

华安中债 1-5 年国开行债券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：华安基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2022 年 10 月 24 日

公告日期：2022 年 10 月 19 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	5
五、基金主要当事人简介	6
六、基金合同摘要	18
七、基金财务状况	19
八、基金投资组合	21
九、重大事项揭示	23
十、基金管理人承诺	24
十一、基金托管人承诺	25
十二、备查文件目录	26
附件：基金合同内容摘要	27

一、重要声明与提示

华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本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。本基金托管人上海浦东发展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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳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，请投资人详细查阅 2022 年 7 月 27 日刊登在本基金管理人网站（www.huaan.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

- 1、基金名称：华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金场内简称：国开债 ETF。
- 3、基金代码：159649。
- 4、2022 年 10 月 17 日基金份额总额：80,001,877.00 份。
- 5、2022 年 10 月 17 日基金份额净值：100.3872 元。
- 6、本次上市交易的基金份额总额：80,001,877.00 份。
- 7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
- 8、上市交易日期：2022 年 10 月 24 日。
- 9、基金管理人：华安基金管理有限公司。
- 10、基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司。
- 11、本次上市交易的基金份额登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。
- 12、申购赎回代理券商

目前通过深圳证券交易所进行的场内申购赎回的代理券商：安信证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、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和中信证券华南股份有限公司。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

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〔2022〕1418 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：本基金自 2022 年 8 月 1 日至 2022 年 8 月 2 日公开发售。

5、发售价格：1.00 元人民币。

6、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购 2 种方式。

7、发售机构

详见《华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》及相关公告。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

9、募集资金总额及入账情况

本基金自 2022 年 8 月 1 日起向社会公开募集，截至 2022 年 8 月 2 日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为 7,999,999,968.00 元人民币，折合基金份额 7,999,999,968.00 份；认购资金在募集期间产生的银行利息折合基金份额 165,829.00 份。上述资金总额已于 2022 年 8 月 8 日全额划入本基金托管账户。

本次募集有效认购户数为 2,185 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，募集期间募集及利息结转的基金份额共计 8,000,165,797.00 份，已全部计入基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

10、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《华安中债 1-5 年国开行债券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，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2022 年 8 月 8 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：2022 年 8 月 8 日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：8,000,165,797.00 份。

（二）本基金基金份额折算

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》等法律法规和《华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金以 2022 年 8 月 16 日为权益登记日进行基金份额折算。折算对象为权益登记日在登记机构登记在册的本基金份额。基金份额折算方法为：折算后基金份额持有人持有的基金份额=折算前基金份额持有人持有的基金份额/100。本基金登记机构按照上述折算方式对各基金份额持有人持有的本基金基金份额进行折算，并进行变更登记，折算后的基金份额保留至整数位。权益登记日（折算当日）本基金折算前基金份额总额为 8,000,165,797.00 份，折算前基金份额净值为 1.0003 元；权益登记日（折算当日）本基金折算后基金份额总额为 80,001,877.00 份，折算后基金份额净值为 100.0286 元。基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。

（三）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：深圳证券交易所深证上【2022】1000 号。

2、上市交易日期：2022 年 10 月 24 日。

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

4、基金场内简称：国开债 ETF。

5、基金交易代码：159649。

6、本次上市交易份额：80,001,877.00 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。

8、基金资产净值的披露：在基金份额上市交易后或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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 2022 年 10 月 17 日，本基金基金份额持有人户数为 2,185 户，平均每户持有的基金份额为 36,614.13 份。

（二）持有人结构

截至 2022 年 10 月 17 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 78,382,947.00 份，占基金总份额的 97.98%；个人投资者持有的基金份额为 1,618,930.00 份，占基金总份额的 2.02%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至 2022 年 10 月 17 日，前十名基金份额持有人的情况如下表：

