华泰柏瑞基金管理有限公司

华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

更新的招募说明书

2026 年第 1 号

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇二六年十月

华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书

重要提示

华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）根据2023年9月19日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》（证监许可[2023]2214号）进行募集。本基金的基金合同于2023年11月15日正式生效。

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，**但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。**

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，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、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金标的ETF为股票指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的ETF，紧密跟踪指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金的标的ETF指由南方东英资产管理有限公司管理的，并于新加坡交易所上市的南方东英新交所泛东南亚科技ETF。本基金对标的ETF的投资比例不低于本基金资产净值的90%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。

投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、标的ETF/标的指数变更的风险、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、退市风险、投资者申购和赎回失败的风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、流动性风险、股指期货的投资风险、股票期的权投资风险、国债期货的投资风险、存托凭证的投资风险、资产支持证券的投资风险、港股通标的股票的投资风险、参与境内融资及转融通业务的风险、本基金特有的风险、

会计核算风险、运作风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、不可抗力等等。本基金为主要投资于新加坡证券市场上市的 ETF 的产品，需要承担海外市场风险、政府管制风险、监管风险、政治风险、汇率风险、利率风险、投资于标的 ETF 的风险、衍生品风险、信用风险、法律及税务风险、交易结算风险、证券借贷/正回购/逆回购风险、引入境外托管人的风险等本基金特别的风险。具体详见本招募说明书的“基金的风险揭示”章节。

本基金如参与内地与香港股票市场交易互联互通机制下港股通相关业务，基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，具体详见本招募说明书的“基金的风险揭示”章节。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

本基金可投资资产支持证券。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险、提前偿付风险等风险。

本基金可投资于股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品。投资股指期货的风险包括但不限于市场风险、流动性风险、杠杆风险、保证金风险、信用风险、操作风险等。国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险。在参与股票期权交易时，应当关注股票现货市场的价格波动、股票期权的价格波动和其他市场风险以及可能造成的损失。

本基金可参与境内融资及转融通证券出借业务。融资及转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。其中，转融通证券出借业务的流动性风险是指基金面临大额赎回时可能因证券出借原因无法及时变现支付赎回对价的风险；信用风险是指证券出借对手方无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；市场风险是指证券出借期间无法正常处置该证券的风险。

在本基金存续期间，基金管理人不承担基金销售、基金投资等运作环节中的任何汇率变动风险。

投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

本基金标的指数为新交所泛东南亚科技指数，由新加坡交易所编制并发布，新交所泛东南亚科技指数旨在追踪东南亚和新兴亚洲市场前 30 大科技公司的表现。本基金标的指数涵盖

主要从事技术相关行业的公司，如信息技术、软件和咨询、汽车制造、电元件和制造、零售和媒体服务等。该指数由 30 只股票组成，采用自由流通市值加权，每只成分股权重上限为10%。成分股的注册地为东南亚和新兴亚洲市场，包括印度、新加坡、印度尼西亚、泰国、越南和马来西亚。此外，印度公司必须在美国交易所上市才具备纳入资格。泰国上市公司可通过其无投票权存托凭证（NVDR）获得纳入资格。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见新加坡交易所官网，网址：https://www.sgx.com/zh-hans/indices。

新交所泛东南亚科技指数是根据新加坡交易所的许可使用的商标。新交所泛东南亚科技指数中的所有版权和数据库权利仅属于新加坡交易所并根据许可在此使用。华泰柏瑞基金管理有限公司对华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同负全部责任。新加坡交易所对该等华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同的购买或销售不持任何立场，且不承担与此相关的任何责任。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2026 年 10 月 12 日，有关财务和业绩表现数据截止日为 2026 年 06 月 30 日，财务和业绩表现数据未经审计。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书进行了复核确认。

目 录

一、绪言..... 6
二、释义..... 6
三、基金管理人..... 11
四、基金托管人..... 20
五、境外托管人..... 23
六、相关服务机构..... 25
七、基金的募集..... 26
八、基金合同的生效..... 30
九、基金份额折算与变更登记..... 31
十、基金份额的上市交易..... 32
十一、基金份额的申购与赎回..... 34
十二、基金的投资..... 45
十三、基金的业绩..... 55
十四、基金的财产..... 57
十五、基金资产的估值..... 58
十六、基金的收益与分配..... 64
十七、基金的费用与税收..... 65
十八、基金的会计与审计..... 67
十九、基金的信息披露..... 68
二十、基金的风险揭示..... 75
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... 84
二十二、基金合同的内容摘要..... 87
二十三、基金托管协议的内容摘要..... 99
二十四、对基金份额持有人的服务..... 110
二十五、其他应披露事项..... 111
二十六、招募说明书存放及查阅方式..... 113
二十七、备查文件..... 114

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号<招募说明书的内容与格式>》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称《通知》）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称《指数基金指引》）等有关法律法规以及《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》（以下简称基金合同或《基金合同》）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。**基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。**基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

2、基金管理人：指华泰柏瑞基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国银行股份有限公司

4、境外托管人：指符合法律法规规定的条件，根据基金托管人与其签订的合同，为本基金提供境外资产托管服务的境外金融机构

5、基金合同、《基金合同》：指《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

7、招募说明书或本招募说明书：指《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》及其更新

8、基金产品资料概要：指《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要》及其更新

9、基金份额发售公告：指《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金份额发售公告》

10、上市交易公告书：指《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易公告书》

11、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

12、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

16、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

17、《指数基金指引》：指中国证监会2021年1月18日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

18、《试行办法》：指中国证监会2007年6月18日颁布、同年7月5日实施的《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及颁布机关对其不时做出的修订

19、《通知》：指中国证监会2007年6月18日颁布、同年7月5日实施的《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》及颁布机关对其不时做出的修订

20、交易型开放式指数证券投资基金：指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”，简称“ETF”

21、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金

22、标的ETF：指南方东英资产管理有限公司管理的，并于新加坡交易所上市的南方东英新交所泛东南亚科技交易所买卖基金（ETF），以下简称“南方东英新交所泛东南亚科技 ETF”（CSOP iEdge Southeast Asia+ TECH Index ETF）

23、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

24、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

25、外管局：指国家外汇管理局或其分支机构

26、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

27、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

28、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

29、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

30、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

31、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

32、基金销售业务：指基金管理人或销售机构为投资人开立基金交易账户，宣传推介基金，办理基金份额发售、申购、赎回及提供基金交易账户信息查询等活动

33、销售机构：指华泰柏瑞基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

34、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

35、申购赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司

36、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务及基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

37、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司或接受华泰柏瑞基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

38、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

39、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

40、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

41、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

42、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

43、工作日：指上海证券交易所的正常交易日

44、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

45、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

46、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日。本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所和本基金投资的主要境外市场同时正常开放交易的工作日，但基金管理人公告暂停申购或赎回时除外。本基金投资的主要境外市场详见招募说明书

47、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

48、《业务规则》：指上海证券交易所、登记机构、基金管理人及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订

49、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

50、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

51、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为对价资产的行为

52、申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

53、组合证券：指标的 ETF 及/或标的指数所包含的全部或部分证券

54、申购对价：指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额及其他对价

55、赎回对价：指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的现金替代、现金差额及其他对价

56、标的指数：指新交所泛东南亚科技指数及其未来可能发生的变更

57、现金替代：指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金

58、现金差额：指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日标的 ETF 份额净值及/或按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

59、预估现金差额：指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结

60、基金份额参考净值：指基金管理人或者基金管理人委托的指数服务机构根据申购赎回清单、人民币汇率和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并由上海证券交易所在交易时间内发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

61、最小申购、赎回单位：指申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

62、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值的行为

63、基金的转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

64、元：指人民币元

65、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、投资标的 ETF 份额所得收益、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

66、收益评价日：指基金管理人计算基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率差额之日

67、基金累计报酬率：指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 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算）

68、标的指数同期累计报酬率：指收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 100%（使用估值汇率折算）（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）

69、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、标的 ETF 基金份额、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

70、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

71、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

72、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

73、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电

子披露网站）等媒介

74、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

75、货币市场工具：指现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款，债券回购，中央银行票据，同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券，非金融企业债务融资工具，资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具

76、内地与香港股票市场交易互联互通机制：是指内地证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称香港联合交易所）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票

77、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，通过内地与香港股票市场交易互联互通机制买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

78、基金参与转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

79、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币贰亿元

存续期间：持续经营

联系人：汪莹白

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

股权结构：Heron View Partners LLC 49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

贾波先生：董事长，学士，曾任职于工商银行江苏省分行，2001 年 7 月至 2016 年 11 月在华泰证券工作，历任经纪业务总部技术主办、零售客户服务总部地区经理、南宁双拥路营业部总经理、南京长江路营业部总经理、企划部副总经理(主持工作)、北京分公司总经理、融资融券部总经理等职务。2016 年 12 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，任公司董事长，兼任华泰盈科资产管理有限公司董事会主席。

刘晓冰先生：董事。1993 年 12 月进入华泰证券股份有限公司，曾任无锡解放西路营业部总经理助理、副总经理、总经理，无锡永乐路营业部负责人，无锡城市中心营业部总经理，无锡分公司总经理，苏州分公司总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司上海分公司总经理。

谢仕荣先生：董事，学士、荣誉博士。1961 年加入美国友邦保险有限公司，曾任美国国际集团 (AIG Inc.) 执行副总裁、董事、副主席、高级副主席、高级副主席兼营运总监；美国友邦保险有限公司总裁兼首席执行官、主席兼首席执行官、名誉主席；友邦保险控股有限公司非执行董事、非执行主席、独立非执行主席及独立非执行董事，2025 年 10 月被授予友邦保险控股有限公司荣誉主席。

杨智雅女士：董事，硕士，曾就职于升强工业股份有限公司、华之杰国际商业顾问有限公司、AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司、AIG 友邦证券投资信托股份有限公司、AIG 友邦证券投资顾问股份有限公司、柏瑞证券投资顾问股份有限公司。

崔春女士：董事，清华大学五道口金融学院货币银行学硕士。曾任中国光大国际信托投

资公司证券部经理；光大证券有限公司总裁办高级经理；中国建设银行总行计划财务部副处长、金融机构部副处长；嘉实基金管理有限公司固定收益部总监；中国国际金融股份有限公司资产管理部副总经理、执行总经理、董事总经理，兼任中金香港资产管理有限公司董事；华泰证券（上海）资产管理有限公司总经理、董事长。2025 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司总经理，兼任华泰盈科资产管理有限公司董事。

吴冠雄先生：独立董事，硕士，1999 年加入天元律师事务所，历任事务所专职律师、权益合伙人、管理合伙人、事务所执行主任和管理委员会成员。

田中荣治先生：独立董事，硕士，曾任职于野村证券株式会社、瑞穗证券亚洲有限公司、野村国际（香港）有限公司、野村资产管理香港有限公司。2022 年 9 月至今任中国国际金融日本株式会社代表取缔役社长。

刘俊彦先生：独立董事，博士，1993 年 3 月至今任教于中国人民大学商学院，现任财务与金融系副主任，副教授。

尹雷先生：独立董事，硕士，曾任深圳证券交易所经理、麦顿投资副总裁、凯鹏华盈基金执行董事、阿里巴巴集团投资总监、阿里巴巴影业集团副总裁、海南阿里影业文化产业基金总裁，2019 年至今任厦门云尚汇影影视文化有限公司董事长。

