

华安三菱日联日经 225 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：华安基金管理有限公司 基金托管
人：中国银行股份有限公司 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 上市时间：2019 年 6 月 25 日 公告日
期：2019 年 6 月 20 日

目 录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	1
三、基金的募集与上市交易	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	8
五、基金主要当事人简介	9
六、基金合同摘要.....	15
七、基金财务状况.....	15
八、基金投资组合	18
九、重大事件揭示.....	21
十、基金管理人承诺.....	21
十一、基金托管人承诺	21
十二、备查文件目录.....	22
附件：基金合同摘要.....	24

一、重要声明与提示

华安三菱日联日经 225 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，华安基金管理有限公司（以下简称“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。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2019 年 5 月 25 日《证券时报》上的《华安三菱日联日经 225 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”）。

二、基金概览

- 1、基金名称：华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）。
- 2、基金类型：指数型、QDII
- 3、运作方式：交易型开放式
- 4、基金存续期限：不定期

5、基金简称：华安日经 225ETF。

6、基金二级市场交易简称及交易代码：513880，交易代码：日经 225。

7、基金申购、赎回简称及代码：日经 225，代码：513881。

8、基金份额总额：截至 2019 年 6 月 18 日，本基金的基金份额总额为 274,970,000

份。

9、基金份额净值：截至 2019 年 6 月 18 日，本基金的基金份额净值为 1.0000 元。

10、本次上市交易的基金份额总额：截至 2019 年 6 月 18 日，本次上市交易的基金份额总额为 274,970,000 份。

11、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

12、上市交易日期：2019 年 6 月 25 日。

13、基金管理人：华安基金管理有限公司。

14、基金托管人：中国银行股份有限公司。

15、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。

16、申购赎回代办券商（简称“一级交易商”）： 中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、

兴业证券股份有限公司、国盛证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司。

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、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2019】923号文。

2、基金合同生效日：2019 年 6 月 12 日。

3、基金运作方式：交易型、开放式。

4、基金合同期限：不定期。

5、发售日期：本基金自 2019 年 5 月 28 日至 2019 年 6 月 5 日进行发售。投资者可选择网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。其中，网上现金认购的日期为 2019 年 6 月 3 日至 2019 年 6 月 5 日；通过发售代理机构进行的网下现金认购的日期为 2019 年 5 月 28 日至 2019 年 6 月 5 日。

6、发售价格：1.00 元人民币。

7、发售期限：网下现金认购认购发售 7 个工作日，网上现金认购发售 3 个工作日。

8、发售方式：投资者可选择网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

9、发售机构

(1) 网下现金发售发售代理机构 本基金网下现金发售代理机构包括：

招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公

司、申万宏源西部证券有限公司、国信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、长城证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司。

(2) 网上现金发售代理机构 本基金网上现金认购代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易

所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券承销保荐有限公司、长江证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券承销保荐有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东亚前海证券有限责任公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、

华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华英证券有限责任公司、华菁证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、汇丰前海证券有限责任公司、江海证券有限公司、金通证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、九州证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申港证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申万宏源证券有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、万和证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、网信证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中德证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国证券金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天国富证券有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、

中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、中邮券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。

(二) 基金合同生效 本基金自 2019 年 5 月 28 日起向社会公开募集, 截至 2019 年 6 月 5 日募集工作已

顺利结束。经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资, 此次募集的有效净认购金额为人民币 274,970,000.00 元, 认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 0 元。本次募集认购资金及其产生的利息已于 2019 年 6 月 12 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 1,875 户, 按照每份基金份额 1.00 元人民币计算, 设立募集期间募集的基金份额共计 274,970,000 份, 已全部计入本基金基金份额持有人的基金账户, 归各基金份额持有人所有。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金合同》(以下简称"基金合同")、《华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 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完毕基金备案手续, 并于 2019 年 6 月 12 日获书面确认, 基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起, 本基金管理人开始正式管理本基金。

(三) 基金份额折算 本基金不进行基金份额折算。

(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 [2019]107 号。

2、上市交易日期：2019 年 6 月 25 日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。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。

4、基金二级市场交易简称：日经 225。

5、基金二级市场交易代码：513880。

6、基金申购、赎回简称：日经 225。

7、基金申购、赎回代码：513881。本基金申购赎回业务的办理机构为经上海证券交易所确认的一级交易商，投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金的申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购、赎回。目前本基金的一级交易商包括：

中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国盛证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司。

