

银河上证国有企业红利交易型开放式指数
证券投资基金
上市交易公告书

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市日期：2024年11月12日

公告日期：2024年11月7日

目 录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的募集与上市交易.....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要.....	11
七、基金财务状况.....	12
八、基金投资组合.....	13
九、重大事件揭示.....	17
十、基金管理人承诺.....	17
十一、基金托管人承诺.....	17
十二、基金上市推荐人意见.....	18
十三、备查文件目录.....	18
附件：基金合同摘要.....	20

一、重要声明与提示

《银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”或“本上市交易公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人银河基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人广发证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2024年8月29日登载于《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）及本基金管理人网站（www.cgf.cn）的本基金招募说明书。

二、基金概览

- 1、基金名称：银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金二级市场交易简称：上证红利（扩位证券简称：红利ETF国企）。
- 3、基金二级市场交易代码：530880。
- 4、截至公告日前两个工作日（即2024年11月5日）基金份额总额：561,836,000.00份。
- 5、截至公告日前两个工作日（即2024年11月5日）基金份额净值：1.0078元。
- 6、本次上市交易份额：561,836,000.00份。

- 7、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 8、上市交易日期：2024年11月12日。
- 9、基金管理人：银河基金管理有限公司。
- 10、基金托管人：广发证券股份有限公司。
- 11、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。
- 12、上市推荐人：国信证券股份有限公司。

13、本基金的申购、赎回代办证券公司（以下简称“一级交易商”）为：中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司。

本基金管理人可根据情况变更一级交易商，并及时公告或在基金管理人网站公示。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可〔2024〕1042号文。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：本基金自2024年9月2日起至2024年10月25日止（法定节假日不受理，下同）公开发售，其中，网上现金认购日期为2024年10月23日至2024年10月25日，网下现金认购日期为2024年9月2日至2024年10月25日。

5、发售价格：人民币1.00元。

6、发售期限：网上现金发售3个工作日，网下现金发售33个工作日。

7、发售方式：网上现金认购和网下现金认购2种方式。

8、发售机构

（1）网下现金发售直销机构

银河基金管理有限公司。

(2) 网下现金发售代理机构

中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司。

(3) 网上现金发售代理机构

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

9、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10、募集资金总额及入账情况

经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为 561,836,000.00 元人民币。认购资金在募集期间产生的利息为 104,682.47 元人民币，全部为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产生的利息，计入基金资产，不折算为投资人基金份额。本次募集资金已于 2024 年 10 月 30 日全额划入本基金托管账户。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产生的利息预计于 2024 年四季度结息日后划入基金托管专户。

本基金募集期间的实收资金合计为 561,836,000.00 元人民币，折算成基金份额共计 561,836,000.00 份，有效认购户数为 4,975 户（以基金登记机构计算并确认的结果为准）。

11、基金合同生效

根据《基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并获得中国证监会书面确认，基金合同自 2024 年 10 月 30 日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

(二) 本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书〔2024〕146 号。

2、上市交易日期：2024 年 11 月 12 日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：上证红利（扩位证券简称：红利ETF国企）。

5、基金二级市场交易代码：530880。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

6、投资人应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。目前本基金的一级交易商包括：中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司。

7、本次上市交易份额：561,836,000.00份。

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

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至公告日前两个工作日（即2024年11月5日），本基金基金份额持有人户数为4,975户，平均每户持有的基金份额为112,931.86份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日（即2024年11月5日），本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的本基金基金份额为50,992,000.00份，占基金总份额的9.08%；个人投资者持有的本基金基金份额为510,844,000.00份，占基金总份额的90.92%。

