

山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金
上市交易公告书

山西证券股份有限公司

2020年4月3日

目录

一、 重要声明与提示	2
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	7
五、 基金主要当事人简介	8
六、 基金合同摘要	25
七、 基金财务状况	26
八、 基金投资组合	28
九、 重大事件揭示	31
十、 基金管理人承诺	32
十一、 基金托管人承诺书	33
十二、 基金上市推荐人意见	34
十三、 备查文件目录	35
附件：基金合同摘要	36

一、重要声明与提示

《山西证券中证红利潜力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”）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，山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人山西证券股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者阅读刊登在山西证券股份有限公司公募基金业务网站（<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>）上的《山西证券中证红利潜力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：山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金简称：山西证券中证红利潜力ETF
- 3、基金二级市场交易简称
 证券简称：山证红利
 扩位证券简称：山证红利ETF
- 4、二级市场交易代码：515570
- 5、截至公告日前两个工作日即2020年4月1日基金份额总额：264, 443, 862. 00份
- 6、截至公告日前两个工作日即2020年4月1日基金份额净值：0. 8791元
- 7、本次上市交易份额：264, 443, 862. 00份
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 9、上市交易日期：2020年4月9日
- 10、基金管理人：山西证券股份有限公司
- 11、基金托管人：中国银行股份有限公司
- 12、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 13、上市推荐人：海通证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司
- 14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：山西证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。
 本公司可根据情况变更申购赎回代理券商。

三、 基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可（2019）1596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：2019年12月23日至2020年1月9日。其中，网下现金发售和网下股票发售的日期为2019年12月23日至2020年1月9日，网上现金发售的日期为2020年1月7日至2020年1月9日。

5、发售价格：人民币1.00元。

6、发售期限：网下现金认购和网下股票认购13个工作日，网上现金认购3个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。

8、发售机构：

（1）网上现金发售代理机构：具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

（2）网下现金和网下股票发售直销机构：山西证券股份有限公司直销柜台

（3）网下现金发售代理机构、网下股票发售代理机构：山西证券股份有限公司营业部、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司（排名不分先后）

9、验资机构名称：中喜会计师事务所（特殊普通合伙）。

（二）基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可（2019）1596号文批准，自2019年12月23日起公开募集，截至2020年1月9日，基金募集工作已顺利结束。经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集期间净认购金额为264,440,071.00元，折合基金份额264,440,071.00份；通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金产生的利息为3,791.00元，折合基金份额为3,791.00份。上述募集资金共计人民币264,443,862.00元，折合264,443,862.00份基金份额。上述募集资金已于

2020年1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。

通过网上现金认购和发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金产生的利息为69,923.75元,已于2020年3月23日划入本基金托管账户,计入基金财产,不折算为投资者基金份额。

本次募集有效认购总户数为2,897户。按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算,募集期募集的基金份额共计264,443,862.00份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中本基金管理人山西证券股份有限公司运用自有资金认购本基金份额总量为7,000,000.00份,占基金总份额比例2.65%。本基金管理人的从业人员认购本基金份额总量为0。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

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《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《山西证券中证红利潜力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基金备案手续,并于2020年1月17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[2020]79号

2、上市交易日期:2020年4月9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

证券简称:山证红利

扩位证券简称:山证红利ETF

5、二级市场交易代码:515570

投资人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、本次上市交易份额:264,443,862.00份

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

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即2020年4月1日，本基金基金份额持有人户数为2,897户，平均每户持有的基金份额为91,281.97份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即2020年4月1日，机构投资者持有的本基金基金份额为35,334,500.00份，占基金总份额的13.36%；个人投资者持有的本基金基金份额为229,109,362.00份，占基金总份额的86.64%。

（三）前十名持有人

截至公告日前两个工作日即2020年4月1日，本基金前十名基金份额持有人情况如下：

序号	客户名称	持有份额	占比
1	渤海期货股份有限公司	10,003,500.00	3.78%
2	太钢集团财务有限公司	10,000,000.00	3.78%
3	山西证券股份有限公司	7,000,000.00	2.65%
4	黄小敏	3,574,000.00	1.35%
5	上海潞安投资有限公司	3,000,000.00	1.13%
6	田育平	3,000,000.00	1.13%
7	张璇	3,000,000.00	1.13%
8	孙云柯	2,800,000.00	1.06%
9	梁京山	2,000,000.00	0.76%
10	上海八尺龙投资管理有限公司—八尺龙梁山2号私募证券投资基金	1,502,000.00	0.57%
合计		45,879,500.00	17.35%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本情况