序号	基金份额持有人名称 (全称)	持有基金份额 (份)	占基金总份额 的比例 (%)
1	中信证券股份有限公司	11,812,850.00	14.77
2	申万宏源证券有限公司	11,812,731.00	14.77
3	国泰君安证券股份有限 公司	9,969,043.00	12.46
4	招商证券股份有限公司	9,844,041.00	12.30
5	中国银河证券股份有限 公司	9,844,041.00	12.30
6	东方证券股份有限公司	7,876,796.00	9.85
7	国信证券股份有限公司	4,922,021.00	6.15
8	海通证券股份有限公司	4,922,021.00	6.15
9	长江证券股份有限公司	3,937,617.00	4.92
10	中信建投证券—中信银 行—中信建投—双赢增 利 7 号集合资产管理计 划	1,968,809.00	2.46

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：华安基金管理有限公司

2、法定代表人：朱学华

3、总经理：张霄岭

4、注册资本：1.5 亿元人民币

5、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31-32 层

6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【1998】20 号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000062071

8、经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

9、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	51%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	12%
上海锦江国际投资管理有限公司	12%
上海上国投资产管理有限公司	5%

10、内部组织结构及职能

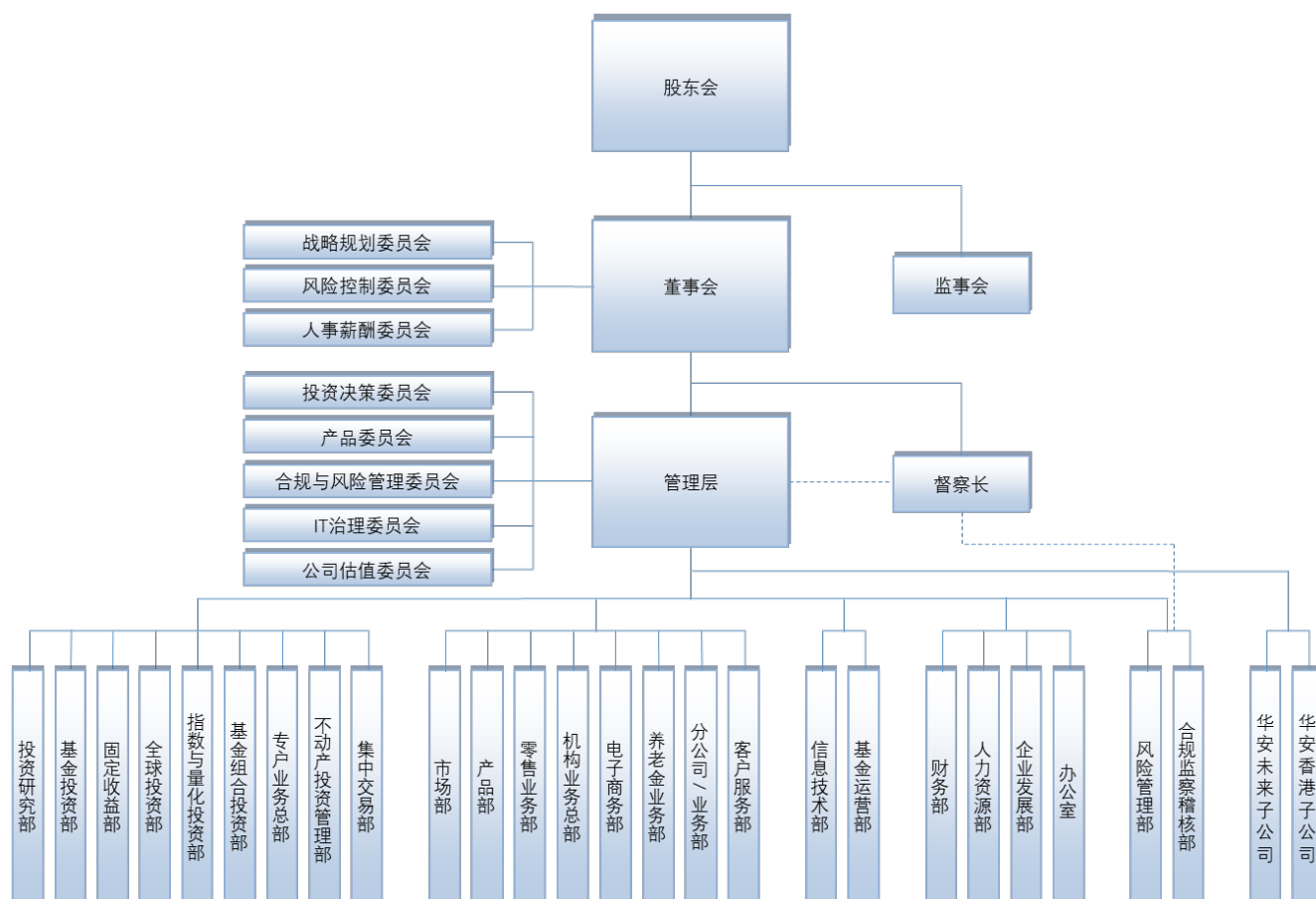
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。