2、监事会成员

徐珊女士：监事，硕士。2009 年 11 月进入华泰证券股份有限公司，曾任研究所研究员，证券投资部风控运营岗，上海黄河路营业部副总经理，上海乳山路营业部负责人、总经理，上海国宾路营业部总经理，上海武定路营业部总经理，上海分公司副总经理兼武定路营业部总经理，金融产品部负责人、总经理等职务。现任华泰证券股份有限公司南京分公司总经理。

陈健先生：监事、硕士。曾任职于怡和集团（香港）、奇胜（香港）、霍尼韦尔（澳大利亚）、波士顿咨询（香港）、电讯盈科（香港）、RAB Capital/RAB-Pi Asia Fund（香港）、Intygral Capital Partners（香港）、Sofaer Capital（香港），现任盈科拓展集团（香港）高级副总裁及 Heron View Partners LLC（香港）的法定代表人。

刘声先生：监事，硕士。2011 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任风险管理部副总监。

杨宇先生：监事，硕士。2016 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任人力资源部总监助理。

3、总经理及其他高级管理人员

崔春女士：总经理，清华大学五道口金融学院货币银行学硕士。曾任中国光大国际信托投资公司证券部经理；光大证券有限公司总裁办高级经理；中国建设银行总行计划财务部副处长、金融机构部副处长；嘉实基金管理有限公司固定收益部总监；中国国际金融股份有限公司资产管理部副总经理、执行总经理、董事总经理，兼任中金香港资产管理有限公司董事；华泰证券（上海）资产管理有限公司总经理、董事长。2025 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司总经理，兼任华泰盈科资产管理有限公司董事。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000 年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经

理，2001-2004 年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士,1997-2001 年任上海证券交易所登记结算公司交收系统开发经理，2001-2004 年任华安基金管理有限公司基金登记及结算部门总监，2004-2008 年 5 月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

康珂女士：督察长，硕士研究生，曾任职于富友证券经纪有限公司稽核部、第一证券稽核审计部、德邦证券股份有限公司风险管理部。2006 年 5 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任合规法律部高级经理、副总监、总监。2024 年 5 月至 2026 年 8 月任公司总经理助理兼合规法律部总监。现任公司督察长。

满黎先生：副总经理，硕士。曾任华安基金管理有限公司北京分公司高级董事总经理，国联安基金管理有限公司副总经理，金鹰基金管理有限公司副总裁，万家基金管理有限公司副总经理。2021 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任副总经理。

童辉先生：首席信息官，硕士。1997-1998 年任上海众恒信息产业有限公司程序员，1998-2004 年任国泰基金管理有限公司信息技术部经理，2004 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司首席信息官。

裴晓思先生：副总经理，复旦大学硕士。曾任泰和诚医疗集团行业研究员，中国出口信用保险公司投资经理，永诚财产保险有限公司投资经理，易方达基金管理有限公司非银客户部总经理助理（主持工作），2021 年 4 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司副总经理。

周俊梁先生：财务总监，硕士。曾任普华永道中天会计师事务所审计经理、渣打银行（中国）有限公司财务部高级经理、大华银行（中国）有限公司财务部第一副总裁，2015 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任公司财务总监。

柳军先生：副总经理，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、指数投资部总监、总经理助理兼指数投资部总监，现任公司副总经理，兼任华泰盈科资产管理有限公司证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月至 2025 年 1 月任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 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 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通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 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型

开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月至 2023 年 12 月任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 10 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起任华泰柏瑞中证 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

王文慧女士：副总经理，经济学硕士。2005 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任第一营销中心总监、第二营销中心总监、机构理财部总监、机构业务一部总监、华中营销中心总监、券商业务部总监、总经理助理兼券商业务部总监，现任公司副总经理。

董辰先生：副总经理，硕士。曾任长江证券首席分析师，2016 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理助理、基金经理、投资二部副总监、投资二部总监、总经理助理，现任公司副总经理兼主动权益投资部总监。2020 年 7 月起任华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 12 月起任华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月至 2022 年 10 月任华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月至 2023 年 6 月任华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月至 2023 年 7 月任华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月起任华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起任华泰柏瑞集利债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 4 月起任华泰柏瑞启臻混合型证券投资基金的基金经理。

4、本基金基金经理

李沐阳先生：美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中

证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 4 月任华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月至 2025 年 2 月任华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月至 2025 年 6 月任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023年3月起任华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2023 年 4 月至 2025 年 10 月任华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 9 月起任华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体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。2023 年 10 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 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。2023 年 11 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 1 月起任华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚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。2024 年 7 月起任华泰柏瑞南方东英沙特阿拉伯交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 10 月起任华泰柏瑞中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 10 月至 2025 年 11 月任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理。2024 年 12 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 2 月起任华泰柏瑞上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 4 月起任华泰柏瑞中证油气产业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。2025年5月至2026年5月任华泰柏瑞恒生消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 5 月起任华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 8 月起任华泰柏瑞上证科创板半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

5、权益投资决策委员会成员

主席：总经理崔春女士；

成员：副总经理柳军先生；副总经理董辰先生；总经理助理莫倩女士；总经理助理盛豪先生；总经理助理赵新杰先生；主动权益投资部联席总监杨景涵先生；专户投资部副总监林浩祥先生；资产配置部副总监郭瀚穹先生。

列席人员： 督察长或风险管理部总监可列席投资决策委员会会议。总经理可以提名其他人员列席投资决策委员会会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、转换和登记事宜；

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、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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财产分别管理、分别记账，进行基金、证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、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；按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回对价；采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购和赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、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；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

11、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者实施其他法律行为；

12、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；

13、中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

（7）违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（8）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（9）贬损同行，以抬高自己；

（10）以不正当手段谋求业务发展；

（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制必须覆盖公司各个部门和各级岗位，并渗透到各项业务过程，涵盖决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司在精简的基础上设立能够充分满足经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立。内部控制的检查评价部门必须独立于内部控制的建立和执行部门；

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应权责分明、相互制衡，消除内部控制中的盲点；

（5）防火墙原则。公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离，基金投资研究、决策、执行、清算、评估等部门和岗位，应当在物理上和制度上适当隔离，以达到风险防范的目的；

（6）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的主要内容

（1）控制环境

董事会下设风险管理与审计委员会，全面负责公司的风险管理、风险控制和财务监控，审查公司的内控制度，并对重大关联交易进行审计；董事会下设薪酬、考核与资格审查委员会，对董事、总经理、督察长、财务总监和其他高级管理人员的候选人进行资格审查以确保其具有中国证监会所要求的任职资格，制定董事、监事、总经理、督察长、财务总监、其他高级管理人员及基金经理的薪酬/报酬计划或方案。

公司管理层在总经理领导下，认真执行董事会确定的内部控制战略，为了有效贯彻公司董事会制定的经营方针及发展战略，设立了投资决策委员会和风险控制委员会，就基金投资和风险控制等发表专业意见及建议。

公司设立督察长，对董事会负责，主要负责对公司内部控制的合法合规性、有效性和合理性进行审查，发现重大风险事件时向公司董事长和中国证监会报告。

（2）风险评估

公司风险控制人员定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高层管理人员。

（3）控制活动

控制活动包括自我控制、职责分离、监察稽核、实物控制、业绩评价、严格授权、资产分离、危机处理等政策、程序或措施。

自我控制以各岗位的目标责任制为基础，是内部控制的第一道防线。在公司内部建立科学、严格的岗位分离制度，在相关部门和相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督责任，使相互监督制衡的机制成为内部控制的第二道防线。充分发挥督察长和法律监察部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面监察稽核作用，建立内部控制的第三道防线。

（4）信息与沟通

公司建立了内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，形成了自上而下的信息传播渠道和自下而上的信息呈报渠道。通过建立有效的信息交流渠道，保证了公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，并及时送达适当的人员进行处理。

（5）内部监控

内部监控由公司风险管理与审计委员会、督察长、风险控制委员会和法律监察部等部门在各自的职权范围内开展。本公司设立了独立于各业务部门的法律监察部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。

3、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

（2）本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；

（3）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年，现有员工 110 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2026 年 3 月 31 日，中国银行已托管 1219 只证券投资基金，其中境内基金 1150 只，QDII 基金 69 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 “SAS70”、“AAF01/06” “ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保

证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

五、境外托管人

（一）境外托管人基本情况

名称：花旗银行（Citibank N.A.）（简称“花旗银行”）

注册地址：701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA 成立时间：1812 年 6 月 16 日

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

所有者权益（Common Shareholder’s Equity）：2,090 亿美元*

实收资本（Paid-in Capital）：1084 亿美元*

托管资产规模：26.2 万亿美元#

*以上数据截止到 2023 年 1 季度

#以上数据截止到 2022 年 4 季度

花旗集团是一家在纽约证交所上市的公司，是国际大型的金融服务集团，业务范围广泛的国际银行。花旗集团的前身为纽约市银行 (City Bank of New York)，成立于 1812 年。其业务为个人、企业、政府和机构提供广泛而专注的金融产品和服务，包括零售银行和信贷、企业和投资 银行、证券经纪、贸易和证券服务和财富管理。花旗拥有约 2 亿客户，业务遍及 160 多个国家和地区。

花旗银行是花旗集团的全资子公司,其经营活动由美国联邦储备银行（FEB）和美国联邦储蓄保险公司（FDIC）监管。花旗银行经过两个世纪的发展、收购，已经成为美国以资产计第三大银行，也是一间在全球近 160 多个国家及地区设有分支机构的国际级银行。

花旗银行资本金雄厚，信用评级稳健。花旗银行拥有全球广泛自有专属托管网络，其托管资产规模在全球行业排名前列。截至 2022 年四季度末，花旗银行的证券服务拥有 26.2 万亿美元的托 管资产，是一家全球领先的托管机构。

（二）主要人员情况

花旗职员都是经验丰富的证券专业人士，多数有大学文凭或同等经验，并受益于花旗持续提供的员工培训，涵盖产品、流程和证券业趋势，以及管理问题和流程。许多人还有其他资格证书，比如硕士学位、CPA、C.C.M.认证及其他行业认证。

平均而言，花旗的全球托管管理人员从业超过 20 年，员工从业达 10 年。

1、人员配置

截至 2022 年底，花旗在全球共有 24 万员工。花旗在全球共有 7,466 名员工为托管和基金服务提供支持，其 中 3,326 名员工位于亚太地区。

2、工作年限

花旗的业务管理人员均长期任职于花旗和证券业，坚持履行对托管业务的承诺，并且一直是推进花旗客户关系的重要组成部分。

花旗全球托管管理团队平均工作年限为 15 年，全球托管员工平均工作年限为 12 年。

亚太地区客户的业务支持是依托于花旗银行在香港的运营机构，花旗香港从 80 年代中期开始提供全方位的全球托管服务。花旗香港全球托管中心已有 30 多年的全球托管操作经验，无论在人力专才，托管操作系统发展，客户服务及处理问题的熟练深度和专业程度都处于行业前列，从而保障了高效率、高质量的服务。

花旗拥有健全的公司治理制度，内部控制和风险管理制度，并得到有效地贯彻执行。多年来经营管理有序，未发生过财务状况恶化等重大经营风险情形。

花旗银行具备安全保管资产的条件以及安全、高效的清算、交割能力。在最近 3 年内没有受到过所在国家或地区监管机构的重大处罚，无重大事项正在接受司法部门、监管机构立案调查。