（三）前十名持有人

截至公告日前两个工作日（即2024年11月5日），本基金前十名基金份额持有人情况如下：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额 （份）	占总份额比例
1	上海通怡投资管理有限公司— 通怡股票低波2号私募证券投资 基金	14,998,000.00	2.67%
2	浙江龙航资产管理有限公司— 龙航点金私募证券投资基金	7,000,000.00	1.25%
3	浙江龙航资产管理有限公司— 龙航二期私募证券投资基金	7,000,000.00	1.25%
4	浙江龙航资产管理有限公司— 龙航十五期私募证券投资基金	6,000,000.00	1.07%
5	珠海横琴绿竹企业管理合伙企 业（有限合伙）	6,000,000.00	1.07%
6	侯卫卫	4,593,000.00	0.82%
7	黄锐丰	3,000,000.00	0.53%
8	熊玲瑶	2,600,000.00	0.46%
9	吴旭彬	2,550,000.00	0.45%
10	蔡桂珍	2,000,000.00	0.36%
11	陈卫	2,000,000.00	0.36%
12	顾侠	2,000,000.00	0.36%
13	郭亚云	2,000,000.00	0.36%
14	胡隽鹏	2,000,000.00	0.36%
15	黄雪茹	2,000,000.00	0.36%
16	李焕芝	2,000,000.00	0.36%
17	李松文	2,000,000.00	0.36%
18	林嘉豪	2,000,000.00	0.36%
19	刘海燕	2,000,000.00	0.36%
20	刘洋	2,000,000.00	0.36%
21	卢伟东	2,000,000.00	0.36%

22	欧焕彬	2,000,000.00	0.36%
23	秦芸	2,000,000.00	0.36%
24	王加怀	2,000,000.00	0.36%
25	王少芳	2,000,000.00	0.36%
26	徐康宁	2,000,000.00	0.36%
27	袁钧辉	2,000,000.00	0.36%
28	张丽华	2,000,000.00	0.36%
29	张勤	2,000,000.00	0.36%
30	张振辉	2,000,000.00	0.36%
31	郑子凯	2,000,000.00	0.36%
32	周惠娟	2,000,000.00	0.36%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本情况

名称：银河基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路99号21-22层

法定代表人：胡泊

总经理：史平武

注册资本：2.0亿元人民币

设立批准文号：证监基金字[2002]21号

工商登记注册的营业执照统一社会信用代码：91310000MA1FL3DY6P

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理，中国证监会许可的其他业务

股权结构：截至本上市交易公告书公告日，本基金管理人股权结构如下：

股东名称	持股比例
中国银河金融控股有限责任公司	50%
中国石油天然气集团有限公司	12.5%

上海城投（集团）有限公司	12.5%
首都机场集团有限公司	12.5%
湖南电广传媒股份有限公司	12.5%
合 计	100%

2、内部组织结构及职能

银河基金管理有限公司自成立以来，按照法律法规要求健全公司治理结构，建立权责清晰的经营组织架构，不断完善公司内部控制管理，确保公司规范稳健运营，有效维护基金份额持有人的合法权益。公司目前设置有 17 个一级部门，分别为股票投资部、固定收益部、量化与 FOF 投资部、基础设施与不动产投资部、专户投资部、研究部、机构业务部、渠道业务部、电子商务部、销售支持部、中央交易室、基金运营部、信息科技部、监察部、党委组织部/人力资源部、党委办公室/党建工作部/综合管理部、纪委办公室，并设立了北京分公司、广州分公司、上海营销中心从事区域市场营销工作。

3、人员情况

截至 2024 年 9 月 30 日，本基金管理人共有员工 192 人，其中 147 人具有硕士及以上学历，占员工总数的 76.56%。

4、信息披露负责人及咨询电话：秦长建，(021)38568888

5、基金管理业务情况

截至 2024 年 9 月 30 日，本基金管理人共管理 85 只证券投资基金，公募基金资产管理规模 1086.24 亿元。

6、本基金基金经理简介

黄栋先生，硕士研究生学历，CFA，18 年证券行业从业经历。曾先后就职于东方证券股份有限公司、工银瑞信基金管理有限公司、上投摩根基金管理有限公司、金鹰基金管理有限公司、人保资产管理有限公司，从事研究、投资相关工作。2021 年 10 月加入银河基金管理有限公司，现任量化与 FOF 投资部副总监（主持工作）、基金经理。2022 年 1 月起担任银河沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理，2023 年 10 月起担任银河君尚灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 11 月起担任银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 5 月起担任银河中证机器人指数发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 7 月起担任银河中证红利低波动 100 指数证