董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由九名董事组成，其中，每一股东各推荐一名，总经理为公司董事，另三名为独立董事。董事会为股东大会的执行机构，并对股东大会负责。董事会下设风险控制、战略规划和人事薪酬等三个专业委员会。

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

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

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



11、人员情况：

截至 2022 年 9 月 30 日，公司目前共有员工 459 人（不含子公司），其中 66.2%具有硕士及以上学历，92.8%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

12、信息披露负责人：陆滢

电话：（021）38969727

13、基金管理业务情况简介：

截至 2022 年 9 月 30 日，华安基金管理有限公司旗下管理的基金包括：华安

稳健回报混合型证券投资基金、华安双债添利债券型证券投资基金、华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、华安年年红定期开放债券型证券投资基金、华安年年盈定期开放债券型证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华安大国新经济股票型证券投资基金、华安新活力灵活配置混合型证券投资基金、华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华安汇财通货币市场基金、华安现金宝货币市场基金、华安物联网主题股票型证券投资基金、华安媒体互联网混合型证券投资基金、华安智能装备主题股票型证券投资基金、华安新丝路主题股票型证券投资基金、华安新动力灵活配置混合型证券投资基金、华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金、华安新回报灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金、华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华安添颐混合型发起式证券投资基金、华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金、华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金、华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金、华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金、华安安益灵活配置混合型证券投资基金、华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金、华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金、华安安华灵活配置混合型证券投资基金、华安安康灵活配置混合型证券投资基金、华安全球美元收益债券型证券投资基金、华安安禧灵活配置混合型证券投资基金、华安全球美元票息债券型证券投资基金、华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金、华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金、华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、华安鼎丰债券型发起式证券投资基金、华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金、华安幸福生活混合型证券投资基金、华安鼎瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金、华安红利精选混合型证券投资基金、华安安悦债券型证券投资基金、华安研究精选混合型证券投资基金、华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、华安鼎益债券型证券投资基金、华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华安双核驱动混合型证券投资基金、华安低碳生活混合型证券投资基金、华安中证 500 行业中性低波动交易型开

放式指数证券投资基金联接基金、华安制造先锋混合型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、华安沪港深优选混合型证券投资基金、华安智能生活混合型证券投资基金、华安安盛 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安安业债券型证券投资基金、华安安和债券型证券投资基金、华安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、华安安平 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金、华安安嘉 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安鼎信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安成长创新混合型证券投资基金、华安稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、华安现金润利浮动净值型发起式货币市场基金、华安优质生活混合型证券投资基金、华安鑫福 42 个月定期开放债券型证券投资基金、华安现代生活混合型证券投资基金、华安医疗创新混合型证券投资基金、华安汇智精选两年持有期混合型证券投资基金、华安安敦债券型证券投资基金、华安科技创新混合型证券投资基金、华安鑫浦 87 个月定期开放债券型证券投资基金、华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安安腾一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华安金享混合型发起式证券投资基金、华安添瑞 6 个月持有期混合型证券投资基金、华安添福 18 个月持有期混合型证券投资基金、华安中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、华安聚优精选混合型证券投资基金、华安锦源 0-7 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、华安平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、华安汇嘉精选混合型证券投资基金、华安锦溶 0-5 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安添禧一年持有期混合型证券投资基金、华安新兴消费混合型证券投资基金、华安添利 6 个月持有期债券型证券投资基金、华安优势企业混合型证券投资基金、华安成长先锋混合型证券投资基金、华安添益一年持有期混合型证券投资基金、华安精致生活混合型证券投资基金、华安汇宏精选混合型证券投资基金、华安聚恒精选混合型证券投资基金、华安聚嘉精选混合型证券投资基金、华安添祥 6 个月持有期混合型证券投资基金、华安研究驱动混合型证券投资基金、华安研究智选混合型证券投资基金、华安兴安优选一年持有期混合型证券投资基金、华安宁享 6 个月持