（三）基金托管业务经营情况

花旗银行是值得信赖的托管银行，截至 2022 年四季度末，托管资产规模达到 26.2 万亿美元。作为全球最大的托管服务提供商之一，花旗为全球投资者提供金融资源、国际拓展、运营基础设施和专业知识。

花旗以统一方式提供交易结算、保管、资产服务、管理和投资报告。凭借自营网络、全球运营和客户服务，以及先进的处理技术，花旗在市场上脱颖而出，能够提供量身定制的服务，满足企业、金融机构、国际政府组织、银行、经纪自营商、投资管理人、全球托管人、共同基金、养老基金和保险公司的需求。

1、业务历史

花旗的托管业务可以追溯到 1929 年，当时花旗与农民信托公司合并。自 1980 年以来，花旗一直提供全球托管服务。从 1980 年到 1984 年，花旗建立起托管网络，由分行、子公司和代理行组成，继续打造高度本地化服务。此外，花旗还形成全球最大的专用通信网络之一，供其自营分行之间传送托管相关数据。

2、亚洲业务历史 / 经验

自 1980 年以来，花旗一直在亚洲主要市场提供全球托管服务。从 1980 年到 1984 年，花旗建立起托管网络，由分行、子公司和代理行组成，继续打造高度本地化服务。此外，花旗还形成全球最大的专用通信网络之一，供其自营分行之间传送托管相关数据。

3、网络

其他机构的自营分支网络在深度、广度和覆盖面上无一能及花旗。迄今，花旗的全球托管网络覆盖 104 个市场，其中 63 个是花旗自营终端。花旗在全球 160 多个国家和司法管辖区开展业务。花旗的客户可以更快速、准确、直接地获取服务信息和本地市场情报。花旗深谙经营所在管辖区市场，且具有很大影响力，能够确保为客户提供更高水平的服务。凭借该等规模、实地运营和专业知识，连同在其中许多国家超过百年的服务经验，使得花旗作为全球托管人具备无与伦比之能力。

（四）信用等级（2022 年 12 月）

花旗集团在标普评级（高级）为 BBB+，短期为 A-2。花旗银行（高级）为 A+，短期为 A-1。

	Moody’s	Standard & Poor’s	Fitch
花旗集团(高级)	A3	BBB+	A
花旗集团（短期）	P-2	A-2	F1
花旗银行(高级)	Aa3	A+	A+
花旗银行（短期）	P-1	A-1	F1

（五）境外托管人的职责

1、安全保管受托财产；

2、计算境外受托资产的资产净值；

3、按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；

4、按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；

5、按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；

6、保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；

7、其他由基金托管人委托其履行的职责。

六、相关服务机构

（一）一级交易商

1、场内申购、赎回代办证券公司

本基金场内申购、赎回代办证券公司信息详见基金管理人网站公示。

2、二级市场交易代办证券公司

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。

3、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时在基金管理人网站公示。

（二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

联系人：陈文祥

电话：021-68419095

传真：021-68870311

（三）律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：刘佳、吴卫英

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

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

执行事务合伙人：毛鞍宁

经办注册会计师：许培菁、张亚旎

联系人：许培菁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经 2023 年 9 月 19 日中国证监会《关于准予华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复》（证监许可[2023]2214 号）注册募集。

（一）基金类型和运作方式

基金类型：股票型指数证券投资基金、QDII 基金

运作方式：交易型开放式

（二）基金存续期

不定期

（三）募集方式和销售场所

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购 2 种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购。

投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况增减或变更发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

（四）募集期限

本基金具体发售时间在基金份额发售公告中披露。根据《运作办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金合同生效的法定条件、或基金管理人根据市场情况需要延长基金份额发售的时间，本基金可继续销售，但募集期自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月。同时也可根据认购和市场情况提前结束发售，并及时公告。

（五）募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

（六）基金的最低募集份额总额及金额

本基金的募集份额总数应不少于 2 亿份，基金募集金额总额应不少于 2 亿元人民币。

本基金可依据中国证监会和外管局核准的额度（外汇额度需折算为人民币）或本基金的实际情况设定募集规模上限，并在招募说明书或相关公告中列示。基金合同生效后，基金的

资产规模不受募集规模上限限制，但基金管理人有权根据基金的外汇额度（外汇额度需折算为人民币）或本基金的实际情况控制基金申购规模并暂停基金的申购，具体参见基金管理人届时发布的公告。

（七）基金的面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，以初始面值发售。

基金管理人可以在不违反法律法规且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，增加新的销售币种、调整现有募集币种设置、停止现有币种的募集等，该事项无需召开基金份额持有人大会，相关业务规则届时由基金管理人确定并提前公告。

（八）投资人对基金份额的认购

1、认购时间安排

本基金的募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。详见本基金基金份额发售公告。

2、认购开户

投资者认购本基金时需具有证券账户，证券账户是指上海证券交易所 A 股账户或基金账户。

（1）如投资者需新开立证券账户，则应注意：

①基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易；如投资者需要参与基金的申购、赎回，则应开立 A 股账户。

②开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

（2）如投资者已开立证券账户，则应注意：

①如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

②当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购的 1 个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

3、认购费用

认购费用由投资者承担，认购费率如下表所示：

认购份额 M（份）	认购费率
M ＜ 100 万	0.50%
100 万≤ M ＜ 300 万	0.30%
300 万≤ M ＜ 500 万	0.10%
M ≥ 500 万	1000 元/次

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构，按照不高于 0.50%的标准收取一定的佣金。

认购费将用于支付募集期间会计师费、律师费、登记结算费、销售费及市场推广等支出，不计入基金资产。

4、网上现金认购

（1）认购时间：详见基金份额发售公告。

（2）通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金＝认购份额×佣金比率

（若适用固定费用的，认购佣金＝固定费用）

认购金额＝认购份额×（1＋佣金比率）

（若适用固定费用的，认购金额＝认购价格×认购份额＋固定费用）

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

（3）认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍。投资人在认购时间内可以多次认购，累计认购份额不设上限，但法律法规、监管要求以及本基金发售规模控制方案另有规定的除外。

（4）认购申请：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。

（5）清算交收：T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

（6）认购确认：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

5、网下现金认购

（1）认购时间：详见本基金基金份额发售公告。

（2）认购金额和利息折算的份额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用＝认购份额×认购费率

（若适用固定费用的，认购费用＝固定费用）

认购金额＝认购份额×（1＋认购费率）

（若适用固定费用的，认购金额＝认购价格×认购份额+固定费用）

净认购份额＝认购份额＋认购金额产生的利息/基金份额面值

其中：

认购费用由基金管理人在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

（3）认购限额：网下现金认购以基金份额申请。

投资者以上海证券账户通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍，投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限，但法律法规、监管要求以及本基金发售规模控制方案另有规定的除外。

（4）认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

（5）清算交收：

通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

（6）认购确认：在基金合同生效后，投资者应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（九）募集期认购资金及利息的处理方式

基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

（十）标的 ETF、标的指数

本基金的标的指数为新交所泛东南亚科技指数。

本基金的标的 ETF 指由南方东英资产管理有限公司管理的，并于新加坡交易所上市的南方东英新交所泛东南亚科技 ETF。如果未来标的 ETF 的标的指数发生变更，本基金不变更标的 ETF，且本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数，不需另行召开基金份额持有人大会。

（十一）设立联接基金或增设新的份额类别

在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，设立并管理以本基金为目标 ETF 的联接基金，或为本基金增设新的份额类别，新的份额类别可设置不同的管理费、托管费、申购费、赎回费、币种及汇率风险特征等，而无需召开基金份额持有人大会审议。有关基金份额类别的具体规则等相关事项届时将另行公告。

（十二）募集结果

本基金募集工作已于 2023 年 11 月 10 日顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 258,355,000.00 元人民币，折合基金份额 258,355,000.00 份，无认购资金利息折合基金份额。本次募集资金已于 2023 年 11 月 15 日划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 4,163 户，按照每份基金份额发售面值 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 258,355,000.00 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。按照有关法律规定，本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，不从基金财产中列支。

根据《基金法》、《运作办法》和《基金合同》、《招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2023 年 11 月 15 日获确认，基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

八、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

九、基金份额折算与变更登记

基金份额折算是指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值。基金份额折算由基金管理人向登记机构申请办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。

本基金存续期间，基金管理人可根据实际需要对基金份额进行折算，并根据相关法规规定进行信息披露。

如未来本基金增加基金份额的类别，基金管理人在实施份额折算时，可对全部份额类别进行折算，也可根据需要只对其中部分类别的份额进行折算。基金管理人将采取措施确保各类别基金份额的平等权利，具体处理措施以届时公告为准。

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。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响（除因尾数处理而产生的损益外），无需召开基金份额持有人大会审议。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

十、基金份额的上市交易

（一）基金份额上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市：

1、场内基金资产净值不低于 2 亿元；

2、场内基金份额持有人不少于 1,000 人；

3、上海证券交易所规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金份额上市交易公告书及其提示性公告。

（二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

（三）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

1、不再具备本部分第一款规定的上市条件；

2、基金合同终止；

3、基金份额持有人大会决定提前终止上市；

4、基金合同约定的终止上市的其他情形；

5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起依照《信息披露办法》的规定发布基金终止上市公告。

若因上述 1、3、4、5 项等原因使本基金终止上市的，本基金将由交易型开放式指数基金变更为跟踪标的指数的非上市开放式指数基金，无需召开基金份额持有人大会审议。若届时，基金管理人已有跟踪该标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护投资人合法权益的原则，履行适当的程序后与该指数基金合并或者选取其他合适的指数作为标的指数。

（四）基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购、赎回清单，基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单、人民币汇率和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为：

基金份额参考净值＝（申购赎回清单中必须现金替代的替代金额+申购赎回清单中可以现金替代的标的 ETF 的数量、最新成交价及汇率公允价的乘积之和+申购赎回清单中的预估现

金部分）/最小申购赎回单位对应的基金份额。

汇率公允价包括中证指数有限公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格等。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 4 位。若上海证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将相应调整。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

（五）在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，在履行适当程序后，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

（六）相关法律法规、中国证监会、登记机构及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

（七）若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能，而无需召开基金份额持有人大会审议。

十一、基金份额的申购与赎回

投资人在场内可以人民币现金申购、赎回办理本基金的申购、赎回业务。如无特指，本部分内容适用于场内人民币的现金申购、赎回业务。

未来在条件允许的情况下，基金管理人可以在场内开通本基金人民币现金申购、赎回以外的方式办理本基金的申购、赎回业务，非人民币现金申购赎回的业务规则、申购赎回原则等相关事项届时将另行约定并公告。

未来在条件允许的情况下，基金管理人可以开通本基金的场外申购、赎回等业务，场外申购赎回的适用条件、业务办理时间、业务规则、申购赎回原则、申购赎回费用等相关事项届时将另行约定并公告。

（一）申购与赎回的场所

投资者应当在申购赎回代理券商的营业场所按申购赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。

基金管理人将在开始申购、赎回业务前在基金管理人网站公示申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所和本基金投资的主要境外市场同时正常开放交易的工作日，具体办理时间为上海证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

本基金投资的主要境外市场为新加坡和标的 ETF 投资的主要境外市场，标的 ETF 投资的主要境外市场具体见基金管理人相关公告。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回。

（三）申购与赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请；

2、本基金的申购对价、赎回对价包括现金替代、现金差额及其他对价；在条件成熟的情况下，如交易所推出新的申购赎回模式时，基金的申购对价、赎回对价也可包括组合证券；

3、申购、赎回申请提交后不得撤销；

4、申购赎回应遵守《业务规则》的规定；

5、本基金申购、赎回的币种为人民币；基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，增加其他币种的申购、赎回，其他币种申购、赎回的具体规则届时将另行公告；