8、本次上市交易的基金份额总额：274,970,000 份（截至 2019 年 6 月 18 日）。

9、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。

10、本基金将以 2019 年 6 月 24 日的基金份额净值作为上市首日（即 2019 年 6

月 25 日）的开盘参考价。

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 2019 年 6 月 18 日，本基金份额持有人户数为 1,875

户，平均每户持有的基

金份额为 146,650 份。

（二）持有人结构 截至 2019 年 6 月 18 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为 131,492,000 份，占基金总份额的 47.8205%；个人投资者持有的基金份额为 143,478,000 份，占基金总份额的 52.1795%。

（三）前十名基金份额持有人的情况 截至 2019 年 6 月 18 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）	占总份额比例（%）
1	上海久事（集团）有限公司	20,000,000	7.2735%
2	深圳前海国恩资本管理有限公司—国恩回报 5 号私募证券	20,000,000	7.2735%
3	滨州愉怡纺织科技有限公司	9,999,000	3.6364%
4	中国国际金融股份有限公司	8,000,000	2.9094%
5	光大证券股份有限公司	7,500,000	2.7276%

6	国泰君安证券股份有限公司	7,500,000	2.7276%
7	中国银河证券股份有限公司	7,200,000	2.6185%
8	招商证券股份有限公司	7,000,000	2.5457%
9	国盛证券有限责任公司	7,000,000	2.5457%
10	申万宏源证券有限公司	6,000,000	2.1821%

(四) 截止到 2019 年 6 月 18 日, 基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 0 份, 占该基金总份额的比例为 0%。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 0 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：华安基金管理有限公司
- 2、法定代表人：朱学华
- 3、总经理：童威
- 4、注册资本：1.5 亿元人民币
- 5、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【1998】20 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000062071
- 8、经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

9、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

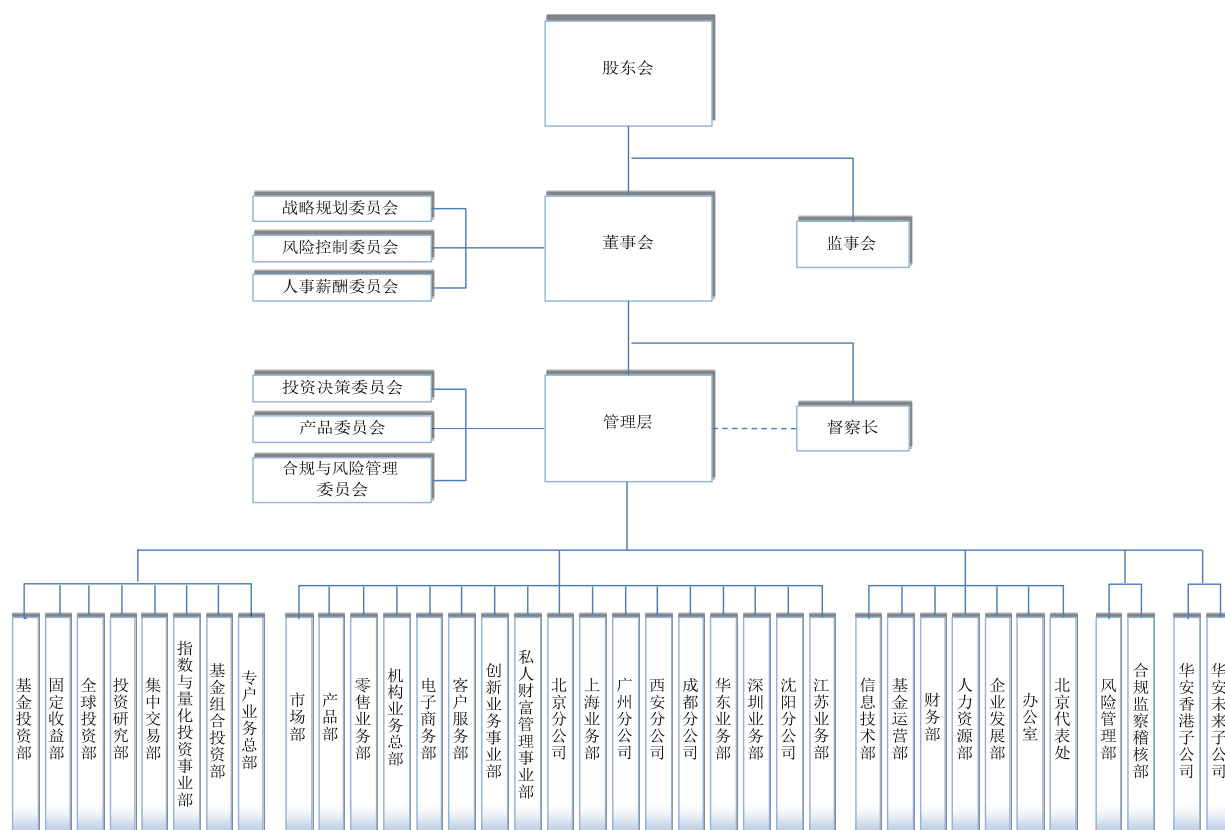
10、内部组织结构及职能 公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基