有期混合型证券投资基金、华安均衡优选混合型证券投资基金、华安优势龙头混合型证券投资基金、华安众鑫 90 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、华安聚弘精选混合型证券投资基金、华安添荣中短债债券型证券投资基金、华安锦灏金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安添和一年持有期债券型证券投资基金、华安民享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金、华安 CES 半导体芯片行业指数型发起式证券投资基金、华安慧萃组合精选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安优享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安领荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华安众悦 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华安乾煜债券型发起式证券投资基金、华安研究领航混合型证券投资基金、华安品质甄选混合型证券投资基金、华安顺穗债券型证券投资基金、华安众享 180 天持有期中短债债券型证券投资基金、华安制造升级一年持有期混合型证券投资基金、华安景气驱动一年持有期混合型证券投资基金、华安产业精选混合型证券投资基金、华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安产业动力 6 个月持有期混合型证券投资基金、华安添信债券型证券投资基金、华安优势精选混合型证券投资基金、华安新能源主题混合型证券投资基金、华安中证 500 指数增强型证券投资基金、华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安景气优选混合型证券投资基金、华安品质领先混合型证券投资基金、华安添顺债券型证券投资基金、华安沣瑞一年持有期混合型证券投资基金、华安创新医药锐选量化股票型发起式证券投资基金、华安价值驱动一年持有期混合型证券投资基金、华安产业趋势混合型证券投资基金、华安鼎安优选一年持有期混合型证券投资基金、华安中证 1000 指数增强型证券投资基金、华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)、华安添锦债券型证券投资基金、华安优嘉精选混合型证券投资基金、华安中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金、华安积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、华安沣悦债券型证券投资基金、华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现

金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利混合型证券投资基金、华安中小盘成长混合型证券投资基金、华安策略优选混合型证券投资基金、华安稳定收益债券型证券投资基金、华安核心优选混合型证券投资基金、华安强化收益债券型证券投资基金、华安动态灵活配置混合型证券投资基金、华安行业轮动混合型证券投资基金、华安香港精选股票型证券投资基金、华安稳固收益债券型证券投资基金、华安升级主题混合型证券投资基金、华安大中华升级股票型证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、华安科技动力混合型证券投资基金、华安信用四季红债券型证券投资基金、华安逆向策略混合型证券投资基金、华安安心收益债券型证券投资基金、华安日日鑫货币市场基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、华安添鑫中短债债券型证券投资基金、华安纳斯达克 100 指数证券投资基金、华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华安纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金、华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金、华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)、华安中证银行指数型证券投资基金、华安中证全指证券公司指数型证券投资基金、华安创业板 50 指数型证券投资基金、华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金、华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华安创业板两年定期开放混合型证券投资基金、华安智联混合型证券投资基金(LOF)、华安张江光大园封闭式基础设施证券投资基金、上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金、华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金、华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金、华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金、华安法国 CAC40 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华安三菱日联日经 225 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金、华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华安中证全指证券公司交易型开放式指数

证券投资基金、华安中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金、华安中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、华安中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安易富黄金交易型开放式证券投资基金、华安安信消费服务混合型证券投资基金、华安安顺灵活配置混合型证券投资基金、华安上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金、华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金和华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金。

14、本基金基金经理

苏卿云先生，硕士研究生，15 年证券、基金行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016 年 7 月加入华安基金，任指数与量化投资部 ETF 业务负责人。2016 年 12 月至 2021 年 3 月，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017 年 6 月至 2018 年 11 月，担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 10 月至 2020 年 6 月，同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理，2017 年 10 月起，同时担任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2017 年 12 月至 2022 年 3 月，同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2018 年 9 月至 2021 年 3 月，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月至 2021 年 3 月，同时担任华安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 1 月起，同时担任华安中证 500 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 3 月至 2021 年 8 月，同时担任华安沪深 300 行业中性低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 5 月至 2020 年 10 月，同时担任华安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月至 2020 年 6 月，同时担任华安中证民企成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 11 月至 2021 年 3 月，同时担任华安中债 7-10 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起，同时担任华安中证银行指数型证券投资基金的基金经

