

# 富国标普石油天然气勘探及生产精选行业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：富国基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

注册登记机构：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：2023 年 11 月 28 日

公告日期：2023 年 11 月 23 日

## 目 录

|                           |    |
|---------------------------|----|
| 一、重要声明与提示.....            | 3  |
| 二、基金概览.....               | 4  |
| 三、基金的募集与上市交易.....         | 5  |
| 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人..... | 8  |
| 五、基金主要当事人简介.....          | 9  |
| 六、基金合同摘要.....             | 14 |
| 七、基金财务状况.....             | 14 |
| 八、基金投资组合.....             | 16 |
| 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：基金合同内容摘要.....          | 24 |

## 一、重要声明与提示

《富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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，富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）基金管理人富国基金管理有限公司（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。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、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 2023 年 10 月 27 日披露于本基金管理人网站（[www.fullgoal.com.cn](http://www.fullgoal.com.cn)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的本基金的基金合同、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。

本基金投资中的风险详见招募说明书“风险揭示”章节，包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是主要投资美国市场的交易型开放式基金，特定风险还包括：投资于境内外市场并以 ETF 方式运作的创新风险、指数化投资的风险、标的指数波动的风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数值计算出错的风险、标的指数编制方案带来的风险、标的指数变更的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、成份股停牌的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、申购赎回清单差错风险、申购及赎回风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、退

市风险、终止清盘风险、第三方机构服务的风险、本基金投资特定品种的特有风险、参与融资业务的风险、参与转融通证券出借业务的风险、境内发行的存托凭证投资风险、境外（主要为美国市场）投资风险、证券借贷/正回购/逆回购风险、引入境外托管人的风险等等。

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为投资境外证券的基金，主要投资于美国市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、美国市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

## 二、基金概览

1、基金名称：富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

2、基金二级市场交易简称：油气 ETF（扩位简称：油气 ETF）

3、二级市场交易代码：513350

4、截至公告日前两个工作日（即 2023 年 11 月 21 日）基金份额总额：214,746,000.00 份

5、截至公告日前两个工作日（即 2023 年 11 月 21 日）基金份额净值：1.0000 元

6、本次上市交易份额：214,746,000.00 份

7、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

8、上市交易日期：2023 年 11 月 28 日

9、基金管理人：富国基金管理有限公司

10、基金托管人：招商银行股份有限公司

11、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：安信证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、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、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、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、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信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、中信证券华南股份有限公司。

本基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商，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、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会 2023 年 8 月 25 日证监许可〔2023〕1908 号。

2、基金运作方式：契约型、交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售期限：本基金募集期自 2023 年 11 月 1 日至 2023 年 11 月 15 日。其中，网下现金认购的日期为 2023 年 11 月 1 日至 2023 年 11 月 15 日；网上现金认购的日期为 2023 年 11 月 9 日至 2023 年 11 月 15 日。

5、发售价格：人民币 1.00 元。

6、发售方式：网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

7、发售机构：

（1）发售主协调人

光大证券股份有限公司。

(2) 网下现金认购的直销机构

富国基金管理有限公司。

(3) 网下现金认购的发售代理机构

安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

(4) 网上现金认购的发售代理机构

具有基金销售业务资格，并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的证券公司（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

8、验资机构名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

本基金首次募集认购资金及已结息利息合计人民币 214,746,000.00 元已于 2023 年 11 月 20 日转入托管账户，其中认购资金金额为人民币 214,746,000.00 元，已结息利息为人民币 0.00 元；有效认购资金产生的未结息利息人民币 55,350.55 元将于最近下一个结息日结息后划付。

本基金募集期间的实收资金合计为人民币 214,746,000.00 元，折算成基金份额共计 214,746,000.00 份，有效认购户数为 1,406 户(以基金注册登记机构计算并确认的结果为准)。

10、基金备案情况

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《富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》、《富国标普石油天然气勘探及生产精选行业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基金备案手续，并于 2023 年 11 月 20 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。

11、基金合同生效日：2023 年 11 月 20 日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：214,746,000.00 份

（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[2023]257 号

2、上市交易日期：2023 年 11 月 28 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：油气 ETF（扩位简称：油气 ETF）

