

泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金上市交易公告书

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

登记机构：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：2024 年 10 月 15 日

公告日期：2024 年 10 月 10 日

目录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	2
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.....	6
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	14
八、基金投资组合.....	16
九、重大事件揭示.....	20
十、基金管理人承诺.....	21
十一、基金托管人承诺.....	22
十二、基金上市推荐人意见.....	23
十三、备查文件目录.....	24
附件：基金合同摘要.....	25

一、重要声明与提示

《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人泰康基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”、“泰康基金”或“公司”）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。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告书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。凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登于基金管理人网站（www.tkfunds.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的本基金基金合同、托管协议、招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件。

二、基金概览

1、基金名称：泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

2、基金简称：中证 A500

3、扩位简称：中证 A500ETF

4、证券代码：560510

5、截至公告日前两个工作日的基金份额总额：截至 2024 年 10 月 8 日，本基金的基金份额总额为 2,000,026,938.00 份。

7、截至公告日前两个工作日的基金份额净值：截至 2024 年 10 月 8 日，本基金的基金份额净值为 1.0007 元。

8、本次上市交易的基金份额总额：2,000,026,938.00 份。

9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

10、上市交易日期：2024 年 10 月 15 日

11、基金管理人：泰康基金管理有限公司

12、基金托管人：招商银行股份有限公司

13、基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

13、上市推荐人：中信证券股份有限公司

14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：具体请见《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务并调整最小申购、赎回单位的公告》以及相关公告。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注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2024]1261号文。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售方式：网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购三种方式。

5、发售日期：2024年9月10日至2024年9月23日。其中，网上现金认购的日期为2024年9月13日至2024年9月23日，网下现金认购和网下股票认购的日期为2024年9月10日至2024年9月23日。

6、发售期限：网下现金认购和网下股票认购发售8个工作日，网上现金认购发售5个工作日。

7、发售价格：1.00元人民币。

8、发售机构

(1) 发售协调人

中信证券股份有限公司

(2) 网上现金认购的发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

(3) 网下现金认购和网下股票认购的直销机构

泰康基金管理有限公司

(4) 网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构（排序不分先后）

中国银河证券股份有限公司（不参与网下股票认购）、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中信建投证券股份有限公司（不参与网下股票认购）、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、中信证券华南股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司（不参与网下股票认购）、长江证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司（不参与网下股票认购）、国投证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、民生证券股份有限公司。

9、验资机构：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为 1,999,747,724.00 元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 536,812.34 元人民币（含计入基金资产的网上现金认购的有效资金产生的利息）。

上述有效净认购资金已于 2024 年 9 月 26 日全部划至本基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管账户。对于认购款项在募集期间所产生的利息，网下现金认购利息于 2024 年 9 月 26 日划入基金托管账户，网上现金认购利息已结息部分于 2024 年 9 月 26 日划入基金托管账户，未结息部分于 2024 年 12 月 23 日银行结息后划入基金托管账户。

本次募集有效认购户数为 10,473 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 2,000,026,938.00 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

11、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《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续并获书面确认，基金合同于 2024 年 9 月 27 日起正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人开始正式管理本基金。

12、基金合同生效日：2024 年 9 月 27 日

13、基金合同生效日份额总额：2,000,026,938.00 份。

（二）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】133 号

2、上市交易日期：2024 年 10 月 15 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金简称：中证 A500

5、扩位简称：中证 A500ETF

6、证券代码：560510

投资人在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

7、本次上市交易份额：2,000,026,938.00 份

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。

9、本基金管理人自 2024 年 10 月 15 日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资人应当在本基金指定的一级交易商（申购赎回代理券商）办理本基金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和赎回。具体请见《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》以及在基金管理人网站上公示的相关内容。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即 2024 年 10 月 8 日，本基金份额持有人户数为 10,473 户，平均每户持有的基金份额为 190,969.82 份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2024 年 10 月 8 日，本基金总份额为 2,000,026,938.00 份，全部为上市交易份额。其中，机构投资者持有的基金份额为 855,548,982.00 份，占基金总份额的 42.78%；个人投资者持有的基金份额为 1,144,477,956.00 份，占基金总份额的 57.22%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至公告日前两个工作日即 2024 年 10 月 8 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）	占场内总份额比例（%）
1	泰康人寿保险有限责任公司—个人分红产品 A	438,266,236.00	21.91
2	中国国际金融股份有限公司	87,601,999.00	4.38
3	泰康人寿保险有限责任公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	38,202,256.00	1.91
4	东方证券股份有限公司	26,280,600.00	1.31
5	泰康人寿保险有限责任公司—传统—普通保险产品—019L—CT001 沪	21,432,094.00	1.07
6	泰康人寿保险有限责任公司—分红—团体分红—019L—FH001 沪	15,476,982.00	0.77
7	创金合信基金—招商银行—创金合信招益 2 号集合资产管理计划	13,142,074.00	0.66
8	沅京资本管理（北京）有限公司—沅京稳健二期私募证券投资基金	8,768,960.00	0.44
9	西部证券股份有限公司	8,762,565.00	0.44
9	阳光人寿保险股份有限公司—	8,762,565.00	0.44