理。2021 年 5 月至 2022 年 7 月，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 9 月起，同时担任华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金、华安中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 10 月起，同时担任华安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月起，同时担任华安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华安中证全指证券公司指数型证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月起，同时担任华安恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 5 月起，同时担任华安上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起，同时担任华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起，同时担任华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

林唐宇先生，理学硕士，FRM（金融风险管理师），7 年相关金融行业从业经验。曾任中国人保资管管理公司债券交易员。2016 年 3 月加入华安基金，历任集中交易部债券交易员，固定收益部基金经理助理。2020 年 1 月起，同时担任华安现金宝货币市场基金、华安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起，同时担任华安中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起，同时担任华安锦源 0-7 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起，同时担任华安锦溶 0-5 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安锦灏金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月起，同时担任华安领荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起，同时担任华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人情况

1、基金托管人情况

（1）基本情况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立时间：1992 年 10 月 19 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人：胡波

联系电话：（021）61618888

（2）主要人员情况

郑杨，男，1966 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务党委委员，资产托管部总经理。

（3）基金托管业务经营情况

截止 2022 年 6 月 30 日，上海浦东发展银行股份有限公司证券投资基金托管规模为 13,000.65 亿元，比去年末增加 1.74%。托管证券投资基金共三百七十只支。

2、基金托管人的内部控制制度

（1）上海浦东发展银行股份有限公司内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和上海浦东发展银行股份有限公司规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

（2）上海浦东发展银行股份有限公司内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

（3）内部控制制度及措施：上海浦东发展银行股份有限公司已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急预案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，

排查风险隐患。

3、基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

（1）监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- 1) 《中华人民共和国证券法》；
- 2) 《中华人民共和国证券投资基金法》；
- 3) 《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
- 4) 《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》；
- 5) 《基金合同》《托管协议》；
- 6) 法律、法规、政策的其他规定。

（2）监督内容

上海浦东发展银行股份有限公司根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

（3）监督方法

1) 资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

2) 在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

3) 对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

（4）监督结果的处理方式

1) 基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托

管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

(三) 验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：楼茜蓉

经办注册会计师：魏佳亮、楼茜蓉

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

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

（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

本基金截至 2022 年 10 月 17 日的资产负债表（未经审计）如下：

华安中债1-5年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金

2022年10月17日资产负债表

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产	本期末 2022 年 10 月 17 日
资产：	
银行存款	2,329,112.99
结算备付金	173,594,261.33
存出保证金	
衍生金融资产	
交易性金融资产	7,816,109,167.12
买入返售金融资产	40,001,479.45
发放贷款和垫款	
债权投资	
其他债权投资	
应收清算款	
应收利息	
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	8,032,034,020.89
负债与净资产	
负债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付清算款	
应付赎回款	

应付管理人报酬	560,522.32
应付托管费	186,840.78
应付销售服务费	
应付投资顾问费	
应付税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	123,529.24
负债合计	870,892.34
净资产：	
实收资金	8,000,187,700.00
其他综合收益	
未分配利润	30,975,428.55
净资产合计	8,031,163,128.55
负债和净资产总计	8,032,034,020.89

注：报告截止日 2022 年 10 月 17 日，本基金份额净值：100.3872 元，本基金份额总额：80,001,877.00 份。

八、基金投资组合

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

截至 2022 年 10 月 17 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

金额单位：人民币元

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	7,816,109,167.12	97.31
	其中：债券	7,816,109,167.12	97.31
	资产支持证券		
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产	40,001,479.45	0.50
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
5	银行存款和结算备付金合计	175,923,374.32	2.19
6	其他各项资产		
7	合计	8,032,034,020.89	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

（三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

注：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（人民币元）	占基金资产净值的比例
1	国家债券		
2	央行票据		
3	金融债券	7,816,109,167.12	97.32
	其中：政策性金融债	7,816,109,167.12	97.32
4	企业债券		
5	企业短期融资券		
6	中期票据		

