

华夏上证 3-5 年期中高评级可质押 信用债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：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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：2018 年 5 月 31 日

公告日期：2018 年 5 月 28 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..... | 2 |
| 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人..... | 4 |
| 五、基金主要当事人简介..... | 5 |
| 六、基金合同摘要..... | 9 |
| 七、基金财务状况..... | 9 |
| 八、基金投资组合..... | 11 |
| 九、重大事件揭示..... | 14 |
| 十、基金管理人承诺..... | 14 |
| 十一、基金托管人承诺..... | 14 |
| 十二、基金上市推荐人意见..... | 15 |
| 十三、备查文件目录..... | 15 |
| 附件：基金合同摘要..... | 16 |

一、重要声明与提示

《华夏上证 3-5 年期中高级可质押信用债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〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华夏上证 3-5 年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人华夏基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、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。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2018 年 1 月 19 日登载于《中国证券报》和华夏基金管理有限公司（以下简称“本公司”）网站（www.ChinaAMC.com）上的《华夏上证 3-5 年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

- 1、基金名称：华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金简称：华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF。
- 3、基金二级市场交易简称：中期信用。
- 4、基金二级市场交易代码：511280。
- 5、截至公告日前两个工作日即2018年5月24日基金份额总额：3,167,263份。
- 6、截至公告日前两个工作日即 2018 年 5 月 24 日基金份额净值：100.1392 元。
- 7、本次上市交易份额：3,167,263份。
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 9、上市交易日期：2018年5月31日。
- 10、基金管理人：华夏基金管理有限公司。
- 11、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。

12、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。

13、上市推荐人：广发证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：中国证监会2017年7月25日证监许可[2017]1339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、发售日期：自2018年1月24日至2018年4月24日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售方式：本基金通过基金份额发售机构向投资者公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式认购本基金。

7、发售机构

（1）网上现金发售代理机构

具有基金代销业务资格的上海证券交易所会员单位。

（2）网下现金、网下债券发售机构

（i）直销机构（仅网下现金认购）

本公司北京分公司、上海分公司、深圳分公司、南京分公司、杭州分公司、广州分公司及成都分公司。

（ii）发售代理机构

中信证券股份有限公司（仅限网下现金认购）、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司（仅限网下现金认购）、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中泰证券股份有限公司、国金证券股份有限公司。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

9、募集资金总额及入账情况：截至2018年4月24日，本基金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，本次募集期间净认购金额为316,681,000.00元人民币，认购资金在募集期间产生的利息为119,175.73元人民币。本次通过基金管理人进行网下现金认购产生的利息于2018年5月2日划入本基金的托管账户，通过网上现金认购及通过

发售代理机构进行网下现金认购产生的利息将于下一银行结息日划入本基金托管账户。

10、基金备案情况：根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，华夏基金管理有限公司已于2018年5月2日向中国证监会办理基金备案手续，并于2018年5月3日获中国证监会书面确认，基金合同自2018年5月3日起正式生效。

11、基金合同生效日：2018年5月3日。

12、基金合同生效日的基金份额总额（份额折算前）：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316,726,219份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

13、基金份额折算：根据《华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，华夏基金管理有限公司以2018年5月14日为份额折算日对本基金进行了基金份额折算。折算前基金份额总额为316,726,219份，折算后基金份额总额为3,167,263份，折算日基金份额净值为100.0804元。本基金登记结算机构已于2018年5月15日对基金份额进行了变更登记。

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2018]77号。

2、上市交易日期：2018年5月31日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：中期信用。

5、基金二级市场交易代码：511280。

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基金二级市场交易。

6、本次上市交易份额：3,167,263份。

7、未上市交易份额的流通规定：本基金所有份额均上市交易。

8、基金资产净值的披露：在本基金上市交易并开始办理基金份额申购赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、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，并在上海证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

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 2018 年 5 月 24 日,本基金基金份额持有人户数为 1,901 户,平均每户持有的基金份额为 1,666.10 份。