券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）的基金经理，2024年10月起担任银河中证通信设备主题指数发起式证券投资基金、银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：广发证券股份有限公司（简称：广发证券）

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼

法定代表人：林传辉

成立时间：1994年1月21日

基金托管资格批文及文号：证监许可〔2014〕510号

注册资本：人民币7,621,087,664元

存续期间：长期

信息披露联系人：罗琦

联系电话：020-66338888

广发证券是国内首批综合类证券公司，先后于2010年和2015年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所有限公司主板上市（股票代码：000776.SZ，1776.HK）。截至2023年12月31日，公司共设立证券营业部323家。

广发证券具有完备的业务体系、均衡的业务结构，突出的核心竞争力。拥有投资银行、财富管理、交易及机构和投资管理四大业务板块，具备全业务牌照。锻造综合金融服务实力，主要经营指标连续多年稳居中国券商前列，在多项核心业务领域中形成了领先优势，研究、资产管理、财富管理等位居前列。截至2023年12月31日，集团总资产6,821.82亿元，归属于上市公司股东的所有者权益为1,357.18亿元，2023年营业收入为233.00亿元，营业利润为87.95亿元，归属于上市公司股东的净利润为69.78亿元。

2、主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘洋先生于2000年7月获得北京大学理学学士，并于2003年7

月获得北京大学经济学硕士学位。

广发证券资产托管部主要人员均具备多年基金、证券、银行等金融机构从业经历或会计师事务所审计经验，从业经验丰富，具备基金从业资格，熟悉基金托管工作。资产托管部员工学历均在本科以上，专业背景涵盖了金融、法律、会计、统计、计算机等领域，是一支诚实勤勉、积极进取的专业从业人员队伍。

3、基金托管业务经营情况

广发证券于 2014 年 5 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。截至 2023 年 12 月 31 日，广发证券托管的公开募集证券投资基金共 63 只。

（三）基金上市推荐人

公司名称：国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：张纳沙

联系人：邱芑

联系电话：95536

（四）基金验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

法定代表人：邹俊

联系电话：+86(10)85085000

传真：+86(10)85185111

经办注册会计师：叶凯韵、汪霞

联系人：汪霞

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

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

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

截至公告前两个工作日（即 2024 年 11 月 5 日），本基金的资产负债表如下（未经审计）：

银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金

2024 年 11 月 5 日资产负债表

金额单位：人民币元

资产	截至 2024 年 11 月 5 日	负债和所有者权益	截至 2024 年 11 月 5 日
资产：		负债：	
银行存款	278,982,363.67	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	287,183,337.85	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	287,183,337.85	应付清算款	-
基金投资	-	应付赎回款	-
债券投资	-	应付管理人报酬	34,594.09
资产支持 证券投资	-	应付托管费	7,687.57
贵金属投资	-	应付销售服务费	-
其他投资	-	应付投资顾问费	-
衍生金融资产	-	应交税费	-
买入返售金融资产	-	应付利润	-
债权投资	-	递延所得税负债	-
其中：债券投资	-	其他负债	6,111.14
资产支持 证券投资	-	负债合计	48,392.80
其他投资	-	净资产：	
其他债权投资	-	实收基金	561,836,000.00

其他权益工具投资	-	其他综合收益	-
应收清算款	-	未分配利润	4,385,991.19
应收股利	-	净资产合计	566,221,991.19
应收申购款	104,682.47	负债和净资产总计	566,270,383.99
递延所得税资产	-		
其他资产	-		
资产总计	566,270,383.99		