7	可转债（可交换债）		
8	其他		
9	合计	7,816,109,167.12	97.32

（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 （人民币元）	占基金资产净 值比例（%）
1	220203	22 国开 03	18,200,000	1,859,374,328.77	23.15
2	210202	21 国开 02	10,700,000	1,107,562,569.86	13.79
3	220202	22 国开 02	8,500,000	869,427,739.73	10.83
4	190203	19 国开 03	5,800,000	603,093,534.25	7.51
5	220211	22 国开 11	5,000,000	501,454,520.55	6.24

（六）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国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规及公司投资制度的规定。

2、其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

3、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

九、重大事项揭示

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

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

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（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

- （一）中国证监会准予华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- （二）《华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- （三）《华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- （四）《华安中债 1-5 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- （五）法律意见书；
- （六）基金管理人业务资格批件和营业执照；
- （七）基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人和基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅。

风险提示：基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。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。

华安基金管理有限公司

二零二二年十月十九日

附件：基金合同内容摘要

第一节 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

一、基金份额持有人

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

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

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购款项、应付申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金管理人

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益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、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转托管等方面的业务规则；

（17）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，但向监管机构、司法机关提供或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料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（税后）在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金托管人

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，但向监管机构、司法机关提供或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料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机构处接收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。

第二节 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

一、召开事由

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

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；

- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 增加、减少或调整基金份额类别及定义；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金申购、赎回、转托管、基金交易、非交易过户等业务规则；
- (7) 本基金推出新业务或服务；
- (8) 调整申购赎回清单的内容，调整基金份额净值、申购、赎回清单的计算和公告时间或频率；
- (9) 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、通讯开会或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之

一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在不违反法律法规或监管机构规定的情况下，经会议通知载明，基金份

额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人也可以采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行；或者采用网络、电话等其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决。

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的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。除法律法规、监管机构另有规定或《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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

七、计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

八、生效与公告

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

基金份额持有人大会决议依照《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，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第三节 基金收益分配原则、执行方式

一、基金收益分配原则

（一）基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到0.1%以上，基金管理人可以进行收益分配；基金收益分配数额的确定原则在

招募说明书中列明；

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

（三）本基金收益分配方式为现金分红；

（四）基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

（五）每一基金份额享有同等分配权；

（六）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

四、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

第四节 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

一、基金费用的种类

- (一) 基金管理人的管理费；
- (二) 基金托管人的托管费；
- (三) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (四) 《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；
- (五) 基金份额持有人大会费用；
- (六) 基金的证券交易费用及结算费用；
- (七) 基金的银行汇划费用；
- (八) 基金的上市费及年费；
- (九) 基金的开户费用、账户维护费用；
- (十) 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

(一) 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

基金管理费每日计提，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，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(二) 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

基金托管费每日计提，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，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中除基金管理费、基金托管费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- （一）标的指数许可使用费。本基金标的指数许可使用费由基金管理人支付。
- （二）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；
- （三）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；
- （四）《基金合同》生效前的相关费用；
- （五）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，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。

第五节 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及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的政策性金融债、国债、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监

会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

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：本基金投资于待偿期为1年至5年（含1年和5年）的标的指数成份券及备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于本基金非现金基金资产的80%。

当法律法规或监管机构的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

二、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于待偿期为1年至5年（含1年和5年）的标的指数成份券及备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于本基金非现金基金资产的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%；

（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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（4）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，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；

（5）本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

（6）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；

（7）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；

（8）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）、（7）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券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。法律法规或监管部门另有规定的，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。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，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）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。

3、关联交易

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。

法律法规或监管部门取消或调整上述规定，如适用于本基金，则本基金投资

不再受相关限制或以变更后的规定为准。

第六节 基金资产净值的计算方法和公告方式

一、计算方法

1、基金份额净值是按照每个估值日基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

二、公告方式

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

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

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

第七节 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

一、《基金合同》的变更

（一）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。

（二）关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议需报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，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：

（一）基金份额持有人大会决定终止的；

（二）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；

（三）《基金合同》约定的其他情形；

（四）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

（一）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，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。

（二）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。

（三）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。

（四）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。

（五）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。

第八节 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商解决。如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自职责，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法律）管辖。

第九节 基金合同存放地和投资人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。