

**华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金  
上市交易公告书**

**基金管理人： 华泰柏瑞基金管理有限公司**

**基金托管人： 招商证券股份有限公司**

**上市时间： 2021年3月24日**

**公告日期： 2021年3月19日**

## 目 录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	2
三、基金的募集与上市交易.....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、基金主要当事人简介.....	7
六、基金合同摘要.....	14
七、基金财务状况（未经审计）.....	17
八、基金投资组合.....	18
九、重大事件揭示.....	21
十、基金管理人承诺.....	21
十一、基金托管人承诺.....	23
十二、基金上市推荐人意见.....	24
十三、备查文件目录.....	25
<b>附录：基金合同摘要</b> .....	<b>26</b>

## 一、重要声明与提示

华泰柏瑞中证1000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“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）托管人招商证券股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容，请详细阅读2021年3月2日披露在基金管理人网站([www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com))和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)上的《华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：华泰柏瑞中证1000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：中证1000（扩位简称：1000ETF基金）
- 3、二级市场交易代码：516300
- 4、基金申购、赎回简称：中证1000
- 5、申购、赎回代码：516301
- 6、截止公告日前两个工作日即2021年3月17日基金份额总额：  
222,602,182.00 份
- 7、截止公告日前两个工作日即2021年3月17日基金份额净值：1.0004元
- 8、本次上市交易份额：222,602,182.00 份
- 9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 10、上市交易日期：2021年3月24日
- 11、基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司
- 12、基金托管人：招商证券股份有限公司
- 13、上市推荐人：申万宏源证券有限公司
- 14、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：华西证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、申万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、东吴证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、浙商证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、信达证券股份有限公司。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将在基金管理人网站公示。本公司可根据情况变更申购赎回代办券商，并及时在基金管理人网站公示。

### 三、基金的募集与上市交易

#### (一) 本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2021]235 号。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期为 2021 年 3 月 5 日至 2021 年 3 月 9 日。其中，网下现金发售的日期为 2021 年 3 月 5 日至 2021 年 3 月 9 日，网上现金发售的日期为 2021 年 3 月 5 日至 2021 年 3 月 9 日，网下股票认购的日期为 2021 年 3 月 5 日至 2021 年 3 月 9 日。

5、发售价格：1.00 元人民币。

6、发售期限：网上现金发售、网下现金发售、网下股票发售均为 3 个工作日。

7、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购。

#### 8、发售机构

##### (1) 网上现金发售代理机构

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询。

##### (2) 网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构

华泰柏瑞基金管理有限公司

##### (3) 网下现金发售代理机构

东北证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、招商证券股份有限公司

##### (4) 网下股票发售代理机构

东北证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、光大证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、招商证券股份有限公司

## (二) 基金合同生效

截至2021年3月9日本基金募集工作顺利结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集确认的募集金额总额为222,602,182.00元人民币（含所募集股票市值），折合基金份额222,602,182.00份；其中募集期间认购资金利息折合基金份额的共计1,632.00份。募集资金已于2021年3月15日全额划入本基金在基金托管人招商证券股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为1,392户，按照每份基金份额初始面值人民币1.00元计算，本次募集期间有效认购份额（含所募集股票市值）和利息结转的基金份额合计222,602,182.00份，已全部计入相应基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。本基金管理人及本公司的基金从业人员认购本基金基金份额1000.00份。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2021年3月15日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

## (三) 基金上市交易

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[2021]118号。

2、上市交易日期：2021年3月24日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：中证1000（扩位简称：1000ETF基金）。

5、二级市场交易代码：516300。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本基金的二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：中证1000。

7、申购、赎回代码：516301。

本基金管理人自2021年3月24日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者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：