6、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

申购赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购赎回代理券商确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购业务采用实时逐笔全额结算（Real Time Gross Settlement，以下简称 RTGS）模式；赎回业务涉及的现金替代可采用代收代付处理；申购、赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款可采用代收代付处理。

（1）申购的清算交收

投资者 T 日现金申购后，如交易记录已勾单且申购资金足额的，登记结算机构在 T 日日间实时办理基金份额及现金替代的交收；T 日日间未进行勾单确认或日间资金不足的，登记结算机构在 T 日日终根据资金是否足额办理基金份额及现金替代的清算交收，并将结果发送给基金管理人、申购赎回代理券商和基金托管人。基金管理人通过登记结算机构在 T+2 日办理现金差额的清算，在 T+3 日办理现金差额的交收。

（2）赎回的清算交收

投资者 T 日赎回申请受理后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的清算交收。基金管理人通过登记结算机构在 T+2 日办理现金差额的清算，在 T+3 日办理现金差额的交收。

正常情况下，赎回替代款项的清算交收于 T+7 日（指开放日）内办理。但如果出现基金

投资市场交易清算规则发生较大变化、基金赎回数额较大或组合证券内的部分证券因停牌、流动性不足等原因导致无法足额卖出，则赎回款项的清算交收可延迟办理。

对于因申购赎回代理券商交收资金不足，导致投资者现金申购失败的情形，按照申购赎回代理券商的相关规则处理。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《业务规则》及参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

投资者应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额、现金替代和现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资人追偿并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

如遇国家外管局相关规定有变更或本基金投资的境外主要市场的交易清算规则有变更、基金投资的境外主要市场及外汇市场休市或暂停交易、登记公司系统故障、交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回现金替代款的支付时间可相应顺延。在发生基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形时，赎回现金替代款的支付办法参照基金合同有关条款处理。

登记机构和基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，对申购和赎回的程序进行调整，并于开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

（五）申购和赎回的数额限制

1、投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。本基金的最小申购、赎回单位请参考届时发布的申购、赎回相关公告以及申购、赎回清单。基金管理人可根据市场情况、市场变化以及投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整申购、赎回的数量或比例限制，并于调整前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购份额上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

3、基金管理人可以根据市场情况（包括但不限于标的 ETF 短期内流动性明显下降等情形）、市场变化以及投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（六）申购和赎回的对价、费用及其用途

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2、T 日（T 日为开放日）的基金份额净值在 T+1 日内计算，并在 T+2 日内公告。如遇特

殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告；未来，若市场情况发生变化，或实际情况需要，经中国证监会允许，本基金可相应调整基金净值计算和公告时间或频率并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

3、申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。

4、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

5、若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，对基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间进行调整并提前公告。

6、本基金申购、赎回的币种为人民币。在未来市场和技术成熟时，本基金可开通或终止人民币以外的其他币种的申购、赎回，该事项无须基金份额持有人大会通过。如本基金开通或终止人民币以外的其他币种的申购、赎回，更新的申赎原则、程序、费用等业务规则及相关事项届时由基金管理人确定并提前公告。

（七）申购赎回清单的内容与格式

申购赎回清单中“T-2 日”指 T 日前本基金的第 2 个工作日。工作日指上海证券交易所、深圳证券交易所正常交易日。

1、申购、赎回清单的内容

T 日申购、赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金部分、T-2 日现金差额、T-2 日基金份额净值及其他相关内容。如果 T-2 日至 T 日存在主要境外市场非工作日或其他原因导致标的 ETF 暂停估值或暂缓估值等特殊情况，基金管理人可对申赎清单中 T-2 日现金差额、T-2 日基金份额净值及相关内容按照业务安排进行合理的调整，包括但不限于按照最近的可计算的基金份额净值进行计算和披露等。

2、组合证券相关内容

目前，本基金申购赎回清单的组合证券包括标的 ETF。申购、赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的标的 ETF 名称、代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分标的 ETF 的一定数量的现金。

1）现金替代分为 2 种类型：必须现金替代（标志为“必须”）和可以现金替代（标志为“允许”）。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，标的 ETF 必须使用现金作为替代，基金管理人按照固定现金替代金额与投资者进行结算。

可以现金替代是指在申购、赎回基金份额时，允许使用现金作为标的 ETF 的替代，基金管理人按照申购赎回清单要求，代理投资者买入或卖出标的 ETF，并与投资者进行相应结算。

2）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的标的 ETF 一般是由于标的 ETF 调整；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的情形。

②替代金额：对于必须现金替代的标的ETF，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金。必须替代金额的计算方法为申购赎回清单中必须现金替代标的 ETF 数量×经除权调整的T-2日标的ETF份额净值×T-2日估值汇率的乘积之和或基金管理人认为合理的其他方法。

3）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的标的 ETF 是指基金管理人认为需要在投资人申购或赎回时代投资人买入或卖出的情形。

②替代金额：对于可以现金替代的标的ETF，替代金额的计算公式为：

申购的替代金额＝替代标的ETF数量×经除权调整的T-2日标的ETF 份额净值×T-2日估值汇率×（1＋申购现金替代溢价比例）

收取申购现金替代溢价的原因是，基金管理人需要在收到申购确认信息后买入组合证券，结算成本与替代金额可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定申购现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。预先收取的替代金额高于购入该部分标的ETF的实际成本（或标的 ETF 实际结算成本），则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的替代金额低于购入该部分标的 ETF 的实际成本（或标的 ETF 实际结算成本），则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③申购替代金额的处理程序

T日，基金管理人根据申购赎回清单收取申购的替代金额。

对于确认成功的 T 日申购申请，在 T+1 日内(含 T 日)，基金管理人以收到的申购替代金额代投资者买入被替代标的ETF（买入方式包括但不限于二级市场买入、一级市场申购等）。基金管理人有权在 T+1 日内(含 T 日)任意时刻以收到的申购替代金额代投资者买入小于等于被替代标的ETF数量的任意数量的被替代标的ETF。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入部分被替代标的ETF，或者不进行任何买入标的ETF的操作。

在T+1日日终，基金管理人已买入的标的ETF，依据申购的替代金额与被替代标的ETF的实际买入成本（包括买入价格与相关交易费用，需用汇率公允价折算为人民币）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；未买入的标的ETF，依据申购的替代金额与被替代标的 ETFT+1 日份额净值（需用汇率公允价折算为人民币）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

在此期间若该部分标的 ETF 发生除息、收益分配等重要权益变动，则进行相应调整。正常情况下，T+4日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇境外主要投资市场临时停市等特殊情况，标的 ETF 的代理买入及结算价格可依次顺延至下一开放日直至交易正常，款项交收的日期也相应顺延。若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。

上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国人民银行或其授权机构最新公布的

人民币汇率中间价、中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格（如：中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的人民币兑主要外汇当日收盘价）等。

“T+1 日”、“T+4 日”指 T 日起本基金的第 1 个、第 4 个开放日，以此类推。开放日指上海证券交易所、深圳证券交易所和本基金投资的主要境外市场同时正常开放交易的工作日。

④赎回对应的替代金额的处理程序

对于确认成功的 T 日赎回申请，在 T+1 日内(含 T 日)，基金管理人根据赎回申请代投资者卖出被替代标的 ETF（卖出方式包括但不限于二级市场卖出、一级市场赎回等）。基金管理人有权在 T+1 日内(含 T 日)任意时刻代投资者卖出小于等于被替代标的 ETF 数量的任意数量的被替代标的 ETF。基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不卖出部分被替代标的 ETF，或者不进行任何卖出标的 ETF 的操作。

在 T+1 日日终，基金管理人已卖出的标的 ETF，按照被替代标的 ETF 的实际卖出金额（扣除相关费用，需用汇率公允价折算为人民币）确定基金应支付的替代金额；未卖出的标的 ETF，按照被替代标的 ETFT+1 日份额净值（需用汇率公允价折算为人民币）确定基金应支付给投资者的替代金额。

在此期间若该部分证券发生除息、收益分配等重要权益变动，则进行相应调整。正常情况下，T+7 日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。

如遇境外主要投资市场临时停市等特殊情况，标的 ETF 的代理卖出及结算价格可依次顺延至下一开放日直至交易正常，款项交收的日期也相应顺延。若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。

上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格（如：中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的人民币兑主要外汇当日收盘价）等。

“T+1 日”、“T+4 日”、“T+7 日”指 T 日起本基金的第 1 个、第 4 个、第 7 个开放日，以此类推。开放日指上海证券交易所、深圳证券交易所和本基金投资的主要境外市场同时正常开放交易的工作日。

⑤在系统支持的情况下，对于 T 日的申购赎回申请，基金管理人有权进行轧差处理，针对净申购，买入净申购份额对应被替代标的 ETF，针对净赎回，卖出净赎回份额对应被替代标的 ETF，基金管理人有权买入或者卖出不等于轧差处理后的上述被替代标的 ETF 数量的任意数量的被替代标的 ETF，在 T+1 日日终，所有申购赎回对应的被替代标的 ETF 均按照轧差处理后买入或者卖出的交易金额（买入价格加上相关费用或者卖出价格扣除相关费用，需用汇率公允价折算为人民币），确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

上述汇率目前采用汇率公允价。汇率公允价包括中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价、中国外汇交易中心最新收盘价、与基金托管人商定的其他公允价格（如：

中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的人民币兑主要外汇当日收盘价）等。

⑥基金管理人可以根据具体情况，调整申购、赎回替代金额的处理程序、规则等，并在招募说明书更新及其他公告中披露。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购、赎回清单中公告 T 日预估现金部分。其计算公式为：

T 日预估现金差额＝T-2 日最小申购赎回单位的基金资产净值-（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以现金替代的标的 ETF 的数量、经除权调整的 T-2 日标的 ETF 份额净值及 T-2 日估值汇率的乘积之和）

其中，若 T-1 日或 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-2 日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。如果 T-2 日至 T 日期间存在境外主要投资市场交易日且非申赎开放日，或发生其他特殊情况，则基金管理人可对 T-2 日最小申购赎回单位的基金资产净值等进行调整，下同。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+2 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额＝T 日最小申购赎回单位的基金资产净值-(申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以现金替代的标的 ETF 的数量、T 日标的 ETF 份额净值及 T 日估值汇率的乘积之和)

T 日投资者申购、赎回基金份额时，需按 T+2 日内公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。如果出现境外主要投资市场 T 日至 T+2 日期间暂停交易或交收、流动性不足等原因导致暂停估值或不能计算现金差额，则现金差额的公告、清算交收可延迟办理。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购、赎回清单的格式

申购、赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	20**年**月**日
基金名称	华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
基金管理公司名称	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金代码	******

20**年**月**日信息内容

现金差额（单位:元）	
最小申购、赎回单位净值（单位:元）	
基金份额净值（单位:元）	

20**年**月**日信息内容

最小申购、赎回单位的预估现金部分（单位:元）	
现金替代比例上限	
当日累计可申购的基金份额上限	
当日累计可赎回的基金份额上限	
当日净申购的基金份额上限	
当日净赎回的基金份额上限	
单个证券账户当日净申购的基金份额上限	
单个证券账户当日净赎回的基金份额上限	
单个证券账户当日累计可申购的基金份额上限	
单个证券账户当日累计可赎回的基金份额上限	
是否需要公布 IOPV	
最小申购、赎回单位（单位：份）	
申购赎回的允许情况	
申购赎回模式	

