另有决定，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。

第九节 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，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。