金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由八名董事组成，其中，每一股东各推荐一名，总经理为公司董事，另两名独立董事。董事会为股东会的执行机构，并对股东会负责。董事会下设风险控制、战略规划和人事薪酬等三个专业委员会。

监事会由三名监事组成，其中两名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

公司组织架构以公司发展战略为导向而建立，主要采用管理扁平、分工明确的职能制结构，设有投资研究、市场营销、运营及后台、合规风控四大板块以及两个子公司（华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司）。公司组织架构如下图所示：



11、人员情况：截至 2019 年 3 月 31 日，公司目前共有员工 361 人（不含香港公司），其中 57%

具有硕士及以上学历，92%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

12、信息披露负责人：陆滢 电话：（021）

38969727 13、基金管理业务情况简介：

截至 2019 年 3 月 31 日，华安基金管理有限公司旗下共管理 115 只开放式基金，资产规模达 3170.0 亿元人民币。旗下管理的基金包括：华安创新、华安 MSCI 中国 A 股指数增强、华安现金富利、华安宝利配置、华安上证 180ETF、华安宏利、

华安中小盘成长、华安策略优选、华安稳定收益、华安核心优选、华安强化收益、华安上证 180ETF 联接、华安动态灵活配置、华安行业轮动、华安香港精选、华安上证龙头 ETF、华安上证龙头 ETF 联接、华安升级主题、华安大中华升级、华安可转债、华安量化多因子、华安信用四季红、华安科技动力、华安标普全球石油、华安月月鑫、华安季季鑫、华安月安鑫、华安沪深 300、华安逆向策略、华安安心收益、华安日日鑫、华安添鑫中短债、华安纯债、华安保本、华安安信消费服务、华安双债添利、华安黄金 ETF、华安纳斯达克 100 美元现钞、华安易富黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红、华安生态优先、华安中证细分医药 ETF、华安新活力、华安大国新经济、华安安顺、华安汇财通、华安德国 30(DAX)ETF、华安德国 30(DAX)ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安 安享、华安年年盈、华安物联网主题、华安新动力、华安新丝路主题、华安智能 装备主题、华安媒体互联网、华安新回报、华安新机遇、华安新优选、华安中证 全指证券、华安中证银行、华安添颐、华安国企改革、华安创业板 50、华安新乐 享、华安安益、华安安康、华安安华、华安沪港深外延增长、华安稳固收益、华 安全球美元收益 A 美元现汇、华安安禧灵活、华安全球美元票息 A 美元现汇、华 安创业板 50ETF、华安安进灵活配置、华安聚利 18 个月、华安智增精选、华安睿 享定期开放、华安鼎丰、华安新瑞利、华安新恒利、华安新泰利、华安事件驱动 量化策略、华安新丰利、华安沪港深通精选、华安现金宝、华安睿安、华安沪港 深机会、华安文体健康主题、华安大安全、华安幸福生活、华安鼎瑞定期开放、 华安红利精选、华安安悦、华安研究精选、华安安逸半年定开、华安睿明两年定 开、华安 CES 港股通精选 100ETF、华安 CES 港股通精选 100ETF 联接、华安全球 稳健配置、华安安浦、华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF、华安 MSCI 中国 A 股国际 ETF

联接、华安鼎益、华安创业板 50ETF 联接、华安中证 500 行业中性低波动 ETF、华安制造先锋、华安中证 500 低波动 ETF 联接、华安安盛 3 个月定开、华安安泰定期开放、华安沪深 300 行业中性低波动 ETF、华安双核驱动、华安低碳生活和华安沪港深优选等 115 只开放式基金。

14、本基金基金经理 倪斌先生，硕士研究生，8 年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事

务所审计员。2010 年 7 月加入华安基金，历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部数量分析师、基金经理助理。2018 年 9 月起同时担任华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安标普全球石油指数证券投资基金 (LOF)、华安国际龙头 (DAX) 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理。