名称：山西证券股份有限公司

住所及办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

成立时间：1988年7月28日

法定代表人：侯巍

总经理：侯巍

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行复[1988]315号

组织形式：股份有限公司

存续期限：持续经营

注册资本：人民币28.2873亿元人民币

工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码
91140000110013881E

电话：（0351）8686966

传真：（0351）8686918

股权结构：

股东名称	持股数量（股）	持股比例
山西金融投资控股集团有限公司	865,314,455	30.59%
太原钢铁(集团)有限公司	282,605,635	9.99%
山西国际电力集团有限公司	199,268,856	7.04%
北京中吉金投资资产管理有限公司—中吉金投—稳赢2号投资基金	45,446,000	1.61%
中央汇金资产管理有限责任公司	40,619,400	1.44%
河南省安融房地产开发有限公司	27,585,951	0.98%
郑州市热力总公司	26,401,342	0.93%

中国农业银行股份有限公司—中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	18,186,248	0.64%
香港中央结算有限公司（陆股通）	17,787,905	0.63%
山西省科技基金发展有限公司	17,000,000	0.60%

注：截止到2019.9.30前十大股东持股情况

经营范围：证券经纪；证券自营；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理业务。

2、内部组织结构及职能：

序号	部门	职能
1	党委工作部	负责公司党委日常工作，组织党委各类会议和重要活动；负责党委会议纪要、决议的形成及督办协调工作；做好党委文件收转、党委材料起草和党委印章管理使用；落实公司党建具体工作，落实公司党委抓基层党建主体责任，指导基层党组织党建各项工作；负责公司党委宣传、统战及精神文明建设工作，做好职工思想政治教育工作；完成公司党委及上级部门交办的其他工作。
2	纪检监察室	依据《中国共产党党章》、《中国共产党党内监督条例》、党风建设和反腐倡廉要求和公司规章制度，在集团纪委及公司党委、纪委领导下，开展党风廉政建设、监督执纪和效能监察工作。全面贯彻执行上级纪委和公司党委、纪委的工作部署和要求，在公司纪委的领导下组织和指导内部纪检监察工作，协助公司党委抓好党风廉政建设；落实反腐倡廉惩防体系建设规划要求，完善反腐倡廉制度，建立防控机制。对公司廉洁风险防控工作系统进行部署、检查、督促，并组织开展党风党纪理想信念宣传教育活动，开展廉洁文化教育活动，协助党委抓好党委中心组专题学习，适时安排反腐倡廉专题讲座，及时开展警示教育。按照集团纪委的要求，组织开展效能监察工作。同时受理公司党组织、党员和群众在党的纪律和党风方面的来信来访。
3	群团工作部	新形势、新机遇、新挑战，群团工作始终坚持党的政治性、先进性、群众性，坚持立足实际，履职尽责的工作格局，改革创新、锐意进取，保持和广大职工群众同呼吸、共命运、心连心，把公司群团组织建设的更加充满活力、更加坚强有力，成为群众信得过、靠得住、离不开的知心人、贴心人。 部门主要工作职责包括：制定并实施公司工会的工作计划；合理管理使用工会经费；帮助和指导员工签订劳动合同；做好员工思想政治教育工作；组织开展文化、体育、竞赛活动；组织、评选、培养公司先进模范；管理工会会员、团员青年，维护员工的合法权益。
4	董事会办公室	董事会办公室作为上市公司标配部门，也是公司对接资本市场和投资者的桥梁。董事会办公室主要负责筹划、组织和协调公司股东大会、董事会、监事会及董事会各专业委员会会议相关事务，协助公司持续完善法人治理结构，提升公司三会运行效率；组织公司对外信息披露事务工作包括定期报告、临时报告的编制及披露工作；建立有效的投资者关系管理体系，负责与各类投资者保持沟通；保持与股东单位日常信息的沟通、协助办理相应股权事项；协调与监管部门关系并处理有关事务；公司战略发展及研究；适时开展涉外事务。