5、二级市场交易代码：513350

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。

本基金管理人自 2023 年 11 月 28 日开始办理本基金的申购和赎回业务。投资者应当在本基金指定的申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的申购赎回代理券商包括：安信证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、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、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、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、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、平安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信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、中信证券华南股份有限公司。

本公司可适时增加或调整申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

6、本次上市交易份额：214,746,000.00 份

7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）持有人户数

截至 2023 年 11 月 21 日，本基金场内份额持有人户数为 1,406 户，平均每户持有的基金份额为 152,735.42 份。

### （二）持有人结构

截至 2023 年 11 月 21 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 68,154,000.00 份，占基金总份额的 31.74%；个人投资者持有的基金份额为 146,592,000.00 份，占基金总份额的 68.26%。

### （三）前十名基金份额持有人的情况

| 序号 | 客户名称                                      | 投资者持有基金份额(含利息转份额) | 份额占比   |
|----|-------------------------------------------|-------------------|--------|
| 1  | 上海铭泓私募基金管理有限公司－铭泓成长二号私募证券投资基金             | 30,000,000.00     | 13.97% |
| 2  | 上海弈倍私募基金管理有限公司－弈倍龙杉七号私募证券投资基金             | 10,000,000.00     | 4.66%  |
| 3  | 安信证券资管－安信证券股份有限公司－安信资管安和 1 号 FOF 单一资产管理计划 | 7,000,000.00      | 3.26%  |
| 4  | 中国银河证券股份有限公司                              | 7,000,000.00      | 3.26%  |
| 5  | 上海证券－国泰君安证券股份有限公司－上海证券正和 2 号 FOF 单一资产管理计划 | 5,000,000.00      | 2.33%  |
| 6  | 刘敏                                        | 1,999,000.00      | 0.93%  |
| 7  | 胡高宏                                       | 1,500,000.00      | 0.70%  |
| 8  | 谭茂伟                                       | 1,350,000.00      | 0.63%  |
| 9  | 李智                                        | 1,300,000.00      | 0.61%  |
| 10 | 浙江君颐资产管理有限公司－君颐庄威 1 号私募证券投资基金             | 1,100,000.00      | 0.51%  |

|    |               |        |
|----|---------------|--------|
| 合计 | 66,249,000.00 | 30.85% |
|----|---------------|--------|

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：富国基金管理有限公司
- 2、法定代表人：裴长江
- 3、总经理：陈戈
- 4、注册资本：5.2 亿元人民币
- 5、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

- 6、设立批准文号：证监基金字【1999】11 号
- 7、工商登记注册的统一社会信用代码：91310000710924515X
- 8、经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理
- 9、股权结构（截至 2023 年 9 月 30 日）：

| 股东名称            | 出资比例    |
|-----------------|---------|
| 海通证券股份有限公司      | 27.775% |
| 申万宏源证券有限公司      | 27.775% |
| 加拿大蒙特利尔银行       | 27.775% |
| 山东省金融资产管理股份有限公司 | 16.675% |

### 10、内部组织结构及职能：

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作，确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则，防范和化解运作风险、合规与道德风险。

公司目前下设三十三三个部门、三个分公司和二个子分公司，分别是：权益投资部、固定收益投资部、固定收益专户投资部、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、固定收益交易部、多元资产投资部、量化投资部、海外权益投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、机构业务部、养老金业务部、银行业务部、券商业务部、机构服务部、零售业务部、华东零售总部、

北方零售总部、营销管理部、客户服务部、数字金融业务部、战略与产品部、合规稽核部、风险管理部、计划财务部、人力资源部、综合管理部（董事会办公室）、信息技术部、运营部、不动产基金管理部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理（香港）有限公司、富国资产管理（上海）有限公司。