(二) 持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2018 年 5 月 24 日,机构投资者持有的本基金基金份额为 2,391,403 份,占基金总份额的 75.50%;个人投资者持有的本基金基金份额为 775,860 份,占场内基金总份额的 24.50%。

截至公告日前两个工作日即 2018 年 5 月 24 日,本基金管理人的从业人员未持有本基金基金份额。本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

(三) 前十名持有人

截至公告日前两个工作日即 2018 年 5 月 24 日,本基金前十名基金份额持有人情况如下:

| 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 | 华安证券股份有限公司 | 300,137 | 9.48% |
| 2 | 东兴证券股份有限公司 | 300,000 | 9.47% |
| 2 | 中证信资本管理(深圳)有限公司—中证信金星 3 号私募证券投资基金 | 300,000 | 9.47% |
| 4 | 山东欣悦健康科技有限公司 | 299,990 | 9.47% |
| 5 | 招商证券股份有限公司 | 280,000 | 8.84% |
| 6 | 申能集团财务有限公司 | 200,100 | 6.32% |
| 7 | 鹏扬基金—中国银行—中银国际证券有限责任公司 | 200,088 | 6.32% |
| 8 | 华贵人寿保险股份有限公司—传统险 | 100,039 | 3.16% |
| 8 | 华夏基金—招商银行—华宝信托—长期稳健信托计划 | 100,039 | 3.16% |
| 10 | 光大证券股份有限公司 | 100,000 | 3.16% |
| 10 | 上海准锦投资管理有限公司—准锦鸿利一号私募证券投资基金 | 100,000 | 3.16% |
| 10 | 上海准锦投资管理有限公司—准锦价值 1 号私募证券投资基金 | 100,000 | 3.16% |

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：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：杨明辉

信息披露负责人：李彬

客户服务电话：400-818-6666

传真：010-63136700

注册资本：23800万元

设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]16号

工商登记注册的法人营业执照文号：911100006336940653

经营范围：（一）基金募集；（二）基金销售；（三）资产管理；（四）从事特定客户资产管理业务；（五）中国证监会核准的其他业务。

2、股权结构

| 持股单位 | 持股占总股本比例 |
|---------------------------------|----------|
| 中信证券股份有限公司 | 62.2% |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 13.9% |
| MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION | 13.9% |
| 天津海鹏科技咨询有限公司 | 10% |
| 合计 | 100% |

3、内部组织结构与人员情况

公司设置了合理的组织结构，并根据业务需要进行了合理的人员配置。

公司业务部门主要分为投研部门、风险控制部门、营销部门、后台运作部门等。其中，投研部门主要负责投资研究、投资管理、投资交易等工作；风险控制部门主要负责投资的事前、事中、事后风险合规监控等工作；营销部门主要负责营销和市场推广等工作；后台运作部门主要负责会计估值与核算、注册登记等日常运营业务以及信息系统的管理和维护等工作。

4、基金管理业务情况

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。20 年来，公司秉承“为信任奉献回报”的企业宗旨，坚持以专业、严谨的投资研究为基础，为投资人提供优质的基金产品和理财服务。凭借规范的经营管理和良好的品牌声誉，公司多次荣获境内外权威奖项。

截至目前，公司旗下管理 124 只开放式基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、QDII、FOF 等不同类型，建立了覆盖高中低风险等级的公募基金产品线，为各类风险偏好投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

5、本基金基金经理简介

祝灿先生，芝加哥大学工商管理硕士。曾任中信证券投资管理部投资经理、德意志银行新加坡分行交易员等。2013年7月加入华夏基金管理有限公司，曾任机构债券投资部投资经理、华夏鼎益债券型证券投资基金基金经理（2016年12月27日至2017年12月28日期间）、华夏鼎实债券型证券投资基金基金经理（2017年6月15日至2018年3月14日期间）、华夏鼎茂债券型证券投资基金基金经理（2017年3月15日至2018年3月29日期间）等，现任机构债券投资部总监，华夏新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年4月14日起任职）、华夏鼎智债券型证券投资基金基金经理（2017年1月20日起任职）、华夏鼎隆债券型证券投资基金基金经理（2017年2月16日起任职）、华夏海外收益债券型证券投资基金基金经理（2017年9月8日起任职）、华夏新锦祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017年9月8日起任职）、华夏大中华信用精选债券型证券投资基金（QDII）基金经理（2017年9月8日起任职）、华夏新锦汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017年9月8日起任职）、华夏鼎盛债券型证券投资基金基金经理（2017年12月6日起任职）、华夏鼎兴债券型证券投资基金基金经理（2018年1月12日起任职）、华夏鼎旺三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2018年2月1日起任职）、华夏上证3-5年期中高级评级可质押信用债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（2018年5月3日起任职）、华夏上证3-5年期中高级评级可质押