5	综合管理部	负责公司级会议的组织落实工作；协调、组织与督查公司各部门对公司有关决议的执行及完成情况；负责公司印章、证照的管理；统筹公司公文管理工作；负责公司综合性资料的收集、起草与报送工作；负责公司形象策划和对外宣传工作；负责行业系统内公司信息的报送、反馈及相关联络工作；统一管理公司各类档案；负责公司机要保密工作。
6	行政保卫部	制定并落实公司驻外机构行政管理工作；制定并统一公司内部招标、比选管理办法；加强全公司范围内工程项目的开发及管理实施、固定资产管理、安全消防保卫等工作职能；通过各种规章制度和人为努力使部门之间形成密切配合的关系，使整个公司在运作过程中成为一个高速并且稳定运转的整体；
7	稽核审计部	按照现代内部审计制度的要求，依照法律和公司规定在公司董事长直接领导下独立行使审计监督权，独立履行审计监督、财务稽核、业务稽核、管理稽核等职能，为公司经营层提供管理建议。 贯彻执行国家有关法律法规、行业规章以及公司各项内控制度和有关决议；建立健全本部门职责范围内的相关制度并组织实施；拟定公司年度稽核审计工作计划并组织实施；检查督促稽核审计报告、稽核审计结果的落实情况；对稽核审计过程中发现的问题提出处理意见，并根据制度对相关责任部门或责任人做出处罚决定；负责将稽核审计结果与各部门的绩效考核相挂钩；在公司授权范围内，对各项制度的落实情况进行监督，对员工违规、违纪开展调查并行使处罚权；对公司各部门、分支机构和子公司进行全面审计及对合规管理有效性、内部控制、全面风险管理的定期评价及整改落实工作。
8	风险管理部	协助首席风险官建立健全与公司自身发展战略相适应的全面风险管理体系，增强公司核心竞争力。 负责识别、评估、监测、报告公司整体风险水平；牵头拟定完善公司风险管理制度和风险偏好指标体系；牵头管理公司的市场风险、信用风险、操作风险；指导、监督、检查各部门风险管理工作落实情况；牵头组织综合压力测试和专项压力测试工作；牵头组织召开风险管理执行委员会会议。
9	合规管理部	合规管理部协助合规总监工作，对合规总监负责。根据监管规定，对公司经营管理的合法合规性履行监督检查、咨询审查的职能；负责公司制度体系建设、合规文化宣导以及公司法律事务管理等。
10	计划财务部	计划财务部作为公司重要的职能部门，全面负责公司会计核算、财务管理、保证公司资金运行以及进行会计监督，保证公司各项财务工作安全、有序运行。 围绕公司经营发展目标，计划财务部致力于提升财务及资本管理能力，重点推行公司全面预算管理，确定科学、合理的成本费用项目标准，优化资源配置，促进业务发展；合理规划和调配公司资金，全面落实资金的风险管理和效益管理。
11	人力资源部	按照现代企业人力资源管理理念，建立人员能进能出、岗位能上能下、收入能高能低、培育与使用相结合的市场化人力资源管理体制和激励约束机制，为公司经营发展提供适用人才和组织保证，为员工搭建个人职业发展平台，实现股东利益、公司利益与员工利益的有机统一。 制定并落实公司人力资源战略；制定并实施人力资源管理各项制度，包括岗位职级、薪酬管理、绩效管理、员工招聘、员工培训等职能；对公司各机构人力资源管理工作进行指导协调和检查落实。
12	研究所	研究创造价值。公司内外服务兼顾，树立研究品牌，提高公司声誉。为公司客户提供独立、全面、前瞻和务实的证券研究报告与投资咨询服务；开展公司战略研究，为公司经营发展提供研究支持；为公司业务开展提供研究支持和服务；发挥地域优势，深