权益投资部：负责权益类基金产品的投资管理；固定收益投资部：根据法律法规、公司规章制度、契约要求，在授权范围内，负责固定收益类公募产品和部分非固定收益类公募产品的投资管理；固定收益专户投资部：负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理；固定收益信用研究部：建立和完善债券信用评级体系，开展信用研究等，为公司固定收益类投资决策提供研究支持；固定收益策略研究部：开展固定收益投资策略研究，统一固定收益投资中台管理，为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制；固定收益交易部：在公司投委会、分管领导授权范围内，负责审核并执行各固定收益投资组合指令，实现对投资交易一线风险控制的前提下，高效、公平地完成投资指令，并结合执行情况完成交易反馈；多元资产投资部：根据法律法规、公司规章制度、契约要求，在授权范围内，负责 FOF 基金投资运作和跨资产、跨品种、跨策略的多元资产配置产品的投资管理；量化投资部：负责公司有关量化投资管理业务；海外权益投资部：负责公司在中国境外（含香港）的权益投资管理；权益专户投资部：负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理；养老金投资部：负责养老金（企业年金、职业年金、基本养老金、社保等）及类养老金专户等产品的投资管理；权益研究部：负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等；集中交易部：负责除固定收益之外的各类投资交易和风险控制；机构业务部：负责保险、财务公司、上市公司、主权财富基金、基金会、券商、信托、私募、同业养老金管理人、同业公募基金 FOF、海外客户等客群的销售与服务；养老金业务部：负责养老金第一、第二支柱客户、共同参与第三支柱客户的销售与服务；银行业务部：负责银行客户的金融市场部、同业部、资产管理部、私人银行部等部门非代销销售与服务；券商业务部：根据公司发展战略，以券商客户为核心，打造包括私募、上市公司等在内的券商业务生态圈，深耕券商总部及分支机构，带动券商代销及相关业务的发展，不断增加券商保有规模，提升公司品牌影响力，为公司整体业务协同提供有效补充；机构服务部：负责协

调三个机构销售部门对接公司资源，实现项目落地，提供专业支持和项目管理，对公司已有机构客户进行持续专业服务；零售业务部：管理华东零售总部、北方零售总部、广州分公司、成都分公司，负责公募基金的零售业务；营销管理部：负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒介关系管理，为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持；客户服务部：拟定客户服务策略，制定客户服务规范，建设客户服务团队，提高客户满意度，收集客户信息，分析客户需求，支持公司决策；数字金融业务部：结合数字经济与互联网发展特征，拟定并落实公司互联网基金销售与服务策略和实施细则，有效推进公司数字金融业务发展；战略与产品部：负责开发、维护公募和非公募产品，协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略，建立数据搜集、分析平台，为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持；合规稽核部：履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职责，开展内部审计，管理信息披露、法律事务等；风险管理部：执行公司整体风险管理策略，牵头拟定公司风险管理制度与流程，组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对，负责公司旗下各投资组合合规监控等；信息技术部：负责软件开发与系统维护等；运营部：负责基金会计与清算；不动产基金管理部：根据公司发展战略，开展公开募集基础设施证券投资基金业务等；计划财务部：负责公司财务计划与管理；人力资源部：负责人力资源规划与管理；综合管理部（董事会办公室）：负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司（内部）宣传、信息调研、行政后勤管理等工作；富国资产管理（香港）有限公司：证券交易、就证券提供意见和提供资产管理；富国资产管理（上海）有限公司：经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。

#### 11、人员情况

截至 2023 年 6 月 30 日，公司有员工 748 人，其中 77%以上具有硕士及以上学历。

#### 12、信息披露负责人：赵瑛

电话：021-20361818

#### 13、基金管理业务介绍

截至 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 304 只公募基金和多个全国社保

基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，公募基金资产管理规模超过 9151 亿元。

#### 14、本基金基金经理

田希蒙，硕士，自 2017 年 5 月加入富国基金管理有限公司，历任助理定量研究员、定量研究员、定量投资经理；现任富国基金量化投资部定量基金经理。自 2023 年 01 月起任富国中证港股通互联网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；自 2023 年 01 月起任富国中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 03 月起任富国中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；自 2023 年 04 月起任富国恒生港股通高股息低波动交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 06 月起任富国恒生港股通医疗保健交易型开放式指数证券投资基金基金经理；自 2023 年 09 月起任富国恒生港股通高股息低波动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；自 2023 年 10 月起任富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；自 2023 年 11 月起任富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理；具有基金从业资格。