成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量(股)	现金替代标志	申购现金替代溢价比例	赎回现金替代折价比例	替代金额(单位：人民币元)	挂牌市场

说明：以上申购赎回清单仅为示例，申购、赎回清单的格式可根据上海证券交易所的系统升级相应调整，具体以实际公布为准。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、本基金投资的主要市场证券、期货交易所、外汇市场交易时间非正常停市、遇公共节假日等特殊情况，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

7、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。

9、相关证券交易所、期货交易所、外汇市场、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。

10、因外汇额度等原因需要控制基金申购规模。

11、标的 ETF 暂停申购、暂停上市、停牌或标的 ETF 出现操作错误或其他重大事件、标的 ETF 暂停基金资产估值、标的 ETF 短期内流动性下降明显等情形时，且基金管理人认为有必要暂停本基金申购的。

12、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

13、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第 4 项暂停申购情形且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价。

3、本基金投资的主要市场证券、期货交易所、外汇市场交易时间非正常停市、遇公共节假日等特殊情况，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延

缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请。

6、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单，或在开市后发现申购赎回清单编制错误或 IOPV 计算错误。

7、相关证券交易所、期货交易所、外汇市场、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。

8、标的 ETF 暂停赎回、暂停上市、停牌或标的 ETF 出现操作错误或其他重大事件、标的 ETF 暂停基金资产估值、标的 ETF 短期内流动性下降明显等情形时，且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。

9、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

（十一）其他申购赎回方式

1、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可以根据具体情况，在履行适当程序后，开通本基金的场内实物申购赎回、场外申购赎回等业务，无需召开基金份额持有人大会。场内实物申购赎回、场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

2、基金管理人可以在不违反法律法规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，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

3、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，集合申购业务的相关规则由基金管理人制定并依照《信息披露办法》的有关规定及时公告。

4、ETF 联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。若本基金推出联接基金，在本基金开放申购赎回之前，有权向本基金联接基金开通特殊申购，具体见更新的招募说明书或相关公告。

5、对于符合《特定机构投资者参与证券投资基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购赎回方式，并于新的申购赎回方式开始执行前另行公告。

6、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议。

（十二）基金的非交易过户、冻结及解冻

登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

（十三）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

（十四）基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，并在新的申购赎回安排实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

（十五）基金清算交收与登记模式的调整或新增

本基金获批后，若上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式指数证券投资基金调整清算交收与登记模式、推出新的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，基金管理人有权调整本基金的清算交收与登记模式及申购、赎回方式，或新增本基金的清算交收与登记模式并引入新的申购、赎回方式，届时将发布公告予以披露并对本基金的招募说明书予以更新，无需召开基金份额持有人大会审议。

十二、基金的投资

（一）投资目标

本基金主要通过投资于标的ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）投资范围

本基金以标的 ETF 基金份额为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、与标的指数相关的公募基金（含ETF）、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品以及其他境外市场投资工具和境内市场投资工具。

境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票以及存托凭证（下同））、衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、现金资产、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的相关规定）。

境外市场投资工具包括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ETF）；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；香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）；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；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；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；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；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。

其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

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。本基金将根据法律法规的规定参与境内融资及转融通证券出借业务。

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

本基金投资于标的ETF的比例不低于基金资产净值的90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度扩大，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行标的 ETF 的买卖。本基金还将适度参与标的 ETF 基金份额交易和申购、赎回的组合套利，力争增强基金收益。

本基金除主要投资标的 ETF 以外，还可投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、与标的指数相关的公募基金（含 ETF）、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品以及其他境内市场和境外市场依法发行的金融工具，追求尽可能贴近标的指数的表现。

2、股票（含存托凭证）投资策略

本基金对标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）的投资目的是构建股票组合以申购标的 ETF。该部分资产投资主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股（含存托凭证）及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股（含存托凭证）流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票（含存托凭证）长期停牌；（4）其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。

3、债券的投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，构建债券投资组合，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。

其中可转换债券和可交换债券，结合了权益类证券与固定收益类证券的特性，具有下行风险有限同时可分享基础股票价格上涨的特点。本基金将评估其内在投资价值，结合对可转换债券、可交换债券市场上的溢价率及其变动趋势、行业资金的配置以及基础股票基本面的综合分析，最终确定其投资权重及具体品种。

4、衍生品投资策略

（1）境外金融衍生品投资策略

为更好地实现本基金的投资目标，本基金将在条件允许的情况下投资于远期合约、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，以期降低跟踪误差水平。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的金融衍生品进行交易。

为了更好地跟踪标的指数，本基金还可通过投资外汇期货、外汇远期、外汇互换等来管理基金投资以及应对申购赎回过程中的汇率风险。

（2）境内金融衍生品投资策略

为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。

1）股指期货投资策略

本基金投资股指期货时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

2）股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。

3）国债期货投资策略

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5、资产支持证券的投资策略

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

6、境内融资及转融通证券出借业务

本基金还可以参与境内融资及转融通证券出借业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

本基金参与转融通证券出借业务，将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例。

7、境外回购交易及证券借贷交易策略

为更好地实现投资目标，增加基金收益，弥补基金运作成本，本基金在控制风险的前提下可以进行境外回购交易、境外证券借贷交易。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金在履行适当程序后可相应调整和更新相关投资策略，并按规定公告。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金投资于标的 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；

2）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

3）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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

4）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；

本基金境内投资应遵循以下限制：

5）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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；

6）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%；

7）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%；

8）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%；

9）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%；

10）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；

11）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；

12）本基金参与股指期货和国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

①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%；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和标的 ETF 总市值的20%；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%；

②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%；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%；

③在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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、标的 ETF、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；

④本基金所持有的股票市值、标的 ETF 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、标的 ETF 投资比例的有关约定；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）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

13）基金因未平仓的股票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%；

开仓卖出认购股票期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽股票期权的，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股票期权保证金的现金等价物；未平仓的股票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；

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

15）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

①出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围；

②参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；

③最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

④证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、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本条规定的，基金管理人不得新增出借业务；

16）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；

本基金境外投资应遵循以下限制：

17）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可以不受上述限制；

18）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%；

19）基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

20）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%；

21）金融衍生品投资限制

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

①基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%；

②基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%；

③基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：所有参与交易的对手方（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基金资产净值的20%；

22）本基金可以参与境外证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

①所有参与交易的对手方（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：现金；存款证明；商业票据；政府债券；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；

23）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的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；

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

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

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

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

24）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；

25）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 3）、4）、5）、10）、15）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、标的 ETF 暂停申购、赎回、暂停上市或二级市场交易停牌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，基金管理人应当在所涉境内证券可交易之日起 10 个交易日内进行调整，所涉境外证券可交易之日起 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）购买不动产；

（2）购买房地产抵押按揭；

（3）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；

（4）购买实物商品；

（5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；该临时用途借入现金的比例超过基金资产净值的 10%；

（6）利用融资购买证券，但投资金融衍生品以及法律法规及中国证监会另有规定的除外；

（7）参与未持有基础资产的卖空交易；

（8）直接投资与实物商品相关的衍生品；

（9）购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层；

（10）承销证券；

（11）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（12）从事承担无限责任的投资；

（13）向其基金管理人、基金托管人出资；

（14）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（15）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如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。

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。

（五）标的指数

本基金的标的指数为新交所泛东南亚科技指数。

本基金标的指数由新加坡交易所编制并发布，旨在追踪东南亚和新兴亚洲市场前 30 大科技公司的表现。本基金标的指数涵盖主要从事技术相关行业的公司，如信息技术、软件和咨询、汽车制造、电元件和制造、零售和媒体服务等。

除基金合同另有约定外，未来若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，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，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，基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指

数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

（六）业绩比较基准

业绩比较基准为新交所泛东南亚科技指数收益率（使用估值汇率折算）。

本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在履行适当程序后及时公告。

（七）风险收益特征

本基金标的 ETF 为股票指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的 ETF，紧密跟踪指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金主要投资新加坡证券市场上市的 ETF，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等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

（八）标的 ETF 的变更

标的 ETF 出现下述情形之一的，本基金将本着维护投资者合法权益的原则并履行适当程序后，由主要投资于标的 ETF 变更为直接投资于该标的指数成份股和备选成份股的指数基金，无需召开基金份额持有人大会审议；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数或与其合并。相应地，基金合同中将删除关于标的 ETF 的表述部分。基金管理人也可以履行适当程序后变更本基金的标的 ETF，届时将由基金管理人另行公告。

1、标的 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；

2、标的 ETF 终止上市；

3、标的 ETF 基金合同终止；

4、标的 ETF 与其他基金进行合并；

5、标的 ETF 的基金管理人发生变更；

6、中国证监会规定的其他情形。

若标的 ETF 变更标的指数，本基金将相应变更标的指数且继续投资于该标的 ETF。

（九）基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（十）基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2026 年 06 月 30 日，本报告财务资料未经审计师审计

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	1,035,589,382.24	99.10
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,958,878.71	0.76
8	其他资产	1,428,472.79	0.14
9	合计	1,044,976,733.74	100.00

注：上述基金投资不包括可退替代款估值增值。

2、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

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5、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。

6、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。

7、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。

8、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。

9、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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	CSOP IEDGE SEA+ TECH ETF USD	指数型	交易型开放式	南方东英资产管理有限公司	1,035,589,382.24	99.71

10、投资组合报告附注

10.1 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的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,163,653.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	204,327.00
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	1,428,472.79

10.4 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处于转股期的可转换债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

10.6 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。

十三、基金的业绩

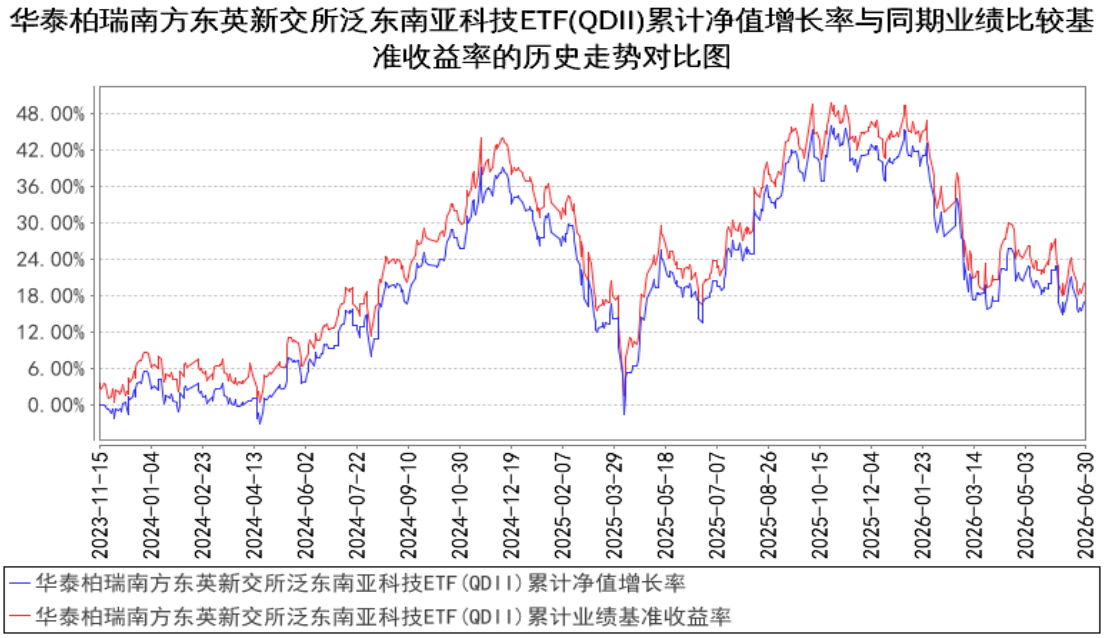
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2026 年 06 月 30 日。