注：报告截止日 2024 年 11 月 5 日，本基金份额净值：1.0078 元，本基金份额总额：561,836,000.00 份。

八、基金投资组合

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

截至公告前两个工作日（即 2024 年 11 月 5 日），本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	287,183,337.85	50.71
	其中：股票	287,183,337.85	50.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	278,982,363.67	49.27
8	其他各项资产	104,682.47	0.02
9	合计	566,270,383.99	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

1、积极投资按行业分类的股票投资组合

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有积极投资的股票。

2、指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	82,553,067.00	14.58
C	制造业	24,275,988.00	4.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,067,045.90	1.95
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	36,113,780.00	6.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	92,193,271.00	16.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,930,825.00	2.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	24,049,360.95	4.25
S	综合	-	-
	合计	287,183,337.85	50.72

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

1、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投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	358,600	14,713,358.00	2.60
2	601225	陕西煤业	547,000	13,718,760.00	2.42
3	601000	唐山港	3,096,400	13,562,232.00	2.40
4	601006	大秦铁路	1,754,100	11,664,765.00	2.06
5	601077	渝农商行	1,947,400	11,197,550.00	1.98
6	601328	交通银行	1,539,500	11,192,165.00	1.98
7	600461	洪城环境	1,142,110	11,067,045.90	1.95

8	600901	江苏金租	2,010,700	10,897,994.00	1.92
9	600350	山东高速	1,208,300	10,886,783.00	1.92
10	601288	农业银行	2,238,700	10,745,760.00	1.90

2、积极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投资明细

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有积极投资的股票。

（四）按债券品种分类的债券投资组合

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有债券。

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有债券。

（六）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资
 明细

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有资产支持证券。

（七）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有贵金属。

（八）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有权证。

（九）本基金投资的股指期货交易情况说明

1、本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有股指期货。

（十）本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有国债期货。

（十一）投资组合报告附注

1、截至 2024 年 11 月 5 日，本基金投资的前十名证券的发行主体（除“交通银行”、“农业银行”、“重庆农商行”公告自身或分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

交通银行及其分支机构因贷款三查不到位，贷前调查不尽职、换领金融许可证未按规定公告、票据业务办理不审慎、违反外汇登记管理规定、小微业务统一

授信管理不到位等，受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局等监管机构警告、罚款、公开处罚。

农业银行及其分支机构因贷款三查不到位，贷前调查不尽职、因管理不善导致许可证遗失、流动资金贷款被用于固定资产投资、不良资产转让流程问题整改不到位、小微企业划型不准确、审计人员配备不足问题未整改等，受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局黑龙江省分局等监管机构警告、罚款、公开处罚。

重庆农商行下属分支机构因贷款“三查”不尽职、监控不力贷款资金被挪用、贷款资金回流借款人等受到国家金融监督管理总局合川监管分局罚款处罚。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

2、本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	104,682.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	-

4、本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2024 年 11 月 5 日，本基金未持有积极投资的股票。

九、重大事件揭示

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

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

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

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

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

十一、基金托管人承诺

广发证券股份有限公司担任本基金的基金托管人，在本基金上市之后将切实履行托管人职责，并做出以下承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

(二) 根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计

提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规规定、基金合同、基金托管协议约定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下:

(一)本基金上市符合《基金法》《上海证券交易所证券投资基金上市规则》及《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》规定的相关条件;

(二)本基金上市文件真实、准确、完整,符合相关法规的要求。

十三、备查文件目录

(一) 备查文件目录

1、中国证监会准予银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金注册的文件

2、《银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4、《银河上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

5、法律意见书

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、基金托管人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

(三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

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

银河基金管理有限公司

二〇二四年十一月七日

附件：基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

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

(11) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利、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》及有关法律的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；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规、相关证券交易所及登记机构相关业务规则的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、基金交易和非交易过户等业务规则；
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、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、赎回对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