#### （二）基金托管人

##### 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、主要人员情况

缪建民先生，招商银行董事长、非执行董事，2020年9月起担任招商银行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险(集团)公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险(香港)有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王良先生，招商银行执行董事、党委书记、行长。中国人民大学硕士研究生学历，高级经济师。1995年6月加入招商银行北京分行，自2001年10月起历任招商银行北京分行行长助理、副行长、行长，2012年6月任招商银行行长助理兼任北京分行行长，2013年11月不再兼任招商银行北京分行行长，2015年1月任招商银行副行长，2016年11月至2019年4月兼任招商银行董事会秘书，2019年4月至2023年2月兼任招商银行财务负责人，2021年8月任招商银行常务副行长，2021年8月-2023年4月兼任招商银行董事会秘书、公司秘书及香港上市相关事宜之授权代表，2022年4月18日起全面主持招商银行工作，2022年5月19日起任招商银行党委书记，2022年6月15日起任招商银行行长。兼任中国支付清算协会副会长、中国银行业协会中间业务专业委员会第四届主任、中国金融会计学会第六届常务理事。

彭家文先生，招商银行行长助理兼财务负责人、董事会秘书。中南财经大学国民经济计划专业本科学历，高级经济师。2001年9月加入招商银行，历任总行计划财务部总经理助理、副总经理，总行零售综合管理部副总经理、总经理，总行零售金融总部副总经理、副总裁、副总裁兼总行零售信贷部总经理，郑州分行行长，总行资产负债管理部总经理，2023年2月起任招商银行行长助理，兼任招商银行财务负责人、董事会秘书、总行资产负债管理部总经理。

孙乐女士，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，2001年8月加入招商银行至今，历任招商银行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部

总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长，具有 20 余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

### 3、基金托管业务经营情况

截至 2023 年 6 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 1265 只证券投资基金。

#### （三）基金验资机构

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

执行事务合伙人：付建超

联系电话：+86 21 61418888

传真：+86 21 63350003

联系人：汪芳、冯适

经办注册会计师：汪芳、冯适

## 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

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书及相关公告设定的费率收取认购费。

#### （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

本基金 2023 年 11 月 21 日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

| 资 产      | 本期末<br>(2023 年 11 月 21 日) |
|----------|---------------------------|
| 资 产：     |                           |
| 银行存款     | 214,627,702.52            |
| 结算备付金    | —                         |
| 存出保证金    | —                         |
| 交易性金融资产  | 21,215,919.39             |
| 其中：股票投资  | 21,215,919.39             |
| 基金投资     | —                         |
| 债券投资     | —                         |
| 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 | —                         |
| 应收清算款    | —                         |
| 应收股利     | —                         |
| 应收申购款    | —                         |
| 递延所得税资产  | —                         |
| 其他资产     | 55,350.55                 |
| 资产总计     | 235,898,972.46            |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>(2023 年 11 月 21 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      | 21,142,020.37  |
| 应付赎回款      | —              |
| 应付管理人报酬    | 2,942.50       |
| 应付托管费      | 588.50         |
| 应付销售服务费    | —              |
| 应付投资顾问费    | —              |
| 应交税费       | —              |
| 应付利润       | —              |
| 递延所得税负债    | —              |
| 其他负债       | 2,142.86       |
| 负债合计       | 21,147,694.23  |
| 所有者权益：     |                |
| 实收基金       | 214,746,000.00 |
| 其他综合收益     | —              |
| 未分配利润      | 5,278.23       |
| 所有者权益合计    | 214,751,278.23 |
| 负债和所有者权益总计 | 235,898,972.46 |

注：报告截止日 2023 年 11 月 21 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 214,746,000.00 份。