1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2024.01.01-2024.12.31	26.39%	0.96%	26.65%	0.94%	-0.26%	0.02%
2025.01.01-2025.12.31	5.66%	1.33%	4.83%	1.32%	0.83%	0.01%
2026.01.01-2026.06.30	-16.81%	1.33%	-16.72%	1.36%	-0.09%	-0.03%
2026.04.01-2026.06.30	0.76%	1.18%	0.35%	1.20%	0.41%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.18%	1.18%	20.21%	1.19%	-3.03%	-0.01%

2、图示自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：图示日期为 2023 年 11 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日。

十四、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、标的 ETF 基金份额、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

（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）基金财产的账户

基金托管人及境外托管人根据境内及投资所在地相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、境外托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人和/或其委托的境外托管人保管。基金管理人、基金托管人、境外托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人、境外托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

在符合基金合同和托管协议有关资产保管的要求下，对境外托管人的破产而产生的损失，基金托管人应采取措施进行追偿，基金管理人配合基金托管人进行追偿。基金托管人在已根据《试行办法》的要求谨慎、尽职地选择、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、基金合同及托管协议的要求保管托管资产的前提下，基金托管人对境外托管人破产产生的损失不承担责任。

除非基金管理人、基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金管理人、基金托管人将不保证基金托管人或境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）及其他效力瑕疵。基金管理人、基金托管人不对境外托管人依据当地法律法规、证券、期货交易所规则、市场惯例的作为或不作为承担责任。

基金托管人和境外托管人应妥善保存基金管理人基金财产汇入、汇出、兑换、收汇、现金往来及证券交易的记录、凭证等相关资料，并按规定的期限保管，但境外托管人持有的与境外托管人账户相关的资料的保管应按照境外托管人的业务惯例保管。

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，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盘程序明文规定该等现金不归于清算财产外。

十五、基金资产的估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的股票、基金、存托凭证、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定，并可参考国际会计准则。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

（四）估值方法

1、标的ETF估值方法

（1）本基金投资的标的ETF份额按照估值日标的ETF的基金份额净值估值。

（2）标的ETF估值日无份额净值披露的，以最近一日的份额净值估值。

（3）如果基金管理人认为按上述价格不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。

2、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品

种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

3、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

4、固定收益品种的估值

境内部分：

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

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

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

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

（4）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

境外部分：

（1）对于首次发行未上市的境外债券按成本价估值；对于非上市境外债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

（2）对于上市流通的境外债券，境外证券交易所实行净价交易的债券按估值日在证券交易所的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；境外证券交易所未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

5、同一证券同时在两个或者两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

6、衍生品估值方法：

（1）本基金境内投资国债期货合约、股指期货合约、股票期权合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易

日结算价估值。

（2）境外上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（3）境外未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值；若衍生品价格无法通过公开信息取得，由基金管理人负责从其经纪商处取得，并及时告知基金托管人。

7、本基金投资境外存托凭证，公开挂牌的存托凭证按估值日在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。本基金投资境内存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

8、标的 ETF 以外基金估值方法：

非上市基金的估值：

（1）非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

（2）货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

上市基金的估值：

（1）投资的 ETF 基金（标的 ETF 除外），按所投资 ETF 基金估值日的收盘价估值。

（2）上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值。

（3）上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。

（4）上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

9、本基金参与融资或转融通证券出借业务，应参照监管机构或行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

10、本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应使用基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价或其他基金管理人与托管人协商一致的第三方数据服务商提供的汇率；涉及到其它币种与人民币之间的汇率，参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

11、对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

对于非代扣代缴的税收，基金管理人可聘请税收顾问对相关投资市场的税收情况给予意见和建议。境外托管人根据基金管理人的指示具体协调基金在海外税务的申报、缴纳及索取税收返还等相关工作。基金根据国家法律法规和基金投资所在地的法律法规规定及中国与该

国家或地区签署的相关税收协定履行纳税义务。

除因基金管理人或基金托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外，基金管理人和基金托管人不承担责任。

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

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

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

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

（五）估值程序

1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。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。

基金管理人于每个估值日的下一个工作日计算该估值日基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日的下一个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日的下一个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

（六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接经济损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（七）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人、境外托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂

停估值；

4、本基金所投资的标的 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

5、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（八）基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日的下一个工作日计算该估值日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

（九）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

3、全球投资涉及不同市场及时区，由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在本基金管理人和本基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。

4、由于不可抗力，或证券、期货交易所、外汇交易市场、指数编制机构、登记结算公司、第三方估值基准服务机构、存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏等原因，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十六、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、当基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，可进行收益分配；

3、在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配4次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值；

4、若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

5、本基金收益分配采用现金方式；

6、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。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无重大实质不利影响的情况下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

（二）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累计报酬率、标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬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100%；标的指数同期累计报酬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100%（使用估值汇率折算）。

基金管理人将以此计算截至收益评价日基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率的差额，当差额超过1%时，基金可以进行收益分配。

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确定收益分配数额。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金超额收益、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。

（四）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。

（五）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

十七、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费，含境外托管人的托管费；

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、仲裁费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金投资标的 ETF、境外股票而产生的各项合理费用（包括但不限于标的 ETF 的交易费用、申购赎回费用等）；

7、基金的证券/期货账户开立费用、证券/期货交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees），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、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金进行外汇兑换交易的相关费用；

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及费用），以及为基金利益聘请税务顾问产生的费用；

11、基金的开户费用、账户维护费用；

12、基金上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；

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、为应付赎回和交易清算而进行临时借款所发生的费用（境外托管人垫付资金所产生的合理费用）；

15、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 0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.40%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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×0.10%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3－15 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、指数许可使用费，指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；

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，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。

十八、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度，并可参考国际会计准则；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人、境外托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

十九、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

（二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

在未来法律法规允许的情况下，本基金可以人民币以外的币种计算并披露净值及相关信息。涉及币种之间转换的，应当披露汇率数据来源，并保持一致性。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要

（1）基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

（4）基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。

3、基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日规定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在规定报刊和规定网站上登载基金合同生效公告。

4、基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日，并应当依照《信息披露办法》的有关规定将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应及时将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

5、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

6、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前且基金份额未上市交易的，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后或基金份额上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日/交易日的 2 个工作日内，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日/交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的 2 个工作日内，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。

7、基金份额申购、赎回对价

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回对

价的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

8、申购、赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过基金销售机构网站或营业网点以及其他媒介公告当日的申购、赎回清单。

9、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

10、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

（1） 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2） 基金终止上市交易、基金合同终止、基金清算；

（3） 转换基金运作方式、基金合并；

（4） 更换基金管理人、基金托管人、境外托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

（5） 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

（6） 基金管理人、基金托管人、境外托管人的法定名称、住所发生变更；

（7） 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（8） 基金募集期延长或提前结束募集；

（9） 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发

生变动；

（10） 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

（11） 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

（12） 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

（13） 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事项，但中国证监会另有规定的除外；

（14） 基金收益分配事项；

（15） 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（16） 基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；

（17） 本基金开始办理申购、赎回；

（18） 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（19） 本基金推出新业务或服务；

（20） 基金交易停牌或复牌；

（21）本基金变更标的指数或标的 ETF；

（22）标的 ETF 发生重大影响事件，如变更标的指数、终止上市、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；

（23）调整最小申购、赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

（24）发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；

（25）基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

11、澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告基金上市交易的证券交易所。

12、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

13、清算报告

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。

14、参与境内融资交易和转融通证券出借业务的相关公告

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露基金参与融资交易和转融通证券出借业务情况，包括投资策略、业务开展情况、

损益情况、风险及其管理情况等，并就转融通证券出借业务在报告期内涉及的重大关联交易事项做详细说明。

15、投资股指期货的相关公告

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标。

16、投资国债期货的相关公告

基金管理人应在在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书更新等文件中披露的国债期货交易情况，应当包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。

17、投资股票期权的相关公告

基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

18、投资资产支持证券的相关公告

基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

19、投资港股通标的股票的相关公告

基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。

20、中国证监会规定的其他信息。

（六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规以及证券交易所的自律管理规则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金净值信息、基金份额申购赎回对价、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露

信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

（七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

（八）暂停或延迟披露基金信息的情形

1、不可抗力；

2、发生暂停估值的情形；

3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

（九）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

二十、基金的风险揭示

投资于本基金的主要风险包括：

（一）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

（二）标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（三）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

1、本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，标的 ETF 对标的指数的跟踪误差会影响本基金对标的指数的跟踪误差。

2、标的 ETF 派发现金红利等所获收益可能导致本基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

3、由于标的 ETF 暂停申赎、停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、由于基金投资过程中买入和卖出标的 ETF 以及成份股时均存在交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

5、在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

6、其他因素产生的偏离。如因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（四）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（五）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

1、标的 ETF 可能因成份股停牌无法及时调整投资组合，进而导致本基金跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

2、停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

（六）标的 ETF/标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如出现变更标的指数或变更标的 ETF 的情形，本基金将变更标的指

数或标的 ETF。投资者届时须承担标的 ETF 和/或标的指数变更所带来的风险。

（七）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定召集基金份额持有人大会进行表决。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。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，基金合同直接终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（八）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

（九）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或者基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购、赎回清单、人民币汇率和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

（十）退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

（十一）投资者申购失败的风险

如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请，则投资者的申购申请可能失败。此外，如果基金可用的外汇额度不足，申购赎回代理券商应付资金不足或出现违约，投资者的申购申请也可能失败。

（十二）投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

（十三）基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险

因涉及境外市场证券的买卖，在投资者申购、赎回本基金时，本基金组合证券需以现金形式进行替代，并由基金管理人按照招募说明书（更新）的约定在投资人申购或赎回时代投资人买入或卖出证券，投资者需承受买入组合证券的结算成本和卖出组合证券的结算金额的

不确定性（含汇率波动风险）。

由于组合证券采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性，而这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。投资者在赎回基金份额时，基金投资组合变现可能受到市场变化、标的 ETF 停牌或流动性不足等因素影响，导致投资者收到的赎回对价可能延期交收或赎回对价的金额出现较大波动的风险。此外，基金管理人可根据运作情况调整代理申赎投资者买券卖券的相关规则，存在相关规则变动带来的风险。

（十四）第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

1、申购赎回代理券商因多种原因（包括但不限于技术故障、资格丧失、额度限制等原因），导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

2、登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来交易方式调整的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

3、证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理券商及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

（十五）管理风险与操作风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险，例如，申购、赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

（十六）技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中，可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构及销售代理机构等。

（十七）流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金是开放式基金，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断变化。基金投资人的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现，而导致基金的投资组合流动性不足；或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低，造成基金资产变现的损失，从而产生流动性风险。

1、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的ETF，经考察标的ETF和标的指数成份股数量、日均成交量以及日