序号	券商名称	客服电话	公司网址
1	华西证券股份有限公司	95584	www.hx168.com.cn
2	国信证券股份有限公司	95536	www.guosen.com.cn
3	恒泰证券股份有限公司	(0471) 4961259	www.cnht.com.cn
4	南京证券股份有限公司	95386	www.njqz.com.cn
5	第一创业证券股份有限公司	400-888-1888	www.firstcapital.com.cn
6	华创证券有限责任公司	0851-960872	www.hczq.com
7	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
8	中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinastock.com.cn
9	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com
10	国泰君安证券股份有限公司	95521	www.gtja.com
11	方正证券股份有限公司	95571	www.foundersc.com
12	安信证券股份有限公司	400-800-1001	www.essence.com.cn
13	中泰证券股份有限公司	95538	www.zts.com.cn
14	海通证券股份有限公司	95553	www.htsec.com
15	中信证券（山东）有限责任公司	95548	sd.citics.com
16	申万宏源证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
17	中信证券股份有限公司	95548	www.cs.ecitic.com
18	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
19	东兴证券股份有限公司	400-888-8993	www.dxzq.net
20	光大证券股份有限公司	95525	www.ebscn.com
21	东北证券股份有限公司	95360	www.nescn.cn
22	湘财证券股份有限公司	95351	www.xcsc.com
23	申万宏源西部证券有限公司	400-800-0562	www.swhysc.com
24	东吴证券股份有限公司	400-860-1555 或 96288	www.dwzq.com.cn
25	兴业证券股份有限公司	400-888-8123	www.xyzq.com.cn
26	中信证券华南股份有限公司	95396	www.gzs.com.cn
27	华鑫证券有限责任公司	95323 或 400-109-9918	www.cfsc.com.cn
28	浙商证券股份有限公司	(0571) 95345	www.stocke.com.cn
29	天风证券股份有限公司	400-800-5000	www.tfzq.com
30	信达证券股份有限公司	95321	www.cindasc.com

8、本次上市交易份额：222,602,182.00份。

9、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2021年3月17日，本基金份额持有人户数为1,392户，平均每户持有的基金份额为159,915.36份。

### （二）持有人结构

截至2021年3月17日，本基金份额持有人结构如下：机构投资者持有的基金份额为167,804,094.00份，占基金总份额的75.38%；个人投资者持有的基金份额为54,798,088.00份，占基金总份额的24.62%。

### （三）前十名基金份额持有人的情况

截至2021年3月17日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	中信证券股份有限公司	30,000,000.00	13.48%
2	方正中期期货有限公司	20,001,166.00	8.99%
3	华泰证券股份有限公司	20,000,462.00	8.98%
4	上海伴兴实业发展有限公司	20,000,000.00	8.98%
5	上海东证期货有限公司	10,000,000.00	4.49%
6	东兴证券股份有限公司	8,000,466.00	3.59%
7	申万宏源证券有限公司	8,000,000.00	3.59%
8	中国银河证券股份有限公司	8,000,000.00	3.59%
9	光大证券股份有限公司	7,500,000.00	3.37%
10	招商证券股份有限公司	7,000,000.00	3.14%
11	方正证券股份有限公司	7,000,000.00	3.14%
12	中信建投证券股份有限公司	7,000,000.00	3.14%



## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

1、名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

2、注册地址：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

3、法定代表人：贾波

4、总经理：韩勇

5、成立日期：2004 年 11 月 18 日

6、批准设立机关：中国证券监督管理委员会

7、批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

8、工商登记注册的法人营业执照文号：913100007178517770

9、经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

10、组织形式：有限责任公司

11、注册资本：贰亿元人民币

12、存续期间：持续经营

13、信息披露负责人：陈晖

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

14、股权结构：PineBridge Investments LLC（柏瑞投资有限责任公司）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%。

### 15、内部组织结构及职能：

公司设立了权益投资决策委员会、固定收益投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。权益投资决策委员会和固定收益投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

目前，公司下设 28 个部门，并在北京、深圳分别设立了分公司。

投资研究部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的股票研究和投资。

固定收益部：负责公司固定收益的投资管理。

专户理财部：负责专户的理财管理。

专户投资部：负责专户的投资管理。

指数投资部：负责指数研究、设计和开发工作，以及进行指数产品的投资管理。

量化与海外投资部：负责量化和海外 QDII 产品的投资管理。

交易部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行交易指令执行与监督。

华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心深圳分公司、华北营销中心北京分公司、西南营销中心：负责基金销售。

机构业务部（北京）、机构业务部（上海）、机构业务部（深圳）：负责机构客户的业务拓展。

券商业务部：负责券商客户的业务拓展。

市场营销部：负责公司品牌、基金产品的市场推广服务。

销售管理部：负责对外开拓维护渠道总部，对内管理服务渠道销售人员。

客户服务部：负责公司的客户服务。

产品与业务发展部：负责基金产品研发等新业务拓展。

基金事务部：负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。

信息技术部：负责公司信息系统的日常运行与开发。

电子商务部：负责线上营销业务的业务开展。

合规法律部：负责内部法律事务咨询，处理外部法律事务，检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况，负责定期评估公司内部控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。