## 八、基金投资组合

本基金目前仍处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

截至 2023 年 11 月 21 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 | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|----|--------------|
|----|----|----|--------------|

|  |                   |                |        |
|--|-------------------|----------------|--------|
|  | 权益投资              | 21,215,919.39  | 8.99   |
|  | 其中：普通股            | 21,215,919.39  | 8.99   |
|  | 存托凭证              | —              | —      |
|  | 房地产信托凭证           | —              | —      |
|  | 基金投资              | —              | —      |
|  | 固定收益投资            | —              | —      |
|  | 其中：债券             | —              | —      |
|  | 资产支持证券            | —              | —      |
|  | 金融衍生品投资           | —              | —      |
|  | 其中：远期             | —              | —      |
|  | 期货                | —              | —      |
|  | 期权                | —              | —      |
|  | 权证                | —              | —      |
|  | 买入返售金融资产          | —              | —      |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —      |
|  | 货币市场工具            | —              | —      |
|  | 银行存款和结算备付金合计      | 214,627,702.52 | 90.98  |
|  | 其他资产              | 55,350.55      | 0.02   |
|  | 合计                | 235,898,972.46 | 100.00 |

注：本基金目前仍处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关规定。

（二）报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

金额单位：元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例<br>（%） |
|--------|------|------------------|
|--------|------|------------------|

|    |               |      |
|----|---------------|------|
| 美国 | 21,215,919.39 | 9.88 |
| 合计 | 21,215,919.39 | 9.88 |

(三) 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：元

| 行业类别 | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|------|---------------|--------------|
| 能源   | 21,215,919.39 | 9.88         |
| 合计   | 21,215,919.39 | 9.88         |

(四) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称（英文）                | 公司名称（中文）                  | 证券代码 | 所在证券市场  | 所属国家（地区） | 数量（股） | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------------------------|---------------------------|------|---------|----------|-------|------------|--------------|
| 1  | RANGE RESOURCES CORP    | 山脉资源集团                    | RRC  | 美国证券交易所 | 美国       | 2526  | 594,685.02 | 0.28         |
| 2  | SOUTH WESTERN ENERGY CO | 西南能源（SOUTHWESTERN ENERGY） | SWN  | 美国证券交易所 | 美国       | 12323 | 589,557.21 | 0.27         |
| 3  | Chordiant Software Inc  | CHORD IANT SOFTWARE INC   | CHRD | 美国证券交易所 | 美国       | 510   | 584,129.64 | 0.27         |
| 4  | PIONEER NATURAL         | 先锋自然资源（PIONEER）           | PXD  | 美国证券交易所 | 美国       | 344   | 582,527.29 | 0.27         |

|    |                                   |                                          |      |                 |    |      |                  |       |
|----|-----------------------------------|------------------------------------------|------|-----------------|----|------|------------------|-------|
|    | RESOURCES<br>CO                   |                                          |      |                 |    |      |                  |       |
| 5  | DIAMO<br>NDBACK<br>ENER           | DIAMO<br>NDBACK<br>ENER                  | FANG | 美国<br>证券交易<br>所 | 美国 | 526  | 582, 51<br>1. 15 | 0. 27 |
| 6  | PHILL<br>IPS 66                   | PHILL<br>IPS 66                          | PSX  | 美国<br>证券交易<br>所 | 美国 | 671  | 562, 55<br>1. 53 | 0. 26 |
| 7  | CNX 资<br>源公司                      | CNX 资<br>源公司                             | CNX  | 美国<br>证券交易<br>所 | 美国 | 3656 | 558, 14<br>7. 00 | 0. 26 |
| 8  | Marat<br>hon<br>Petroleum<br>Corp | 马拉<br>松原油<br>(MARATHON<br>PETROLEUM<br>) | MPC  | 美国<br>证券交易<br>所 | 美国 | 528  | 556, 60<br>0. 06 | 0. 26 |
| 9  | Ovint<br>iv Inc.                  | 加拿<br>大能源                                | OVV  | 美国<br>证券交易<br>所 | 美国 | 1734 | 553, 09<br>5. 02 | 0. 26 |
| 10 | EQT<br>Corp                       | EQT 能<br>源 (EQT)                         | EQT  | 美国<br>证券交易<br>所 | 美国 | 1932 | 552, 10<br>1. 48 | 0. 26 |

(五) 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资  
明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(九) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