		入研究山西经济和重点产业，提供差异化服务，积极主动服务山西实体经济发展。
13	运营管理部	建立健全与结算存管业务及经纪业务运行管理相关的各项制度、制定统一完善的业务流程并监督落实；负责与客户交易结算资金第三方存管相关的银行账户及结算账户的管理工作；履行全公司的集中清算及客户资金交收职能；负责客户资产的集中管理、股份登记和托管；客户交易结算资金的核算和管理；系统参数管理及柜台权限管理；组织全公司的测试、反馈工作；公司经纪业务客户账户的日常管理及集中运营等工作。
14	信息技术部	保障公司各信息系统的运行平稳、正常，大力加强 IT 建设，大力推行 IT 转型。信息系统的总体规划并组织实施，编制信息技术预算并落实执行，拟定与信息技术相关的规章制度并落实执行，指导分支机构的信息系统运作管理，跟踪研究信息技术的发展，合理、及时地推广各类新技术，协助进行信息技术审计工作。
15	科技金融部	以掌控核心技术的研发能力为目标，发展大数据和智能技术；通过技术赋能，引领业务提高效率及产品创新能力，推动公司业务、管理、客户服务的数字化转型。
16	机构业务部	立足于“对内整合公司资源，对外满足客户需求”，致力于构建综合金融服务生态，为政府、实体企业、同业机构、私募基金等机构客户提供综合金融解决方案。组织落实公司机构业务发展规划；负责公司业务协同管理，完善机构 CRM 系统功能，充分整合公司资源，全方位服务机构客户，服务实体经济；负责公司 PB 业务（含私募基金综合服务、机构柜台及 PB 交易业务等）系统建设、运营管理、业务开发及客户维护；负责公司交易单元的分配和日常管理；负责各类机构客户的合作对接，积极开展同业业务合作；对分支机构各类机构业务的开展提供业务指导和培训。
17	财富管理运营部	根据公司发展战略，结合行业发展态势，制定财富条线发展战略，提升综合财富管理能力，构建线上线下相结合的工作模式，切实服务实体经济，落实大平台战略，实现公司财富转型及可持续发展目标。 拟定公司财富管理业务总体规划并组织实施；建立健全公司财富管理业务相关制度及实施细则并监督落实；负责分支机构各类考核及运营管理、分支机构网点规划及证照办理、线上客户标准化服务及见证复核、定期分析公司财富管理业务经营态势、编制、报送各类经纪业务监管报表、制定并执行部门合规风控管理工作计划，对部门业务开展情况及工作人员执业行为的合规性进行监督检查等工作。
18	私人财富部	负责开拓全国高净值及超高净值客户，探索和固化高净值及超高净值客户服务内容和标准，高净值及超高净值客户资产配置产品的引入、筛选和销售，客户专属活动组织、关系维护与管理，品牌宣传与推广，机构业务拓展等。与分支机构采取服务及产品资源共享，共同维护高净值客户的共赢方式，逐步打造公司特色的高端私人银行“1+N”直营模式。
19	零售及互金部	根据公司财富管理转型规划，以金融科技为核心驱动，统筹搭建客户端、员工工作平台等互联网运营平台，构建线上线下相融合的新零售客户营销服务体系，实现零售业务的数字化运营转型，做大做强零售客户财富管理业务规模。 负责交易终端、CRM 等互联网平台的规划、建设和运营管理工作；负责零售业务数字化运营和线上展业等工作；负责公司级营销渠道的拓展和管理工作；负责零售客户的产品销售、投顾签约等业务的拓展和管理工作；负责零售客户的分类分层服务体系、零售服务品牌的建设和输出管理等工作。
20	金融产品部	按照“合规、专业、高效”的管理理念，积极落实公司财富转型发展战略。严格按照国家有关法律法规、行业规章以及公司各项内控制度和有关决议建立公司金融产品筛选、引入、售后闭环式管理体系和激励约束机制，为公司分支机构提供专业、优秀、

		丰富的金融产品，为公司分支机构提供全面的服务和强有力的支持。
21	信用及衍生品部	信用及衍生品部立足于“资本中介”，负责公司信用及衍生品业务的具体管理和运作，统筹协调各相关部门对分支机构进行业务支持，围绕公司战略发展目标，服务高净值客户，防范金融风险，服务实体经济，为公司信用类业务的持续发展提供源头活水。负责从证金公司转融资、转融券，并实现对券的管理；负责向银行等机构进行收益权转让；负责以信用业务债权资产为基础，在开展 ABS 时，对基础资产提供管理；负责对业务数据采集、分析及报送。
22	柜台交易业务部	柜台交易业务部是柜台市场的管理和运营部门。是私募产品的发行者，致力于为投资者提供方便灵活、定制化的私募产品和解决方案，负责投资者管理、产品设计与定价、产品推广、风险对冲等核心工作；同时也是公司柜台市场的组织者，致力于为投资者提供更好的投资理财产品的同时增强私募产品流动性，负责柜台产品的需求收集、设计开发、发行和交易等系列工作。
23	投资管理部	投资管理部是公司自营权益类投资业务的执行机构，负责在规定的自营权益类投资业务的规模、风险限额范围内开展相关业务。主要职责包括： 建立健全自营权益类业务相关的内控制度并组织实施；根据公司发展目标拟定自营权益类业务的总体规划并组织实施；负责授权范围内的证券投资业务；拟订证券自营权益类业务投资策略，向权益投资专业委员会提交投资建议报告。
24	固定收益部	固定收益部是进行公司自营业务投资的重要部门，负责在分管总裁的领导下，稳健有序开展投资交易业务、销售交易业务、投资顾问业务和分销业务，通过债券交易获取投资收益；在业务稳健发展的同时，注重合规和风控能力的同步提升；通过多种渠道和方式，扩大公司的市场影响力、维护公司品牌形象。
25	金融衍生产品部	金融衍生产品部作为公司的一级部门，主要负责以公司自己的名义和资金买卖证券从而获取利润的证券业务。 部门的业务主要划分为两大块：一块是以场内股票、期货等品种为主的量化投资业务；另一块是场外衍生品业务。 量化投资是以分散化投资和组合投资为主，通过采用数量化方式及计算机程序化发出买卖指令，以获取稳定收益为目的的交易方式。 场外衍生品业务，是指根据与交易对手达成的协议直接进行场外衍生品交易的业务行为，部门可以利用场外衍生品对冲自营持仓风险以及发掘其他的盈利模式。
26	贸易金融部	全面负责公司货币与商品市场业务；贯彻执行国家有关法律法规、行业规章以及公司各项内控制度和有关决议；负责制定公司贸易金融业务发展战略及实施策略；制定公司的贸易金融业务管理制度等；负责公司所有贸易金融业务的管理运作、开发、立项及后续管理等工作；负责建立健全贸易金融业务的风险管理体系，做好与风险管理部门的对接管理；负责编制合并贸易金融业务管理报表；指导、协调各相关部门及控股子公司的贸易金融业务开展；公司规定的其他职责。。
27	新三板	负责新三板推荐挂牌、并购重组、持续督导以及其他财务顾问业务，面向全国中小企业提供综合化金融服务。
28	资产管理分公司	资产管理业务的统一管理部门和承办机构