信用债交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018年5月3日起任职）。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 9 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

基金托管部门负责人：纪伟

信息披露负责人：田青

联系电话：010-67595096

2、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

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

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

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

的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

(三) 基金上市推荐人

广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575或致电各地营业网点

(四) 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：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

法定代表人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

经办注册会计师：徐艳、马剑英

联系人：徐艳

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

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

（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

截至公告前两个工作日即 2018 年 5 月 24 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

| 资产 | 2018 年 5 月 24 日 |
|------------|-----------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 131,383,489.51 |
| 结算备付金 | - |
| 存出保证金 | - |
| 交易性金融资产 | 66,042,850.00 |
| 其中：股票投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 债券投资 | 66,042,850.00 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 衍生金融资产 | - |
| 买入返售金融资产 | 120,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - |

| | |
|-----------------|----------------|
| 应收利息 | 3,155,558.31 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | - |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | 73,953.50 |
| 资产总计 | 320,655,851.32 |
| 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 | 3,409,391.90 |
| 应付赎回款 | - |
| 应付管理人报酬 | 45,591.05 |
| 应付托管费 | 14,589.14 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 应交税费 | 3,361.50 |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 15,688.54 |
| 负债合计 | 3,488,622.13 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 316,726,219.00 |
| 未分配利润 | 441,010.19 |
| 所有者权益合计 | 317,167,229.19 |
| 负债和所有者权益总计 | 320,655,851.32 |

注：截至 2018 年 5 月 24 日，基金份额净值为 100.1392 元，基金份额总额为 3,167,263 份。

八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2018 年 5 月 24 日（本基金合同自 2018 年 5 月 3 日起生效，本报告期自 2018 年 5 月 3 日至 2018 年 5 月 24 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(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | 66,042,850.00 | 20.60 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 120,000,000.00 | 37.42 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 131,383,489.51 | 40.97 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,229,511.81 | 1.01 |
| 8 | 合计 | 320,655,851.32 | 100.00 |

（二）报告期末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。

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|---------------|-------|
| 1 | 国家债券 | 14,509,000.00 | 4.57 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 51,533,850.00 | 16.25 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 66,042,850.00 | 20.82 |

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 122375 | 14 苏新债 | 300,000 | 29,997,000.00 | 9.46 |
| 2 | 019313 | 13 国债 13 | 145,090 | 14,509,000.00 | 4.57 |
| 3 | 122253 | 12 一拖 02 | 58,000 | 5,800,000.00 | 1.83 |
| 4 | 122788 | PR 三明债 | 140,000 | 5,609,800.00 | 1.77 |
| 5 | 122641 | PR 武城投 | 165,000 | 4,126,650.00 | 1.30 |

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

(十一) 投资组合报告附注

1、2018 年 3 月 28 日 14 西南 01 的发行人西南证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《行政监管措施决定书》。本基金投资该证券的决策程序符合相关法律法规的要求。

2、基金投资的前十名股票未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(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 | 3,155,558.31 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 73,953.50 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,229,511.81 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

(一) 2018 年 5 月 4 日发布华夏上证 3-5 年期中高级评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告。

(二) 2018 年 5 月 12 日发布关于华夏上证 3-5 年期中高级评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告。

(三) 2018 年 5 月 16 日发布关于华夏上证 3-5 年期中高级评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

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

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二) 根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就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）备查文件目录