(十) 投资组合报告附注

1、申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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    | —         |
| 5  | 应收申购款   | —         |
| 6  | 其他应收款   | 55,350.55 |
| 7  | 待摊费用    | —         |
| 8  | 其他      | —         |
| 9  | 合计      | 55,350.55 |

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：截止 2023 年 11 月 21 日，本基金未持有债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截止 2023 年 11 月 21 日，本基金前十名股票中未持有流通受限的股票。

## 九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本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；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

（一）中国证监会准予本基金募集注册的文件

（二）《富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》

（三）《富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》

（四）《富国标普石油天然气勘探及生产精选行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》

（五）法律意见书

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

### 风险提示：

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读本基金的基金合同、基金招募说明书和基金产品资料概要等产品法律文件和风险揭示书，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

富国基金管理有限公司

2023 年 11 月 23 日

## 附件：基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### （一）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、转换和收益分配等的业务规则；

（17）选择、更换或撤销基金境外投资顾问、境外证券服务机构等；

（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）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、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，确定基金份额申购对价、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，以及根据监管机构、司法机关等有权机关的要求或因审计、法律等外部专业顾问要求提供的情况外，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、足额支付投资者赎回对价；

(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，保存期限不低于法律法规的规定；

(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条件下得到有关资料的复印件；

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

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基

金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金的退还工作；

（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）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；

（28）基金管理人应按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务；

（29）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；

（30）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；

（31）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利与义务

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

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

（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、期货等交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

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

(8) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管（或委托境外资产托管人保管）由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，以及根据监管机构、司法机关等有权机关的要求或因审计、法律等外部专业顾问要求提供的情况外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(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，保存期限不少于法律法规的规定；

(12) 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；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）资金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有，境外现金存入资金账户时构成境外托管人的等额债务，基金份额持有人不对该现金资产享有优先求偿权，除非法律法规及撤销或清算程序明文规定该等现金不归于清算财产外。境外资产托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产或破产等原因进行终止清算时，除非在相关法律法规强制要求下，不得将托管资产项下的证券、非现金资产归入其清算资产；

（22）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；

（23）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（24）选择符合《试行办法》第十九条规定的境外托管人。对基金的境外财产，基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责；境外托管人在履行职

责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致基金财产受损的，基金托管人承担相应责任；在决定境外托管人是否存在过错、疏忽等不当行为时，应根据基金托管人与境外托管人之间的协议适用法律及当地的法律法规、证券市场惯例决定；但基金托管人已按照谨慎、尽职的原则选择、委任和监督境外托管人，且境外托管人已按照当地法律法规的要求托管资产的前提下，对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人不承担责任；

（25）按照规定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；

（26）按照监管规定，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；

（27）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；

（28）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，其保存时间不少于法律法规规定的最低期限；

（29）及时将公司行为信息通知基金管理人；

（30）对基金管理人发送的指令负有形式审查义务；

（31）法律法规及中国证监会、外管局规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利和义务

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、基金产品资料概要等信息披露文件；
- (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) 交纳基金认购款项和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。

本基金份额持有人大会不设日常机构。若未来本基金份额持有人大会成立日常机构，则按照届时有效的法律法规的规定执行。

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。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

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

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

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

#### 一、召开事由

1、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外；
- （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) 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情形除外；
- (14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或者变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记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) 变更业绩比较基准；
- (6) 基金推出新业务或服务；
- (7) 基金管理人、相关证券交易所、基金登记机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整或修改《业务规则》，包括但不限于有关基金认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等内容；
- (8) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- (9) 调整基金份额净值、申购赎回清单的内容、计算和公告的时间或频率；
- (10) 调整基金收益分配原则；

(11) 基金增减或调整销售币种；

(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或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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、在法律法规和监管机构允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他书面或非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权，具体方式在会议通知中列明。

4、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。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

## 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。除法律法规另有规定或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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

## 七、计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。

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

## 九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决

条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金的收益与分配

#### （一）基金收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金每年收益分配次数没有限制，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率（使用估值汇率折算）。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；

3、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、本基金收益分配采用现金方式；

5、法律法规、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，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基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，并应于变更实施日前在规定媒介公告。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