29	公募基金部	<p>山西证券公募基金部秉持“以义制利、协作包容、追求卓越”的核心价值观，以“专业服务创造价值”为使命，坚持“让投资更明白”的服务理念，目的是为了给广大投资人及公司客户带来全面可靠的优质金融产品服务，真正实现客户财富保值增值与公司利益的有机统一。公募基金部致力于满足客户需求，充分发挥主观能动性，提升投资研究的独立性和前瞻性，为客户创造价值；密切结合山西证券整体的发展战略、客户特点及业务优势，逐步完善包括权益产品在内的公募产品线和业务平台，提升对客户的全面服务能力。</p> <p>负责山西证券公募基金管理业务的日常管理和运作；拟订并组织实施公司公募基金管理业务的总体发展规划；完成公司下达的公募基金管理业务经营指标与管理目标；与公募基金管理业务有关的资格准入的申报；公募基金管理业务证券库的建立和维护；基金资产的投资运作管理；公募基金管理业务的后台运营维护；公募基金管理业务市场开发和维护及其创新产品的销售。</p>
30	国际业务部	<p>一、公司及集团内部渠道的国际业务协同及对接；</p> <p>二、内地介绍海外业务及香港介绍内地业务的双向业务协同对接；面向公司及集团内部各部门、分支机构及各子公司，推广宣传山证国际各项业务；</p> <p>三、面向公司及集团内部各部门、分支机构及各子公司，推广宣传山证国际各项业务公司及集团内部渠道的国际业务协同及对接；</p> <p>四、协同公司及集团内部各机构制定国际业务协同考核激励方案并配合落实；</p> <p>五、开发维护国内有海外业务需求的机构客户及高净值客户根据公司业务协同相关办法，制定国际业务考核激励方案；</p> <p>六、公司规定的其他职责</p>

其中，公募基金部作为主要负责公募基金管理业务的日常管理和运作部门，其组织结构及职能：

序号	部门	职能
1	市场部	秉承“诚信、稳健、规范、创新、高效”的经营理念，遵循客户至上，服务客户的原则，积极与客户沟通，满足客户需求，同时致力实现公募基金部的市场经营目标；制定相关市场策略，开拓与各机构的合作、营销渠道；收集和了解各类金融证券市场信息和相关情报，充分进行市场调研，在此基础上进行归纳分析；负责产品宣传和山西证券形象推广；负责制定推动产品的销售计划，并对产品销售工作进行监察、审批与评估。
2	固定收益投资部	制定公司固定收益类资产及私募类固收资产的总体投资策略、投资标准；根据投资者需求，设计固定收益类及私募类固收类理财产品，并对产品业绩负责。对债券及相关品种进行市场研究，其中固收类包括：信用债研究、利率债研究及货币市场研究；衍生品包括：国债期货、股指期货等研究，并与现货的对冲策略研究。
3	创新及权益投资部	对基金和股票市场、行业和山西证券经营状况进行深入分析研究，为资产管理部资产负债合理配置提供决策支持，并提出高效合理的投资建议；在资产管理部整体投资策略和资产配置范围内，拟定权益投资配置方案和计划；负责实施权益类投资计划；与权益投资品种相关的资金运作渠道的研究与创新；其他应当由权益投资处履行的相关职能。