(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前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期满未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息（税后）在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；投资者以股票认购的，相关股票的解冻和退还将按照有关规定处理；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利、义务

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

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户和资金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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户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，但向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(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份额持有人、基金管理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，并通知基金管理人；

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

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

鉴于本基金和联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金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的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

基金的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的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，按照相关法律法规的要求执行。

（一）召开事由

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

- （1）终止《基金合同》；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

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

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

- （1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

- (2) 调低基金管理费、基金托管费及其他应由基金承担的费用；
- (3) 调整本基金的申购费率、变更或增加收费方式；
- (4) 因相应的法律法规、上海证券交易所或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；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；
- (7) 本基金推出新业务或服务；
- (8) 调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；
- (9) 调整申购赎回清单的计算和公告时间或频率、依照《基金合同》约定进行基金份额折算；
- (10) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置、申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市、开通场外申购赎回方式、跨系统转托管等业务或暂停、停止场外申购赎回业务；
- (11) 本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；
- (12) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联

系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非书面方式由基金份额持有人向其授权代表进行授权，具体方式在会议通知中列明。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会并进行表决，具体方式在会议通知中列明，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修

改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

(六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

在符合上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理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异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席

大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，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、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

- 1、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金的收益分配方式为现金分红；
- 3、本基金收益每年最多分配 12 次。在符合以下有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配并确定每次基金收益分配的标准、数额等，具体分配方案以届时的公告为准：

（1）基金管理人每月最后一个交易日（即收益评价日）对基金相对标的指数的超额收益率以及基金的可供分配利润进行一次评估，当超额收益率达到 0.01%以上或者每 10 份基金份额可供分配利润金额高于 0.001 元（含）时，本基金可进行收益分配，且收益分配基准日与收益评价日为同一天，其中，超额收益率=基金份额净值增长率-标的指数同期增长率。在收益评价日，基金管理人基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法详见《招募说明书》；

（2）当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机构、证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）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。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、除法律法规、中国证监会另有规定外，《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 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、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、基金的上市费及年费、场内注册登记费用、IOPV 计算与发布费用、收益分配中发生的费用；
- 10、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 0.45% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.45\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起第 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支

付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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第 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、上述“（一）基金费用的种类”中第 3—10 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、标的指数许可使用费。标的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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、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、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与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。

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

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

（3）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

(5) 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%;

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

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

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

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

(10) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%;

(11) 本基金参与股指期货和国债期货投资,需遵守下述比例限制:

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

2) 本基金在任何交易日日终,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、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

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

4) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额

不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；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%；

5) 每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

6) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

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

(13) 本基金参与转融通证券出借业务应遵守下列要求：

1) 本基金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《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

2) 本基金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) 本基金最近 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、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(14) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（6）、（8）、（9）、（13）项情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符

合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

除标的指数成份股、备选成份股之外，基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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按变更后的规定执行。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 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。

(二) 估值方法

1、证券交易所上市的权益类证券的估值

(1) 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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市不存在活跃市场的权益类证券，采用估值技术确定公允价值。

2、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；

(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。

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

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

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应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）后未行使回售权的建议按照长待偿期所对应的价格进行估值。

5、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。

6、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，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其公允价值。

7、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

8、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

9、存入银行或其他金融机构的各种款项以本金列示，按协议或约定利率逐日确认利息收入。

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

11、本基金参与融资和转融通证券出借等业务的，按照相关法律法规、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。

12、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

13、本基金可以采用第三方估值基准服务机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

14、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。

15、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，按照

基金管理人对外予以公布。

（三）基金净值信息的公告方式

《基金合同》生效后，在基金份额上市交易前且在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或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，在履行适当程序后变更并公告。

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

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求以及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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）聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上，法律法规另有规定的从其规定。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商、调解未能解决的，应当将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方当事人应恪守职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国（为本基金合同之目的，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区）法律管辖并从其解释。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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