#### （二）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。

#### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

#### （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，含境外托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货和股票期权等交易、结算费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、清算、登记等各项费用）；
- 7、基金的银行汇划费用和外汇兑换交易的相关费用；
- 8、基金上市费用、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 9、基金合同生效后基金的证券、期货账户开户费用，银行账户维护费用；
- 10、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；
- 11、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用；
- 12、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；
- 13、除去基金管理人和基金托管人因自身原因而导致的更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原任基金托管人转移至新任基金托管人以及由于境外托管人更换导致基金资产转移所引起的费用；
- 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。

##### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—14 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，不从基金财产中列支：

- 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、由基金管理人承担的基金标的指数许可使用费；
- 5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照中国或所投资市场所在国家或地区的法律法规的规定履行纳税。本基金在投资和运作过程中如发生增值税等应税行为，相应的增值税、附加税费以及可能涉及的税收滞纳金等由基金财产承担，

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

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。

## **五、基金的投资范围和投资限制**

### **（一）投资范围**

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可以少量投资于境内、境外市场的其他资产，包括但不限于其他非成份股的股票。

针对境内投资，本基金可少量投资于国内依法发行上市的股票（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、股票期权等）、货币市场工具以及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及转融通证券出借业务。

针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：

- 1、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；
- 2、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、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；
- 3、政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；
- 4、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协

议、短期政府债券等货币市场工具；

5、远期合约、互换及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；

6、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；

7、本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准；

8、中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

## （二）投资限制

1、本基金境外投资组合应遵循以下限制：

### （1）投资比例限制

1）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%，其中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不受此限制；

2）本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资产净值的 10%。其中，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%;

5) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金资产净值的 10%，持有货币市场基金不受上述限制;

6) 同一基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%;

## (2) 金融衍生品投资

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

1) 本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) 本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) 本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: 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; 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; 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过本基金资产净值的 20%;

## (3) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定:

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

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

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

4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种:

a) 现金;

b) 存款证明;

c) 商业票据;

d) 政府债券;

e) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证；

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

6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任；

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

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

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

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

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

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

(5) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产；

(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。

除上述第 (1) 项下第 4) 目情形之外，若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓，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。

2、本基金境内投资组合应遵循以下限制：

(1) 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%;

(2) 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%;

(3) 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%;

(4) 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%;

(5) 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;

(6) 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;

(7) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

本基金参与股指期货交易的, 应当遵循下列(8)-(13)要求:

(8) 本基金在任何交易日日终, 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%;

(9) 本基金在任何交易日日终, 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;

(10) 本基金在任何交易日日终, 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%;

(11) 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;

(12) 本基金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%;

(13) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权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、应收申购款等；

本基金参与股票期权交易的，应当遵守下列（14）-（16）要求：

（14）因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

（15）开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

（16）未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（17）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，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%；

（18）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；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归为流动性受限资产；参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；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；

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

（20）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；

（21）本基金投资境内发行的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；

（22）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（5）、（18）至（20）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等

基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、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（18）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。

### 3、本基金境内外投资组合均应遵循以下限制：

- （1）通常情况下，本基金投资标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）的资产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）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；
- （3）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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例的，基金管理人应当 30 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，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以变更后的规定为准。

### 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）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；
- (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及基金合同规定禁止从事的其他活动。

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。

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，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按调整后的规定执行。

## **六、基金资产净值的计算和公告方式**

### **(一) 基金资产总值**

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

### **(二) 基金资产净值**

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### **(三) 基金净值信息公告**

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

在开始办理基金份额申购或者赎回或上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的次二个工作日，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。

基金管理人应在不晚于半年度和年度最后一日的次二个工作日,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,并报中国证监会备案。

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

### **(二) 基金合同的终止事由**

有下列情形之一的,经履行相关程序后,基金合同应当终止:

- 1、基金份额持有人大会决定终止的;
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止,在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
- 3、出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的;
- 4、基金合同约定的其他情形;
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### **(三) 基金财产的清算**

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

2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》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过符合《中华人民共和国证券法》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，由基金财产清算小组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，保存期限不少于法律法规的规定。

### 八、争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经

友好协商未能解决的，均应提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人、基金托管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（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）管辖。

## **九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

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