4	集中交易室	根据投资部指令及时准确完成下单交易，并及时将交易指令执行情况和市场变动信息向投资部复核、反馈；熟悉行情系统，能够根据市场状况，利用交易经验、技术分析等手段对交易品种进行跟踪分析，提供交易观点；严格遵守相关法律法规及交易纪律，协助进行风险控制管理；及时整理交易记录，编写各项交易报告；制作相应的交易报表，履行一线风险监控。
5	运营支持部	运营管理部门负责公募基金部后台运维工作，包括履行基金资产投资的交易清算等职能，建设一个统一集中运营平台，通过有效整合运营、技术、产品、风控能力，为前台业务快速发展提供强力支撑。
6	内控部	内控部贯彻“风险全面评估、管理同步监督、经营逐级控制”的指导思想，依托技术平台的应用和支持，促使和激励部门每一名员工采用更好的风险管理实践，使部门以最佳的方式承担风险、维护公司声誉。部门主要负责包括风控、合规、稽核、信息披露的工作。此外，负责建立健全部门的合规管理体系；负责对部门管理制度、重大决策、新产品和新业务方案以及向监管机构的申报材料 and 报告进行审查并出具合规审查意见；跟踪法律、法规和准则的变化，督导相关部门及时评估、完善内部管理制度和业务流程；配合证券监管机构和自律组织对部门的检查和调查，跟踪和评估监管意见和监管要求的落实情况。
7	战略规划与产品部	负责指导组织公募基金市场研究，为基金产品定位、业务决策提供有效参考；负责组织产品的设计、注册申报，提供产品框架和模板；根据具体的项目，负责组织项目前期策划，产品方案设计，并于相关部门配合（包括外部机构），落实基金产品规划，提升和改进产品方案，质量以及成本结构；
8	技术支持岗	<ol style="list-style-type: none"> 1. 信息技术系统建设的总体规划。 2. 信息系统相关的基础运营支持。 3. 032. 估值、TA、直销等业务系统的运维沟通协调与支持。 4. 032. 估值、TA、直销等业务系统的测试支持。 5. 软件系统调研、立项及采购。 6. 信息系统维护支持，包括软件系统、电话系统、网络系统、门禁系统等。 7. 打印机、电脑软硬件相关技术支持。 8. 信息技术归口管理。 9. 与公司内外部、监管机构等技术沟通。

3、 主要人员情况

(1) 董事会成员

侯巍先生，中共党员，硕士学位。2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委委员、董事、总经理；2008年1月至2015年2月任公司董事、总经理；2008年4月至2010年9月任大华期货有限公司董事；2009年4月至今任中德证券有限责任公司董事长；2008年2月至2014年12月历任公司党委委员、党委副书记；2014年12月至今任公司党委书记；2015年2月至今任公司董事长、总经理；2016年12月至今任山西股权交易中心有限公司董事长。

杨增军先生，中共党员，本科学历，高级会计师，2009年3月至2015年5月，

在晋商银行股份有限公司工作，历任财务总监、首席财务官；2015年5月至2016年7月，在山西国信投资集团有限公司工作，任财务总监兼计划财务部总经理、科技信息部总经理（兼）、投资决策委员会委员、财务审查委员会副主任；2016年7月至今在山西金融投资控股集团有限公司工作，任财务总监兼财务管理部总经理；2017年2月至今兼任山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席，山西省农业信贷融资担保有限公司监事；2018年2月至今任公司董事。

李华先生，中共党员、本科学历，会计师。1995年7月至2002年3月在太钢集团财务处成本科从事会计工作；2002年4月至2008年6月担任太钢集团计财部成本管理室科长；2008年7月至2011年9月担任山西太钢不锈钢股份有限公司计财部副部长；2011年10月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司计财部部长；2016年4月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司财务总监；2016年11月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司董事会秘书；2016年10月至今担任山西太钢不锈钢股份有限公司董事；2017年8月至2018年10月担任太原钢铁（集团）有限公司副总经理，兼任太原钢铁（集团）国际经济贸易有限公司、山西太钢投资有限公司、山西太钢能源有限公司、太钢进出口（香港）有限公司、太钢集团财务有限公司董事长，太钢（天津）融资租赁有限公司、太钢（天津）商业保理有限公司董事长、总经理，山西晋煤太钢能源有限责任公司、太钢集团临汾钢铁有限公司董事。2017年12月至2018年10月担任山西太钢保险代理有限公司董事长。2018年10月至今任太原钢铁（集团）有限公司党委常委、董事；2018年11月至今担任山西太钢不锈钢股份有限公司副董事长、总经理，兼任山西太钢不锈钢精密带钢有限公司、天津太钢天管不锈钢有限公司、山西太钢不锈钢钢管有限公司董事长。2018年8月至今任公司董事。