1、中国证监会准予华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复

2、《华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4、《华夏上证3-5年期中高级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

5、法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一八年五月二十八日

附件：基金合同摘要

第一部分 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

法定代表人：杨明辉

成立日期：1998 年 4 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16 号文

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.38 亿元人民币

存续期限：100 年

联系电话：400-818-6666

(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；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换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、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资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (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、半年度和年度基金报告；
- (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；
- (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、足额支付赎回款项；
- (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 15 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，基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用，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；募集期间网下债券认购所募集的债券由登记机构予以冻结；
- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复[2004]143 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

(二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

(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；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(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) 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；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管

理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人

基金投资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) 依法并按照基金合同和招募说明书的约定申请转让或赎回其持有的基金份额;

(4) 按照规定要求召集或召开基金份额持有人大会;

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7) 监督基金管理人的投资运作;

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;

(2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;

(3) 关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《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) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则;
- (10) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息, 以及不时地更新和补充, 并保证其真实性;
- (11) 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。

第二部分 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和基金托管人与本基金相同的联接基金的基金合同生效, 鉴于本基金和联接基金的相关性, 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的基金份额直接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, 法律法规和中国证监会另有规定的除外:

(1) 修改《基金合同》的重要内容或者提前终止《基金合同》，本基金合同对终止《基金合同》另有约定的除外；

(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) 决定调整基金管理人、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) 除本合同另有约定外，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) 终止基金上市，但被上海证券交易所决定终止上市的除外；

(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、在不违反法律法规和基金合同的规定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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、调整基金份额类别的设置；

(3) 因相应的法律法规、证券交易所或者登记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) 基金推出新业务或服务；

(6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、基金交易、

收益分配、非交易过户等业务规则；

(7) 按照指数编制机构的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费率、计算方法或支付方式等；

(8) 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、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和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在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

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的基金份额持有人所持有的基金份额小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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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、电话或其他非现场方式进行表决，或者采用网络、电话或其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

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。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 个工作日内在指定媒介上公告。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、本部分对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。

第三部分 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、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.1% 以上时，基金管理人可以进行收益分配；
- 3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；
- 4、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 5、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 6、本基金收益分配采取现金分红；
- 7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情

调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要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、基金收益分配数额的确定原则

1、在收益评价日，基金管理人计算基金收益率和标的指数同期收益率。

截至收益评价日基金收益率减去标的指数同期收益率的差额超过 0.1%时，基金管理人可以进行收益分配。

基金净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100.00%；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 1 乘以 100.00%。精确到百分号内小数点后 2 位，百分号内小数点后第 3 位四舍五入。

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上述指标。

2、根据前述收益分配原则计算截至基金收益评价日本基金的可分配收益，并确定收益分配比例及收益分配数额。

五、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。

六、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 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

七、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。

第四部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数许可使用费；
- 4、基金上市费及年费；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金份额持有人大会费用；

8、基金的证券、期货交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资融券费、证券相关账户费用及其他类似性质的费用等）；

9、基金的银行汇划费用；

10、账户开户费用和账户维护费；

11、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 0.25% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径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 0.08% 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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内，按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议，但基金管理人应按

照基金合同的约定在指定媒介予以公告。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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。

第五部分 基金财产的投资方向和投资限制

一、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于依法上市的债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、衍生工具（国债期货等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、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。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。

建仓之后，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。

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）本基金跟踪标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）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%；但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

(3) 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%；但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

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

(8) 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；

(9) 本基金进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不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；

(10) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(11) 本基金投资于国债期货仅供套期保值使用。基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值，不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；本基金每个交易日日终在扣除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。

(12) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

(13) 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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

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

(15) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第(8)、(13)、(14)项另有约定外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、标的指数成份债券调整、标的指数成份债券流动性限制、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,基金合同另有约定的除外。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基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,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。

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其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后,本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

第六部分 基金资产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

《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公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后, 基金管理人应当在每个开放日的次日, 通过网站、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。

第七部分 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表决通过之日起生效, 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, 《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。

第八部分 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交北京仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则并以普通程序进行仲裁，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，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。

第九部分 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

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