	传统保险产品		
9	创金合信基金－中国银行－创金合信鼎泰150号集合资产管理计划	8,762,565.00	0.44

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基金管理人概况

名称：泰康基金管理有限公司

法定代表人：金志刚

总经理：金志刚

注册资本：12000 万元人民币

成立日期：2021 年 10 月 12 日

住所：北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302

办公地址：北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监许可【2021】
2839 号

工商登记注册的营业执照统一社会信用代码：91110102MA04G1RQ57

组织形式：其他有限责任公司

经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售和中国证监会许可的其他业务。（“1、未经有关部门批准，不得以公开方式募集资金；2、不得公开开展证券类产品和金融衍生品交易活动；3、不得发放贷款；4、不得对所投资企业以外的其他企业提供担保；5、不得向投资者承诺投资本金不受损失或者承诺最低收益”；市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

股权结构：泰康资产管理有限责任公司占公司注册资本的 80%；嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.3%；嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.4%；嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.4%；嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 4.4%；嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）占公司注册资本的 2.5%。

2、内部组织结构及职能：

泰康基金管理有限公司（以下简称“公司”）根据相关法律法规要求，设立股东会、董事会和经营管理层，并建立健全独立董事制度和督察长制度。董事会下设 2 个专门委员会，分别为审计与风险管理委员会、提名与薪酬委员会。公司在经营管理层设立经营管理委员会并下设投资决策委员会、产品委员会、IT 治理委员会、风险控制委员会 4 个专业委员会，公司治理结构完善。

公司设立了 14 个一级部门，包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部、集中交易室、市场部、财富业务部、运营管理部、客户服务部、信息技术部、风险控制部、监察稽核部、人力行政部、财务部，并分别在上海、深圳两地设立了分公司。

3、人员情况：

截至 2024 年 8 月底，公司共有员工 192 人。其中，硕士及以上学位占比 76%，形成了一支年轻化、知识化、专业化、国际化的人才队伍。

4、信息披露负责人：陈玮光

电话：010-89620366

5、基金管理业务情况简介：

泰康基金前身为泰康资产管理有限责任公司公募事业部，公募基金管理业务始于 2015 年 4 月。2021 年 9 月 1 日泰康资产管理有限责任公司正式获得证监会批准设立子公司泰康基金，并于 2022 年 11 月 18 日将旗下公募基金产品的基金管理人统一变更为泰康基金，此后泰康公募基金业务以独立基金管理公司的身份继续服务广大投资者。

截至 2024 年 6 月底，泰康基金管理总规模超过 1400 亿元，管理 83 只公募基金，累计服务客户数超 1300 万。旗下产品涵盖货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF 基金等不同类型、不同风险收益特征的系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题 ETF、双碳、科技、大健康赛道等方面均进行了战略布局，为投资者提供了丰富多元的投资选择。

6、本基金基金经理

魏军先生，数量经济学博士。2019 年 5 月加入泰康公募，现任泰康基金量化投资部负责人。2019 年 12 月 27 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月 30 日至今担任泰康沪深 300 交易型开放式指

数证券投资基金联接基金基金经理。2020年9月18日至今担任泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年7月7日至今担任泰康中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年8月27日至今担任泰康中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2021年12月6日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2022年8月1日至今担任泰康中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2022年9月27日-2023年2月17日担任泰康中证新能源动力电池指数型证券投资基金基金经理。2023年6月14日至今担任泰康中证科创创业50指数型发起式证券投资基金基金经理。2023年8月17日至今担任泰康中证500指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023年10月26日至今担任泰康中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2023年11月3日至今担任泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金经理。2024年1月31日至今担任泰康国证公共卫生与医疗健康交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。2024年3月15日至今担任泰康中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2024年5月7日至今担任泰康半导体量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。2024年9月27日至今担任泰康中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金经理。曾历任广发基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理、量化投资部副总经理等职务。

（二）基金托管人情况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：王良

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83077987

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张姗

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2023 年 9 月 30 日，招商银行集团总资产 106,680.09 亿元人民币，高级法下资本充足率 17.38%，权重法下资本充足率 14.48%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队 10 个职能团队，现有员工 204 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

截至 2023 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 1322 只证券投资基金。

（三）基金上市推荐人

名称：中信证券股份有限公司

住所：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

电话：95548

联系人：王一通

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(四) 验资机构及审计基金财产的会计师事务所

1、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

办公地址：北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：左艳霞、贾君宇

联系电话：010-85085000

传真：010-85085111

2、验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

办公地址：北京市东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：左艳霞、贾君宇

联系电话：010-85085000

传真：010-85085111

联系人：左艳霞

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

基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中列支。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认购费。