风险管理部：负责投资、交易环节风险提示及控制，研究公司风险管理政策与方针，协调各部门处理公司层面风险事项。

人力资源部：负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。

综合管理部：负责公司后勤服务、公文档案管理。

财务部：负责公司财务事项。

## 16、人员情况：

截至 2021 年 3 月 15 日，本公司共有员工 245 人。其中，投资研究团队共有人员 69 名，全公司取得基金从业资格的有 224 人。公司高级管理人员和从事研

究、投资、估值、营销、监察稽核等业务的主要业务人员都已取得基金从业资格。在所有公司人员中，研究生及以上学历共有 175 人，占 71%；本科学历 60 人，占 24%。

#### 17、基金管理业务情况简介：

截至 2020 年 12 月 31 日，公司旗下管理 77 只开放式基金，其中包括 16 只指数和指数联接基金，1 只主动股票型基金，43 只混合型基金，13 只债券型基金，3 只货币型基金和 1 只 QDII 基金。我司旗下管理的开放式基金包括华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深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、华泰柏瑞量化创优灵活配置混

合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、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、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、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、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、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、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金。

截至 2020 年 12 月 31 日，公司管理的基金资产规模为 1,622.89 亿元，总份额规模为 1,000.70 亿份。

#### 18、本基金基金经理：

李茜女士：伦敦政治经济学院金融数学硕士。曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 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。2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证

中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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 12 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、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起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 2 月起任华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 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、基金托管人基本情况

名称：招商证券股份有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

成立时间：1993 年 8 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：66.99 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2014]78 号

联系人：韩鑫普

联系电话：0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业，经过二十多年创业发展，已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商，并经中国证券监督管理委员会评定为 A 类 AA 级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道，在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 249 家批准设立的证券营业部和 12 家证券经纪业务管理分公司，同时在香港设有分支机构，全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司，参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、广东股权交易中心股份有限公司及证通股份有限公司，构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力，打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实

现客户价值增长，推动证券行业进步，立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构，成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

## 2、基金托管部门及主要人员情况

招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验，以及大型 IT 公司的软件设计与开发经验，人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，其中本科以上学历占比 100%，高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

## 3、证券投资基金托管情况

招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司，可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施，稳定、高效的托管业务系统，完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实守信、谨慎勤勉”的原则，为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外，招商证券于 2012 年 10 月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复，成为业内首家可从事私募托管业务的券商，经验丰富，服务优质，业绩突出。截至 2020 年三季度，招商证券共托管 39 只公募基金。

## 4、托管业务的内部控制制度

### (1) 内部控制目标

招商证券作为基金托管人：

1) 托管业务的经营运作遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

2) 建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务内部控制制度健全、执行有效。

3) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，使托管业务稳健运行和受托资产安全完整，实现托管业务的持续、稳定、健康发展。

4) 不断改进和完善内控机制、体制和各项业务制度、流程，提高业务运作效率和效果。

### (2) 内部控制组织结构

招商证券股份有限公司经营管理层面设立了风险管理委员会。作为公司内部最高风险决策机构，风险管理委员会负责审议公司风险管理政策、风险偏好、容

忍度和经济资本等风险限额配置方案，拥有公司重大风险业务和创新业务项目的最终裁量权。风险管理部、法律合规部及稽核部为公司的风险管理职能部门。

托管部内部设置专门负责稽核工作的内控稽核岗，配备专职稽核人员，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使监督稽核职权。

### （3）内部控制制度及措施

招商证券托管部制定了各项管理制度和操作规程，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，保持托管业务健全、有效执行；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；实行经营场所封闭式管理，并配备录音和录像监控系统；有独立的综合托管服务系统；业务管理实行复核和检查机制，建立了严格有效的操作制约体系；托管部树立内控优先和风险管理的理念，培养部门全体员工的风险防范和保密意识。

## 5、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （1）监督方法

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行监督，并及时提示基金管理人违规风险。

### （2）监督程序

基金托管人发现基金管理人投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在限期内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）上市推荐人