夏贵所先生，中共党员、本科学历。1996年11月至1998年1月任山西通宝能源股份有限公司财务部副经理，1998年1月至2000年8月任山西通宝能源股份有限公司总经理助理、财务部经理，2001年11月至2004年3月任山西通宝能源股份有限公司总会计师，2004年3月至2008年2月任山西通宝能源股份有限公司副总经理兼会计师，2008年2月至2010年7月任山西国际电力配电管理公司总会计师、党委委员，2010年7月至今任山西国际电力集团有限公司财务部经理（期间：2014年2月至2017年3月任晋能电力集团有限公司总会计师、党委委员职务），2016年5

月至今任山西通宝能源股份有限公司董事；2017年5月至今任山西国际电力集团有限公司董事；2010年6月至今任山西国电置业有限公司董事；2010年8月至今任山西地方电力有限公司董事；2011年2月至今任山西国际电力资产管理有限公司董事；2014年3月至今任晋能环保工程有限公司董事；2015年4月至今任山西国际电力投资有限公司董事；2017年11月至今任晋能集团有限公司财务管理部副部长；2018年5月至今任晋商银行股份有限公司、山西灏鼎能源投资有限公司、朝晖产业投资基金管理有限公司监事；2018年8月至今任公司董事。

朱海武先生，硕士学位，中国注册会计师、高级会计师、中国注册税务师、澳洲资深会计师。2000年1月至今，在瑞华会计师事务所工作，担任合伙人。2014年10月至今，任华远地产股份有限公司独立董事；2015年5月至今任公司独立董事。

容和平先生，中共党员，本科学历。2001年6月至2010年6月任山西大学商务学院副院长、教授；2011年5月至今任山西工商学院副院长、教授；2013年6月至今任太原化工股份有限公司独立董事；2011年5月至今任公司独立董事。

王卫国先生，中共党员，硕士学位。1994年4月起任中国政法大学教授（2016年5月退休）；2008年9月至今兼职中国银行法学研究会，现任会长；2014年10月至今任藏格控股股份有限公司独立董事；2016年11月至今任陕西宝光真空电器股份有限公司董事；2011年5月至今任公司独立董事。

蒋岳祥先生，中共党员，硕士学位。2005年12月至2009年3月任浙江大学经济学院金融系教授、博士生导师、系主任、院长助理；2009年4月至2013年7月，任浙江大学经济学院党委书记、副院长；2009年4月至今任浙江大学经济学院教授、博士生导师；2014年7月至今任国信证券股份有限公司独立董事；2015年8月至今任英洛华科技股份有限公司独立董事；2016年7月至今任荣安地产股份有限公司独立董事；2011年5月至今任公司独立董事。

王怡里先生，中共党员，学士学位。2008年2月至2013年3月任山西证券董事会办公室总经理；2008年2月至2016年5月任山西证券综合管理部总经理；2010年2月至今担任山西证券党委委员；2010年4月至今任山西证券董事会秘书；2011年8月至今任山西证券副总经理；2013年6月至今任山西中小企业创业投资基金（有限合伙）执行事务合伙人委派代表、山证基金管理有限公司董事长；2014

年6月至今任山证资本管理（北京）有限公司董事长；2014年10月至今任龙华启富（深圳）股权投资基金管理有限公司董事长、北京山证并购资本投资合伙企业执行事务合伙人委派代表；2015年2月至今任山证投资有限责任公司董事长；2016年11月至今担任中德证券有限责任公司董事；2018年1月至今任汾西启富扶贫引导基金合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人委派代表；2018年7月至今任山西国投创新绿色能源股权投资合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人委派代表；2018年8月至今任山西交通产业基金合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人委派代表；2018年12月至今任山证创新投资有限公司执行董事、总经理；2018年3月至今任公司职工董事。

（2）监事会成员

焦杨先生，中共党员，本科学历，硕士学位。2010年2月至2014年12月任山西信托股份有限公司常务副总经理；2014年12月至2016年6月任山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理；2016年6月至今任山西金融投资控股集团有限公司运营总监；2016年6月至2018年2月任山西金融投资控股集团有限公司资本运营部总经理；2018年2月至今任山西金融投资控股集团有限公司投资管理部总经理；2015年1月至今任汇丰晋信基金管理有限公司监事会主席、山西股权交易中心有限公司监事；2016年12月至今，任山西股权交易中心有限公司监事会主席；2010年10月至今任公司监事；2011年5月至今任公司监事会主席。

郭志宏先生，中共党员，本科学历，EMBA高级工商管理硕士学位，高级经济师。2012年5月至2015年3月，任山西信托股份有限公司监事、监事会主席；2015年3月至2017年1月任山西信托股份有限公司党委委员、副总裁；2017年1月至2019年1月任山西省融资再担保有限公司党委书记、董事长；2019年1月至今任山西省融资再担保集团有限公司（原山西省融资再担保有限公司）党委书记、董事长；2015年5月至今任公司监事。