均成交金额，该指数将具有充足的流动性可满足本基金投资的要求；本基金在组合构建过程中，将根据开放日申购和赎回情况，决定投资标的 ETF 的时间和方式。一般情况下，上述投资标的流动性较好，但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况，如因标的 ETF 流动性严重不足等特殊情形导致基金无法完全投资于标的 ETF 时，基金管理人将根据市场情况，并结合经验判断，采取其他合理的指数投资技术适当调整基金投资组合，以期有效控制本基金的流动性风险。如标的 ETF 暂停赎回、暂停上市或暂停在二级市场交易，导致基金管理人出现现金支付困难，基金管理人因此暂停接受投资者的赎回申请，可能给本基金带来不利影响。

2、本基金实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在特殊情形下，基金管理人可能会实施备用流动性风险管理工具，包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。如果基金管理人实施备用流动性风险管理工具当中的一种或几种，基金投资人可能会面临赎回效率降低、赎回对价延期到账以及暂时无法获取基金净值等风险。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

（1）暂停接受赎回申请：

具体措施可详见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

（2）延缓支付赎回对价：

具体措施可详见基金合同“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形”，详细了解本基金延缓支付赎回对价的情形及程序。

在此情形下，基金份额持有人可能存在赎回对价延期到账的风险。

（3）暂停基金估值：

具体措施可详见基金合同“第十六部分 基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人暂时无法获取基金净值，且基金将延缓支付赎回对价或暂停接受基金份额持有人的申购、赎回申请。延缓支付赎回对价可能影响基金份额持有人的资金安排，暂停接受基金申购、赎回申请将导致基金份额持有人无法申购或赎回本基金。

（4）中国证监会认定的其他措施。

3、对 ETF 基金投资人而言，ETF 可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

（十八）股指期货的投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货主要存在以下风险：

1、市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。

2、流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

3、基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

4、保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

5、信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

6、操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

（十九）股票期权的投资风险

本基金可投资于股票期权。股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险。在参与股票期权交易时，应当关注股票现货市场的价格波动、股票期权的价格波动和其他市场风险以及可能造成的损失。

（二十）国债期货的投资风险

本基金可投资于国债期货。国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

（二十一）存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（二十二）资产支持证券的投资风险

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险、提前偿付风险等风险。本基金将结合定量分析和定性分析的方法，在预期风险可控的前提下，谨慎配置相对风险较低、投资价值较高的境内资产支持证券。

（二十三）港股通标的股票的投资风险

本基金可通过港股通机制投资于香港联合交易所（以下简称“香港联交所”）上市的股票，但基金资产并非必然投资港股通标的股票。由此带来的风险包括但不限于：

1、海外市场风险

本基金在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

2、股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金的波动风险可能相对较大。

3、汇率风险

本基金在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

4、港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场每日额度不足，而不能买入看好的投资标的进而错失投资机会的风险。

5、港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入，本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

6、港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有内地与香港均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），而导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

7、交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

8、港股通标的股票权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通标的股票权益分派、转换、上市公司被收

购等情形或者异常情况，所取得的港股通标的股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通标的股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通标的股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

9、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及*ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

10、港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

此外，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

（二十四）参与境内融资及转融通业务的风险

本基金可参与境内融资及转融通证券出借业务。融资及转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。其中，转融通证券出借业务的流动性风险是指基金面临大额赎回时可能因证券出借原因无法及时变现支付赎回对价的风险；信用风险是指证券出借对手方无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；市场风险是指证券出借期间无法正常处置该证券的风险。

基金管理人将遵守审慎经营原则，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，有效防范和控制风险。

（二十五）本基金特有的风险

本基金为境内募集和上市交易、通过主要投资于标的 ETF 来实现投资目标的交易型开放式指数基金，投资运作主要涉及到新加坡证券市场，新加坡交易所上市的基金、股票的交易规则、业务规则和市场惯例与内地有较大差异，从而导致本基金的运作可能受到影响而带来特有的风险，由此带来的风险包括但不限于：

1、投资于标的 ETF 的风险

（1）本基金以不低于基金资产净值 90%的资产投资于标的 ETF，在多数情况下将维持较高的标的 ETF 投资比例，基金净值可能会随标的 ETF 的净值或市场交易价格波动而波动，标

的 ETF 的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

标的 ETF 风险包括但不限于如下情形：①标的 ETF 流动性短期内明显下降的风险；②标的 ETF 运作风险，包括但不限于标的 ETF 出现操作错误等情形、标的 ETF 暂停申购、赎回及交易、标的 ETF 暂停基金资产估值；③标的 ETF 终止运作的风险等。

（2）本基金主要投资于标的 ETF，存在本基金与被投资标的 ETF 产生的各类基金费用的双重收取情况，相较于其他基金产品存在额外增加投资者投资成本的风险。

（3）本基金主要投资于标的 ETF，但由于投资方法、交易方式等方面与标的 ETF 不同，本基金的业绩表现与标的 ETF 的业绩表现可能出现差异。

（4）本基金主要通过投资于标的 ETF 基金份额，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。以下因素可能会影响到基金的投资组合与跟踪基准之间产生偏离：

①标的 ETF 与标的指数的偏离。

②基金买卖标的 ETF 时所产生的价格差异、交易成本和交易冲击。

③基金调整资产配置结构时所产生的跟踪误差。

④基金申购、赎回因素所产生的跟踪误差。

⑤基金现金资产拖累所产生的跟踪误差。

⑥基金的管理费和托管费等所产生的跟踪误差。

⑦其他因素所产生的偏差。

（5）其他投资于标的 ETF 的风险

如标的 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、标的 ETF 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、标的 ETF 退市风险等等。

2、海外市场风险

本基金投资于海外市场，面临海外市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。此外，基金主要投资的海外证券市场可能对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此对于无涨跌幅上下限的规定证券市场的证券，每日涨跌幅空间相对较大。这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

3、政府管制风险

在特殊情况下，基金所投资市场有可能面临政府管制措施，包括对货币兑换进行限制、限制资本外流、征收高额税收等，会对基金投资造成影响。

4、监管风险

由于监管层或监管模式出现非预期的变动，某些已经存在的或者运作的交易可能被新的监管层或监管体系认定为非法交易，或受到更严格的管理，将导致基金运作承受监管风险。基金运作可能被迫进行调整，由此可能对基金净值产生影响。

5、政治风险

基金所投资市场因政治局势变化，如政策变化、罢工、恐怖袭击、战争、暴动等，可能出现市场大幅波动，对基金净值产生不利影响。

6、汇率风险

本基金投资的海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；此外，外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

7、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

8、衍生品风险

本基金可投资于期货与期权等金融衍生品。尽管本基金将谨慎地使用衍生品进行投资，但衍生品仍可能给基金带来额外风险，包括杠杆风险、交易对手的信用风险、衍生品价格与其基础品种的相关度降低带来的风险等，由此可能会增加基金净值的波动幅度。在本基金中，衍生品将仅用于避险和进行组合的有效管理。

9、信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化。

10、法律及税务风险

基金所投资的国家/地区的法律法规、税务政策可能与国内不同，海外市场可能要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，使基金收益受到一定影响。此外，各国/地区的法律及税收规定可能发生变化，有可能对基金造成不利影响，或者实施具有追溯力的修订，可能导致本基金向该国家/地区缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

11、交易结算风险

海外的证券交易佣金可能比国内高。海外证券交易所、货币市场、证券交易体系以及证券经纪商的监管体系和制度与国内不同。证券交易交割时间、资金清算时间有可能比国内需要更长时间。此外，在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失。

12、证券借贷/正回购/逆回购风险

证券借贷的风险表现为，作为证券借出方，如果交易对手方（即证券借入方）违约，则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致基金资产发生损失。证券回购中的风险体现为，在回购交易中，交易对手方可能因财务状况或其它原因不能履行付款或结算的义务，从而对基金资产价值造成不利影响。

13、引入境外托管人的风险

本基金由境外托管人提供境外资产托管服务，存在因适用法律不同导致基金资产损失的风险：由于境外所适用法律法规与中国法律法规有所不同的原因，可能导致本基金的某些投资及运作行为在境外受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失风险。

（二十六）会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是

指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

（二十七）运作风险

在本基金运作过程中，本基金通过合格境内机构投资者境外投资额度投资于境外市场将受到境外投资额度制约，或受限于境外市场相关政策，由此可能影响本基金投资策略的实现，从而对基金资产带来不利影响。

（二十八）本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

（二十九）不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

（三十）新交所泛东南亚科技指数是根据新加坡交易所的许可使用的商标。新交所泛东南亚科技指数中的所有版权和数据库权利仅属于新加坡交易所并根据许可在此使用。华泰柏瑞基金管理有限公司对华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同负全部责任。新加坡交易所对该等华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同的购买或销售不持任何立场，且不承担与此相关的任何责任。

二十一、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，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、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，但因本基金所持基金、证券的流动性受到限制而不能

及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《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的规定。

二十二、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

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定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；

（10）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；在遵循基金份额持有人利益优先原则的前提下代表本基金就本基金所持有的标的 ETF 行使相关基金份额持有人权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通业务；

（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、非交易过户、转托管等的业务规则，开通人民币之外的其他销售币种基金份额的申购、赎回等业务；

（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，进行基金、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、申购和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、赎回的对价，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，但应监管机构、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提供服务需要提供的情况除外；

（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，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；

（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。

3、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，如发现基金管理人有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，有权呈报中国证监会，并可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和证券账户等投资所需账户、为基金办理证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）选择、更换或撤销境外托管人并与之签署有关协议；

（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。

4、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，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但应监管机构、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提供服务需要提供的情况除外；

（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、基金份额申购、赎回对价的现金部分；

（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；如果基金管理人有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，保存期限不低于法律法规的规定；

（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的现金部分；

（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）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；

（23）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，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盘程序明文规定该等现金不归于清算财产外。境外托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘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；

（24）保护基金份额持有人利益，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；

（25）安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

（26）按法律法规规定，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）基金托管人应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）基金托管人应保存基金管理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，保存期限不低于法律法规的规定；

（29）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、疏忽等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，托管人不承担责任 ；

（30）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。

5、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）在购买本基金前认真阅读基金合同、托管协议，了解并接受基金管理人、基金托管人按照基金合同、托管协议就本基金海外投资运作、托管所作出的各项安排，愿意接受本基金资产在境外投资运作、托管中可能产生的法律风险、税收风险及《基金合同》所列明的其他风险；

（10）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。

6、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、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）遵守基金管理人、销售机构、证券交易所和登记机构的相关交易及业务规则；

（10）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二）基金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。

鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金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。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

1、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、中国证监会和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，但由于标的 ETF 的基金交易方式变更、标的 ETF 终止上市、标的 ETF 的基金合同终止、标的 ETF 与其他基金进行合并、标的 ETF 的基金管理人发生变更而变更本基金投资目标、范围或策略的情况除外；

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）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

13）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

2）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式、调整基金份额类别；

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变化；

5）基金管理人、代销机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户、转托管等业务的规则（包括但不限于申购赎回清单的调整、开放时间的调整、申购对价/赎回对价组成的调整等）；

6）基金推出新业务或服务；

7）本基金的标的 ETF 更名或者标的指数更名时，本基金可相应调整基金名称、标的指数名称、业绩比较基准；

8）监管机关或证券交易所要求或决定本基金终止上市；

9）由于标的 ETF 的基金交易方式变更、标的 ETF 终止上市、标的 ETF 的基金合同终止、标的 ETF 与其他基金进行合并、标的 ETF 的基金管理人发生变更而变更为直接投资于该标的指数成份股和备选成份股的指数基金；

10）增加新的销售币种、调整现有基金销售币种设置、停止现有币种的销售；

11）按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、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。