(二) 基金托管人 名称：中国银行股份有限公司 (简称“中国银

行”) 住所：北京市复兴门内大街 1 号 办公地址：北京市西城区复

兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼 法定代表人：陈四清

成立时间：1983 年 10 月 31 日 组织形

式：股份有限公司

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

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】24 号

联系人：王娟 联系电话：（010）

66594909

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。

证券投资基金托管情况：截至 2019 年 3 月 31 日，中国银行已托管 710 只证券投资基金，其中境内基金 670 只，QDII 基金 40 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 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）一级交易商 目前，本基金一级交易商名单如

下：

中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、国都证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公

司、中国银河证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、国泰君安有限责任公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国盛证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司。

(四) 基金验资机构 名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合

伙) 住所: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

01-12 室 办公地址: 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

执行事务合伙人: 毛鞍宁

电话: (021)2228 8888

传真: (021)2228 0000

联系人: 蒋燕华 经办注册会计师: 蒋燕华、沈熙

苑

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件: 基金合同摘要。

七、基金财务状况

(一) 基金募集期间费用 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由

本基金管理人承担, 不从基金资产中列支。

(二) 基金上市前重要财务事项 本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三) 基金资产负债表 本基金截至 2019 年 6 月 18 日的资产负债表如下：

资 产	本期末 2019 年 6 月 18 日
资 产：	
银行存款	274,919,614.58
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	4,834,597.25
其中：股票投资	-
基金投资	4,834,597.25
债券投资	-
资产支持证券投资	-
商品现货合约投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	21,958.33

应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	84,369.29
资产总计	279,860,539.45
负债和所有者权益	
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	4,878,738.30
应付赎回款	-
应付管理人报酬	9,041.62
应付托管费	3,616.64
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	4,482.80
负债合计	4,895,879.36
所有者权益：	
实收基金	274,970,000.00
未分配利润	-5,339.91
所有者权益合计	274,964,660.09
负债和所有者权益总计	279,860,539.45

注：报告截止日 2019 年 6 月 18 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 274,970,000.00 份。

八、基金投资组合

截至 2019 年 6 月 18 日，本基金的投资组合情况如下：

（一）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	4,834,597.25	1.73
3	固定收益投资		

	其中：债券		
	资产支持证券		
4	商品现货合约投资		
	其中：股票		
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	274,919,614.58	98.23
8	其他各项资产	106,327.62	0.04
9	合计	279,860,539.45	100.00

（二）期末按行业分类的股票投资组合 1、积极投资按行业分类的股票投资组合 本基金本报告期末未持有积极投资股票。 2、指数投资按行业分类的股票投资组合 本基金本报告期末未持有股票投资。

（三）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明细 1、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

本基金本报告期末未持有股票投资。

2、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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

(四) 期末按券种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券。

(五) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细 本基金本报告期末未持有债券。

(六) 投资组合报告附注

1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,958.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	84,369.29
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	106,327.62

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

本基金本报告期末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

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

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、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、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

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。

十二、备查文件目录

（一）中国证监会准予华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的文件

（二）《华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》

（三）《华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

（四）《华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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 备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

附件：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

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、应付申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
 - (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
 - (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
 - (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
 - (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
 - (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
- 二、基金管理人
- 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》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
 - (11) 在《基金合同》约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
 - (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利, 在遵循基金份额持有人利益优先原则的前提下代表本基金就本基金所持有的基金行使相关基金份额持有人权利;
 - (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、转托管等方面的业务规则;
 - (17) 选择、更换或撤销境外投资顾问;
 - (18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

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

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

(7) 进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 依法接受基金托管人的监督；

(11) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

- (12) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- (13) 编制季度、半年度和年度基金报告;
- (14) 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;
- (15) 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;
- (16) 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;
- (17) 按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回对价;
- (18) 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;
- (19) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;
- (20) 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条件下得到有关资料的复印件;
- (21) 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;
- (22) 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;
- (23) 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；

(24) 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；

(25) 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；

(26) 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；

(27) 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存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(28) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(29) 建立并保存基金份额持有人名册；

(30) 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 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、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产根据《基金合同》、《托管协议》约定准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

(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，因审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(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、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《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) 基金托管人就管理本基金的资金汇出、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；

(12) 第 (11) 项所述资料外，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(13) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(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对价；

(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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(17) 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；

(18) 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和银行监管机构, 并通知基金管理人;