申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：杨玉成

联系人：黄莹

电话：（021）33389888

传真：（021）33388224

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

#### （四）一级交易商

序号	券商名称	客服电话	公司网址
1	华西证券股份有限公司	95584	www.hx168.com.cn
2	国信证券股份有限公司	95536	www.guosen.com.cn
3	恒泰证券股份有限公司	(0471) 4961259	www.cnht.com.cn
4	南京证券股份有限公司	95386	www.njzq.com.cn
5	第一创业证券股份有限公司	400-888-1888	www.firstcapital.com.cn
6	华创证券有限责任公司	0851-960872	www.hczq.com
7	华泰证券股份有限公司	95597	www.htsc.com.cn
8	中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinastock.com.cn
9	中信建投证券股份有限公司	400-888-8108	www.csc108.com
10	国泰君安证券股份有限公司	95521	www.gtja.com
11	方正证券股份有限公司	95571	www.foundersc.com
12	安信证券股份有限公司	400-800-1001	www.essence.com.cn
13	中泰证券股份有限公司	95538	www.zts.com.cn
14	海通证券股份有限公司	95553	www.htsec.com
15	中信证券（山东）有限责任公司	95548	sd.citics.com
16	申万宏源证券有限公司	95523 或 4008895523	www.swhysc.com
17	中信证券股份有限公司	95548	www.cs.ecitic.com
18	广发证券股份有限公司	95575	www.gf.com.cn
19	东兴证券股份有限公司	400-888-8993	www.dxzq.net
20	光大证券股份有限公司	95525	www.ebscn.com
21	东北证券股份有限公司	95360	www.nesc.cn
22	湘财证券股份有限公司	95351	www.xcsc.com
23	申万宏源西部证券有限公司	400-800-0562	www.swhysc.com
24	东吴证券股份有限公司	400-860-1555 或 96288	www.dwzq.com.cn
25	兴业证券股份有限公司	400-888-8123	www.xyzq.com.cn
26	中信证券华南股份有限公司	95396	www.gzs.com.cn
27	华鑫证券有限责任公司	95323 或 400-109-9918	www.cfsc.com.cn
28	浙商证券股份有限公司	(0571) 95345	www.stocke.com.cn
29	天风证券股份有限公司	400-800-5000	www.tfzq.com
30	信达证券股份有限公司	95321	www.cindasc.com

#### （五）基金验资机构

机构名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

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



办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：张炯、朱宏宇

联系人：朱寅婷

联系电话：（021）23238888

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至本公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金截至2021年3月17日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资 产：		负 债：	
银行存款	221,551,632.00	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	955,950.00	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	955,950.00	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	6,099.36
基金投资	-	应付托管费	1,219.87
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	-
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	29,915.09	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	1,849.32
其他资产	171,422.23	负债合计	9,168.55
		所有者权益：	
		实收基金	222,602,182.00
		未分配利润	97,568.77
		所有者权益合计	222,699,750.77
资产合计：	222,708,919.32	负债与持有人权益总计：	222,708,919.32

注：1、截至2021年3月17日，基金份额净值1.0004元，基金份额总额222,602,182.00份。

2、本报告期自2021年3月15日起至2021年3月17日止。本基金合同于2021年3月15日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

## 八、基金投资组合

截至2021年3月17日，本基金的投资组合情况如下：

### （一）基金资产组合情况

项目	金额	占基金总资产的比例（%）
权益投资	955,950.00	0.43
其中：股票	955,950.00	0.43
固定收益投资	-	-
其中：债券	-	-
资产支持证券	-	-
金融衍生品投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
银行存款和结算备付金合计	221,551,632.00	99.48
其他各项资产	201,337.32	0.09
合计	222,708,919.32	100.00

### （二）按行业分类的股票投资组合

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	105,800.00	0.05
C	制造业	850,150.00	0.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	955,950.00	0.43

(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明细

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	300083	创世纪	40,000	505,600.00	0.23
2	300476	胜宏科技	15,000	344,550.00	0.15
3	000688	国城矿业	10,000	105,800.00	0.05

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

截止2021年3月17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

截止2021年3月17日, 本基金未持有债券。

(六) 投资组合报告附注

1、自本基金合同生效日至2021年3月17日, 本基金前十名证券的发行主体中无被监管部门立案调查的, 或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2、本基金投资的前十名股票中, 没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下:

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	应收股利	-
2	应收利息	29,915.09
3	其他资产	171,422.23
	合计	201,337.32

4、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细  
截止2021年3月17日，本基金未持有资产支持证券。

5、本报告期持有的处于转股期的可转换债券明细  
截止2021年3月17日，本基金未持有可转换债券。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差

## 九、重大事件揭示

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

基金管理人就本基金上市交易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

基金托管人就华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，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、基金合同的规定和约定，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、基金管理费的计提和支付、基金托管费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、基金合同的规定，将及时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。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人申万宏源证券有限公司。上市推荐人就本基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载资料均经过核实。

### 十三、备查文件目录

- (一) 中国证监会准予本基金注册的文件
- (二) 《华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 《华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- (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) 法律意见书。

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，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021年3月19日

## 附录：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) 基金管理人的权利与义务

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

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

(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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人，同时将已冻结的股票解冻；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包

括但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，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，为基金开设证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户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；但因监管机构、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) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务



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；
- (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(即“华泰柏瑞中证1000交易型开放式指数证券投资基金联接基金”, 以下简称“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基金份额持有人大会的, 须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会, 联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的, 由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会。

本基金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。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的, 应当召开基金份额持有人大会, 但法律法规、中国证监会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；
- (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、开放时间的调整等）；
- (6) 基金推出新业务或服务；

(7) 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开时，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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、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，并与基金登记注册机构记录相符。

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。

#### （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。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀



疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按照《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。

(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）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。

## （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## （四）收益分配中发生的费用

基金收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 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、指数许可使用费；

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

5、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；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的投资标的的交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、基金上市费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经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%年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经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5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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、指数许可使用费

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

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

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

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

### (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、指数许可使用费。指数许可使用费由基金管理人支付;
- 2、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;
- 3、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;
- 4、基金合同生效前的相关费用;
- 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。

本基金支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格,具体税率适用中国税务主管机关的规定。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### (一) 投资目标

紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。

### (二) 投资范围

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、

可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指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。

本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不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。

### （三）投资策略

#### 1、股票的投资策略

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股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及其权重的变动进行相应调整；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。

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，追求尽可能贴近目标指数的表现。

特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（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。

#### 2、存托凭证的投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 3、债券投资策略

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。

#### 4、股指期货的投资策略

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。

#### 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、融资及转融通证券出借业务

本基金还可以参与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。

### （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）本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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；

（3）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%；

（4）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%；

(5) 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%;

(6) 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%;

(7) 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;

(8) 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;

(9) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(10) 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;

(11) 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;

(12) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%;

(13) 本基金参与股指期货投资,需遵循下述比例限制:

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%;

2) 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

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%;

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%；

5) 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；

(14) 本基金可参与融资业务，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，需遵循下述比例限制：

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《流动性风险管理规定》所述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、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；

(16) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行，与内地上市交易的股票合并计算；

(17) 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

除上述（2）、（7）、（10）、（11）、（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以变更后的规定为准。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：



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

上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定，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中证1000指数。

中证1000指数由中证指数有限公司编制并发布，该指数由全部A股中剔除中证800指数成份股后，规模偏小且流动性好的1000只股票组成，综合反映中国A股市场中一批小市值公司的股票价格表现。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，进行适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中，若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并在通过之日起5日内报中国证监会备案且在规定媒介上刊登公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份

额持有人大会，基金管理人应在取得基金托管人同意后，报中国证监会备案，并在中国证监会规定媒介上公告。

#### （六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中证1000指数收益率。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，并在报中国证监会备案后及时公告。

#### （七）风险收益特征

本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

#### （八）基金管理人代表基金行使股东或债权人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股东或债权人权利，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。

#### 六、基金净值信息的计算方式和公告方式

##### （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、债券、股指期货合约和银行存款本息、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。

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、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（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）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

2、处于未上市期间的有价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、债券，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) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（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。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、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。

5、本基金投资股指期货合约，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。

6、本基金参与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。

7、本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

8、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。

9、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。

#### （五）估值程序

1、基金份额净值是按照每个交易日闭市后，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计算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对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值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。

### 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、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

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

## （四）清算费用

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

#### （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15年以上，法律法规或监管规则另有规定的，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，则任何一方有权将争议提交上海仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费和律师费由败诉方承担。

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

基金合同受中国法律（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。

### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

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