（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

截至公告前两个工作日即 2024 年 10 月 8 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资产	本报告期末
	2024 年 10 月 8 日
资产：	
货币资金	1,979,849,911.74
结算备付金	355,555.60
存出保证金	-
交易性金融资产	1,216,381,903.12
其中：股票投资	1,216,381,903.12
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-
其他资产	226,960.31
资产总计	3,196,814,330.77
负债和所有者权益	本报告期末
	2024 年 10 月 8 日

负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	1,195,049,963.66
应付赎回款	-
应付管理人报酬	90,377.81
应付托管费	30,125.92
应付销售服务费	-
应交税费	-
应付利润	-
其他负债	231,145.94
负债合计	1,195,401,613.33
净资产：	
实收基金	2,000,026,938.00
其他综合收益	-
未分配利润	1,385,779.44
净资产合计	2,001,412,717.44
负债和净资产总计	3,196,814,330.77

注：截至 2024 年 10 月 8 日，基金份额净值 1.0007 元，基金份额总额 2,000,026,938.00 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约定。

截至公告前两个工作日即 2024 年 10 月 8 日，本基金的投资组合情况如下（财务数据未经审计）：

（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	1,216,381,903.12	38.05
	其中：股票	1,216,381,903.12	38.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,980,205,467.34	61.94
8	其他资产	226,960.31	0.01
9	合计	3,196,814,330.77	100.00

注：本基金将按照相关法律法规的要求，在上市前完成基金投资组合与标的指数的拟合。

（二）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,215,521.00	0.36
B	采矿业	63,139,373.68	3.15
C	制造业	737,539,374.44	36.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,788,265.00	2.39

E	建筑业	25,935,904.00	1.30
F	批发和零售业	8,308,455.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	40,576,149.00	2.03
H	住宿和餐饮业	1,248,352.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,085,385.00	3.50
J	金融业	159,185,569.00	7.95
K	房地产业	14,222,201.00	0.71
L	租赁和商务服务业	13,749,866.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	12,528,682.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	3,214,810.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	632,058.00	0.03
Q	卫生和社会工作	7,056,083.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	3,955,855.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	1,216,381,903.12	60.78

(三) 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	33,400	57,548,200.00	2.88
2	300750	宁德时代	140,500	42,009,500.00	2.10
3	601318	中国平安	572,800	35,358,944.00	1.77
4	600036	招商银行	658,700	26,348,000.00	1.32
5	000333	美的集团	259,900	20,841,381.00	1.04
6	600900	长江电力	651,000	19,022,220.00	0.95
7	000858	五粮液	103,300	16,946,365.00	0.85
8	002594	比亚迪	48,200	15,779,716.00	0.79
9	601899	紫金矿业	876,728	15,746,034.88	0.79
10	601166	兴业银行	773,600	15,479,736.00	0.77

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

截至 2024 年 10 月 8 日, 本基金未持有债券。

(五) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金未持有债券。

(六)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

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金未持有资产支持证券。

(七)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金未持有贵金属。

(八)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

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金未持有权证。

(九)本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金未投资股指期货。

(十)本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金未投资国债期货。

(十一)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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方外管局、国家金融监督管理总局及其派出机构的处罚；兴业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派出机构的处罚。

基金投资上述主体相关证券的决策流程符合公司投资制度的规定。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下：

序号	其他资产	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	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	226,960.31
7	待摊费用	-
8	其他	-
5	合计	226,960.31

4、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2024 年 10 月 8 日，本基金前十名股票中未存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间,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

基金管理人泰康基金管理有限公司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

基金托管人招商银行股份有限公司就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

在本基金上市后，我行承诺严格遵照《基金法》等相关法规以及《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》的约定履行相应职责。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人中信证券股份有限公司就本基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）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；

（二）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) 中国证监会准予本基金注册的批复文件
- (二) 《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《泰康中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 法律意见书
- (八) 中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人和基金托管人处。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于上述基金前应认真阅读基金的《基金合同》、《招募说明书》，了解基金产品的详细情况，选择与自己风险识别能力和风险承受能力相匹配的基金，并注意投资风险。

泰康基金管理有限公司

2024 年 10 月 10 日

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购款项或认购股票、申购对价、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) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

(10) 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、赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利

益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法进行融资或转融通证券出借业务；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户等业务规则；

(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对价、申购对价、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；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；

(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；对于基金募集期间网下股票认购所冻结的股票，按照交易所和登记结算机构的规则予以解冻；

(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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向审计、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；

(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) 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) 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。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