(20) 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;

(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) 对基金的境外财产, 基金托管人可以委托符合《试行办法》规定条件的境外托管人负责境外资产托管业务。境外托管人依据基金财产投资地法律法规、监管要求、证券交易所规则、市场惯例以及其与基金托管人之间的主次托管协议持有、保管基金财产, 并履行资金清算等职责;

(24) 按照法律法规规定以及《基金合同》、《托管协议》对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督, 如发现投资指令或资金汇出入违法、违规, 应当及时向中国证监会、外管局报告;

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

(26) 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;

(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。

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。

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时,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基金份额持有人大会。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。 一、召开事

由

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

（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上海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) 调低除基金管理费、基金托管费外的其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 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；
- (6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金交易、非交易过户等业务规则、增设基金份额或销售币种；
- (7) 本基金推出新业务或服务；
- (8) 在不违反法律法规的情况下，调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- (9) 在不违反法律法规的情况下，调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率；
- (10) 标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)；
- (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

日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

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

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行

书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会、通讯开会或法律法规、中国证监会允

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书面

形式或大会公告载明的其他方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明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情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行；或者采用网络、电话等其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决。

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。

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自表决通过之日起生效，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决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在

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

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

九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，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、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相

关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中

已实现收益的孰低数。 三、基金收益分配原

则

1、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达到 1%以上，基金管理人可以进行收益分配；基金收益分配数额的确定原则在招募说明书中列明；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式为现金分红；

4、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、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不

利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

四、收益分配方案 基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益

分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 五、收益分配方案

的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息

披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。 在收益分配方案

公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利

向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

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者自行承担。

第四节 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费（含境外托管人收取的费用）；
- 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、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、结算、登记等各项费用以及为了加快清算向券商支付的费用等）；
- 7、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 8、基金的上市费及年费；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；

11、基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；

12、为保障基金利益，除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的、与基金有关的诉讼、追索费用；

13、本基金终止清算时发生的费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除；

14、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。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

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 0.20% 年费率计提。管理费的计算

方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ 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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 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 0.08% 的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$ 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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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”中除基金管理费、基金托管费之外的其他费用，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

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家或所投资市场所在国家的税收法律、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。

第五节 基金财产的投资方向和投资限制

一、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的ETF、标的指数成份股及其备选成份股、境外跟踪同一标的指数的股指期货等。本基金还可投资于全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括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市场挂牌交易的普通股、优先股，经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品，政府债券、公司债券、可转换债券等固定收益类证券，银行存款、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）。

针对境内投资，本基金的投资范围包括货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其他境内金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于标的ETF的比例不低于基金资产净值的

90%。

如果法律法规对该比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,本基金的投资范围会做相应调整。

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 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;

(2) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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以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;

(3) 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;

(4) 本基金境外投资的,须遵循以下限制:

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

2) 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%;

3) 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;

4) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%，临时借入现金的期限以中国证监会规定的期限为准;

(5) 本基金境内投资的，须遵循以下限制:

1) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%;

2) 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%；本基金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;

(6) 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。
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。若基金超过上述除第 (2)、(3) 项外的投资比例限制，基金管理人应当在 10 个交易日内对境内投资部分进行调整、应当在 30 个工作日内采用合理的商业措施对境外投资部分进行调整，以符合投资比例限制要求，但中国证监会

规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 如果法律

法规或监管部门对上述投资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，经履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、金融衍生品投资限制

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,投资于境外金融衍生品的,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) 基金拟投资衍生品,基金管理人在产品募集申请中应当向中国证监会提交基金投资衍生品的风险管理流程、拟采用的组合避险、有效管理策略。

(5) 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。

(6) 基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

3、本基金可以参与境外证券借贷交易,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境外正回购交易、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。

5、基金参与境外证券借贷交易、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。

6、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。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。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,应当符合本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同意,符合中国证监会的规定,并履行披露义务。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。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,经履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

第六节 基金资产净值的计算方法和公告方式

一、计算方法 基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是按

照每个估值日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到

0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。 二、公告方式

《基金合同》生效后，在基金份额上市交易前或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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在基金份额上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个估值日的次日，通过基金管理人网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

第七节 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，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

二、《基金合同》的终止事由 有下列情形之一的，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、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估值和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，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剩余财产中支付。 五、基金财产

清算剩余资产的分配 依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金

财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

六、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所

审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组 进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第八节 争议的处理和适用的法律 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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该机

构届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，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。

第九节 基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

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

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

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

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

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