3、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、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。

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持

有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对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）在法律法规及监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（4）基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式，具体方式在会议通知中列明。

5、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 7 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。

6、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、中国证监会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。

7、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。

8、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按照《信息披露办法》的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。

9、标的 ETF 召开基金份额持有人大会时，本基金的基金管理人应当代表其基金份额持有人的利益，参与标的 ETF 的基金份额持有人大会，并在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

10、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。

（三）《基金合同》解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本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，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

2、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。

3、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，但因本基金所持基金、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。

4、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。

5、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。

6、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。

7、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的规定。

（四）争议解决方式

各方当事人同意，因本合同产生或与之相关的争议，如经一方提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人和基金托管人应恪守职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本合同受中国法律（为本合同之目的，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。

（五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，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。

二十三、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：贾波

成立时间：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】178 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：

（1）对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的标的指数成分股、相关的公募基金等各投资品种的具体范围及时提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际

情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

本基金以标的 ETF 基金份额为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、与标的指数相关的公募基金（含 ETF）、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品以及其他境外市场投资工具和境内市场投资工具。

境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票以及存托凭证（下同））、衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、现金资产、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的相关规定）。

境外市场投资工具包括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 ETF）；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；香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）；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；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；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；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；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。

其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

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。本基金将根据法律法规的规定参与境内融资及转融通证券出借业务。

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

本基金投资于标的 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

（2）对基金投融资比例进行监督；

1）本基金投资于标的 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；

2）本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

3）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本款

所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

4）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；

本基金境内投资应遵循以下限制：

5）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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；

6）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%；

7）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%；

8）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%；

9）本基金管理人管理的且由本基金托管人托管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%；

10）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；

11）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；

12）本基金参与股指期货和国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

①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%；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和标的 ETF 总市值的20%；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%；

②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%；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%；

③在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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、标的 ETF、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；

④本基金所持有的股票市值、标的 ETF 和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不低于基金资产净值的90%，以符合基金合同关于股票、标的ETF投资比例的有关约定；

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

14）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：

①出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围；

②参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

③最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

因证券市场波动、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本条规定的，基金管理人不得新增出借业务；

15）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；

本基金境外投资应遵循以下限制：

16）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可以不受上述限制；

17）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%；

18）基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%。前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产；

19）法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述 3）、4）、5）、10）、14）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、标的 ETF 暂停申购、赎回、暂停上市或二级市场交易停牌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，基金管理人应当在所涉境内证券可交易之日起 10 个交易日内进行调整，所涉境外证券可交易之日起 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。

（3）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。

（4）基金参与转融通证券出借业务，基金管理人应当遵守审慎经营原则，配备技术系统

和专业人员，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，完善业务流程，有效防范和控制风险，基金托管人将依据第（2）条 14）款的约定对基金参与转融通证券出借业务进行监督。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露中登载基金业绩表现数据等进行复核。

3、基金托管人在上述第 1、2 款的监督和核查中发现基金管理人违反上述约定，应及时提示基金管理人，基金管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对提示事项进行复查。基金管理人对基金托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

4、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议规定的，应当及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

5、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、境外托管人的固有财产，但上述资产不包括由基金托管人或境外托管人在清算机构或其他证券集中处理系统中持有的证券。

（2）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照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。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，分账管理，独立核算，确保基金财产的完整与独立。如果本基金投资的境外市场的某些货币同类存款的通行利率为负值，境外托管人可能会对境外托管账户中的现金收取利息或相应费用。

（5）基金托管人可将基金财产安全保管和办理与基金财产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。除法律法规另有规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（6）现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。

（7）托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例，支付现金、办理证券登记等托管业务。

（8）基金托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘或破产等原因进行终止清算时，不得将任何证券、非现金资产及其收益归入其清算财产；境外托管人因上述同样原因进行终止清算时，基金托管人应当要求境外托管人不得将证券、非现金资产及其收益归入其清算财产，但当地的法律、法规和市场惯例不允许托管证券独立于清算财产的情况除外。基金托管人应当确保自身及境外托管人采取商业上的合理行动以保证证券、非现金资产的任何部分不会在其进行清算时，作为可分配财产分配给其债权人。当基金托管人知道托管资产的任何一部份将被视为托管人的清算财产时，托管人应尽快通知基金管理人。双方理解在全球托管模式下，现金存入现金账户时构成境外托管人的等额债务，除非法律法规及撤销或清盘程序明文规定该等现金不归于清算财产外。

2、基金合同生效前募集资金的验资和入账

（1）基金募集期间的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人以基金管理人的名义开立并管理。

（2）基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。

（3）若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金的银行账户的开设和管理

（1）基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

（3）本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金银行账户的开立和管理应符合账户所在国或地区法律法规及监管机构的有关规定。

4、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在相关法规规定范围内的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

5、基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

（1）基金托管人应当代表本基金，在基金所投资市场的交易所或登记结算机构或境外托管人处，按照该交易所或登记结算机构的业务规则开立证券账户。基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

（2）本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

（4）在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

（5）除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）。

（6）基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

6、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，由基金管理人负责向中国人民银行报备，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；在上述手续办理完毕之后，基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。

7、其他账户的开设和管理

（1）因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或境外托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

（2）投资市场所在国家或地区法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

8、基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

基金托管人可在以下情况下同意就在境外发行的实物证券（以下简称“实物证券”）提供保管服务，但需取决于该市场上是否有此类服务：

（1）基金管理人应在实物证券交付之前将相关证券的价值、到期日、要素等其他基金托

管人需要的信息告知基金托管人。基金托管人不负责为证券从对方运送至基金托管人的途中安排保险或运输。如基金管理人确需基金托管人安排保险或运输时，双方可另行协商。当基金托管人被要求交付此类证券时，基金托管人会安排适当的运输。经基金管理人申请，基金托管人可安排适当保险。在实物证券交付过程中产生的保险费（如有）、运输费及其他合理费用将由基金管理人支付。

（2）双方同意，如果实物证券在由基金托管人交付给运输服务提供商的过程中发生丢失或损坏，托管人只对因自身过失或过错造成的直接损失负责，但托管人应协助管理人从运输服务提供商处或保险公司处追回损失。

（3）对于不以托管人名义持有的受限实物证券，有关公司行动的信息可能会被延误或不能从普遍认可的行业信息来源处获得，托管人不能保证此等信息的完整性和准确性，与此证券有关的支付可能会被延迟。相应地，托管人与受限实物证券有关的、及时代收支付款并将完整准确的公司行动信息转达给管理人的能力是受到与此类证券有关的行业和市场惯例制约的。托管人仅在实际收到有关此类公司行动信息，且没有因发行方及其顾问或其他有关各方所设的限定条件而被阻止参与此类公司行动的情况下，才为受限实物证券服务。在不违反此款规定的前提下，托管人仍应尽合理努力获取该类信息。

9、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管，保管期限按照法律法规的规定执行。

对于无法取得两份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同复印件，并确保复印件与原件一致。未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

（五）基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值的计算和复核

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。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。

（2）基金管理人应每个估值日的下一个工作日对基金财产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日的下一个工作日计算得出该估值日的基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（3）当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

（5）当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

（6）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，基金管理人和基金托管人分别承担相应赔偿责任，其中基金托管人承担未正确履行复核义务的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（7）由于不可抗力，或证券、期货交易所、外汇交易市场、指数编制机构、登记结算公司、第三方估值基准服务机构、存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏等原因，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（8）如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

（9）管理人所投资品种，应提前与托管人沟通，确保拟投资品种在双方业务系统支持范围内。对于不在托管人业务系统支持范围内的新投资品种，管理人应为托管人预留足够的系

统准备时间，并在必要时与托管人进行系统联合测试。同时管理人需提供该投资品种的会计核算方法，并与托管人协商一致，托管人以该会计核算方法为依据进行相关业务系统的准备工作。

（10）对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

（11）全球投资涉及不同市场及时区，由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在基金管理人和基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。

2、基金会计核算

（1）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

（2）会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

（3）基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书的信息在《基金合同》生效后发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上。基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后两个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后三个月内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供给基金托管人复核，基金托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人；基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

（六）基金份额持有人名册的保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

（1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；

（2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；

（3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；

（4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

2、基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

3、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于20年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

（七）适用法律与争议解决方式

1、本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

2、基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，应将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁双方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

3、除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

（八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）本基金更换基金托管人；

（3）本基金更换基金管理人；

（4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

3、基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

二十四、对基金份额持有人的服务

对基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构及申购赎回代理券商提供，以下是基金管理人提供的主要服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，基金管理人不承担任何责任。

（一）客户服务中心电话及在线服务

1、电话服务

投资人拨打基金管理人客户服务中心热线 400-888-0001 可享有如下服务：

（1）自助语音服务（7×24 小时）：提供基金净值信息、账户信息等自助查询服务。

（2）人工服务：提供交易日上午 9：00-11：30 下午 13：00-17：30 的人工服务。投资人可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

2、在线服务

投资人通过基金管理人网站、微信公众号或 APP 客户端提供交易日上午 9：00-11：30 下午 13：00-17：30 的在线服务人工服务。投资人可通过该方式获得业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

（二）投诉及建议受理服务

投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线、在线客服、书信、电子邮件、短信及各销售机构网点柜台等不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

（三）联系基金管理人

1、网址：www.huatai-pb.com

2、客服邮箱：cs4008880001@huatai-pb.com

3、客服热线：400-888-0001（免长途话费），或 021-38784638

4、传真：021-50103016

5、联系地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

（四）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请及时通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解本招募说明书，并同意全部内容。

二十五、其他应披露事项

本基金及基金管理人的有关公告（自 2025 年 10 月 09 日至 2026 年 10 月 12 日），下列公告在指定媒介披露：

公告名称	披露日期
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2026 年中期报告	2026-08-29
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2026-08-06
华泰柏瑞基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	2026-07-24
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2026 年第 2 季度报告	2026-07-21
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	2026-06-25
华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	2026-06-25
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2026-06-12
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2026-06-06
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-06-01
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-05-29
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2026 年第 1 季度报告	2026-04-22
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-04-16
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-04-10
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-04-09
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-04-08
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年年度报告	2026-03-31
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2026-03-27
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-03-19
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-03-18
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	2026-03-18
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风	2026-03-17

险提示公告	
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金变更基金简称的公告	2026-03-17
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	2026-03-17
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-03-11
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2026-03-05
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2026-02-27
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2026-02-25
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2026-01-26
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年第 4 季度报告	2026-01-22
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）2026 年境外主要市场节假日和非交易日申购赎回安排的公告	2026-01-13
华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	2026-01-10
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	2026-01-09
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	2025-12-25
华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范以教育机构退费”为由诱导转账诈骗的公告	2025-12-09
华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	2025-12-02
华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒公司名义从事非法活动的公告	2025-11-20
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书	2025-11-17
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金产品资料概要更新	2025-11-17
华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	2025-11-15
华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	2025-10-29
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2025 年第 3 季度报告	2025-10-28
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2025-10-27
华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII）二级市场交易价格溢价风险提示公告	2025-10-22
华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新的招募说明书	2025-10-22

二十六、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所和基金上市交易的证券交易所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十七、备查文件

（一）中国证监会准予华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的文件；

（二）《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

（三）《华泰柏瑞南方东英新交所泛东南亚科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；

（四）法律意见书；

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（七）中国证监会要求的其他文件。

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可在营业时间前往相应场所免费查阅，也可按工本费购买复印件。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇二六年十月二十四日