若以本基金为目标基金，且基金管理人与本基金基金管理人一致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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(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，法律法规、中国证监会另有规定或者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) 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或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或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) 基金管理人、证券/期货交易所或登记结算机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、收益分配、交易、非交易过户、转托管等业务的规则；

(6) 新增、调整基金的申购赎回方式及申购赎回对价组成，调整申购赎回清单的内容，调整申购赎回清单计算、公告时间或频率；

(7) 经履行适当程序，基金推出新业务或服务；

(8) 调整基金份额类别设置；

(9) 基金在其他证券交易所上市、开通场外申购赎回或其他申购赎回模式；

(10) 根据中证指数有限公司的要求及其相关协议约定，变更 IOPV 计算发布费用的计算方法；

(11) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、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；

(12) 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书面形式或大会公告载明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) 本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，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）；若本人直接出具意见或授权他人代表出具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意见或授权他人代表出具意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具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，并与基金登记结算机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经基金份额持有人大会会议通知载明，基金份额持有人也可以选择网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。为此，基金份额持有人需在会议通知载明的期限内，以会议通知载明的方式向会议召集人提交相应有效的表决票或授权委托书。

(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、基金合同和中国证监会另有规定的除外）、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，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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。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、调整或补充，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) 基金收益分配原则

1、基金管理人有权根据实际情况决定是否进行收益分配，但如满足以下条件，本基金每个自然季度至少进行一次收益分配：每季度最后一个交易日对基金相对标的指数的超额收益率进行评价，计算基金份额净值增长率、标的指数同期增长率和超额收益率；当超额收益率大于 0 时，本基金将进行收益分配，否则不进行收益分配；收益分配比例不低于超额收益率的 60%；基金管理人将在次季度起的 15 个工作日内拟定收益分配方案。其中，基金份额净值增长率、标的指数同期增长率和超额收益率按照以下方式确定：

(1) 基金份额净值增长率=(收益评价日的基金份额净值-基金上市前一个交易日的基金份额净值)/基金上市前一个交易日的基金份额净值*100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);

(2) 标的指数同期增长率=(收益评价日的标的指数收盘值-基金上市前一个交易日的标的指数收盘值)/基金上市前一个交易日的标的指数收盘值*100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);

(3) 超额收益率=基金份额净值增长率-标的指数同期增长率。

2、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

3、除基金合同另有约定的情况外,本基金收益分配采取现金分红方式;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、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,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

每次收益分配方案见基金管理人届时发布的相关公告。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后,可对上述基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会,但应于变更实施日前在规定媒介公告。

(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,依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

(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。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
- 4、除法律法规、中国证监会另有规定外,《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、结算费用;
- 7、基金的银行汇划费用;
- 8、基金上市费用及年费;
- 9、IOPV 计算与发布费用;

- 10、登记结算费用；
- 11、基金相关账户的开户及维护费用；
- 12、基金收益分配中发生的费用；
- 13、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—13 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、基金的标的指数许可使用费，本基金的标的指数许可使用费由基金管理人承担；
- 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、基金资产的投资范围和投资限制

（一）投资范围

本基金主要投资于标的指数的成份券、备选成份券。为更好地实现投资目标，还可投资于部分非成份券（包括创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、同业存单、股指期货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。

本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（4）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（5）基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（6）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

（7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（8）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（9）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列限制：

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

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

等；

3) 在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

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

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

6) 每个交易日日终在扣除股指期货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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(10) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(11) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

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

2) 参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过本基金持有该证券总量的 30%；

3) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

(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该基金资产净值的 15%；因证券、期货市场波动、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；

(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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(14) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境

内上市交易的股票合并计算；

(15) 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。

除上述第(6)、(11)、(12)、(13)情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、流动性限制或成份券市场价格变化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。因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(11)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，但须提前公告。

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) 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或变更上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值的计算方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（二）估值方法

1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

2、证券交易所上市的固定收益品种的估值

（1）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价。

（2）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

（3）对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

（4）基金以估值品种的估值全价作为估值的依据，基金管理人根据相关法律、法规的规定进行涉税处理。

3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；

(3) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值，基金管理人根据相关法律、法规的规定进行涉税处理。

(4) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

6、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

7、本基金参与融资及转融通证券出借业务的，应参照法律法规及行业协会的相关规定进行估值。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

11、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

（三）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前且未上市交易时，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或上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次日，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/交易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。

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。

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，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（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、出现标的指数不符合法律法规及监管要求（因成份券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；

3、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；

- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请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，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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

八、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，任何一方当事人均有权将争议提交深圳国际仲裁院，根据该会届时有效的仲裁规则按普通程序进行仲裁，仲裁的地点为深圳市，仲裁裁决是终局的，并对各方当事人均有约束力。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，各方当事人应恪守各自的职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为基金合同之目的，不含港澳台地区法律）管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。