王国峰先生，中共党员，本科学历。2005年3月至2015年3月，任长治市行政事业单位国有资产管理中心副主任；2015年9月至2017年10月，任长治市行政事业单位国有资产管理中心主任；2017年10月至今，任长治市经济建设投资服务中心主任；2015年5月至今任公司监事。

高明先生，中共党员，大专学历。1984年9月至今历任汾酒集团有限责任公司

司基建出纳、会计、财务科副科长、科长、审计部副主任、主任、山西杏花村汾酒厂股份有限公司财务处处长、汾酒集团有限责任公司财务部主任、副总会计师；2013年8月至今任山西杏花村汾酒集团有限责任公司总会计师；2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司董事；2008年1月至今任公司监事。

关峰先生，中共党员，本科学历。2001年6月至2013年6月，历任山西焦化集团有限公司审计处副处长、处长；2013年6月至2014年4月，任山西焦化集团有限公司财务处处长；2014年5月至2017年5月，任山西焦化集团有限公司集团副总会计师兼财务处处长；2017年2月至今任山西焦煤集团飞虹化工股份有限公司总经理助理、财务部部长；2015年5月至今任公司监事。

罗爱民先生，中共党员，本科学历。2005年3月至2010年3月任山西省经贸资产经营有限责任公司处长；2010年3月至2017年5月任山西经贸集团技改投资有限公司总经理；2017年5月至今任山西经贸集团技改投资有限公司执行董事；2018年12月至今任山西旅游集团资产管理有限公司董事长、山西经贸集团煤焦投资有限公司董事长；2007年6月至今，任太原重工股份有限公司监事；2011年5月至今任公司监事。

李国林先生，中共党员，本科学历，学士学位。2012年4月至2016年5月任山西省科技基金发展总公司副总经理；2016年5月至2016年8月，任山西省科技基金发展总公司常务副总经理；2016年8月至2017年12月任山西省科技基金发展总公司总经理；2016年9月至2017年12月任山西省科技基金发展总公司党支部书记。2017年12月至今任山西省科技基金发展有限公司(原山西省科技基金发展总公司)党支部书记、执行董事、总经理。2014年9月至今任山西久晖股权投资管理有限公司执行董事；2014年6月至今任山西澳坤生物农业股份有限公司董事；2014年4月至今任太原风华信息装备股份有限公司董事；2015年5月至2017年7月任山西中电科新能源技术有限公司董事；2012年3月至今任晋城市富基新材料股份有限公司董事；2014年12月至今任山西诺亚信创业投资有限公司董事；2012年12月至今任运城市奥新纳米新技术有限公司董事；2015年1月至今任山西青山化工有限公司董事；2018年3月至今任山西康宝生物制品股份有限公司董事；2015年5月至今任公司监事。

刘奇旺先生，中共党员，本科学历。1992年10月至2017年12月，历任吕梁市

国有资产投资集团公司(原吕梁地区信托投资公司)办公室副主任、办公室主任、总会计师；2017年12月至今任吕梁国投集团有限公司(原吕梁市国有资产投资集团公司)总会计师；2015年5月至今任公司监事。

胡朝晖先生，中共党员，学士学位。2008年1月至今任公司职工监事；2008年2月至2016年5月任公司风险控制部总经理；2016年5月至今任公司稽核考核部总经理；2009年1月起任公司监事会副主席。2011年7月至今任山证投资有限责任公司监事；2014年6月任山证资本管理(北京)有限公司监事。

翟太煌先生，中共党员，硕士学位。2008年1月至今任公司职工监事；2008年1月至2019年3月任公司研究所所长；2011年7月至今任山证投资有限责任公司董事；2014年6月任山证资本管理(北京)有限公司董事；2019年3月至今任公司研究所总监。

尤济敏女士，中共党员，硕士学位。2006年4月至2016年5月任公司人力资源部总经理；2006年4月至2011年8月，任公司党委办公室主任；2008年1月至今任公司职工监事；2011年7月至今任山证投资有限责任公司董事；2013年6月至今任山证基金管理有限公司董事；2014年6月至今任山证资本管理(北京)有限公司董事；2016年6月至今任山证投资有限责任公司专职副董事长。

闫晓华女士，中共党员，学士学位。2006年7月至2008年1月任公司稽核考核部总经理，2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工监事；2008年1月至今任公司职工监事；2008年2月至2016年5月任公司稽核考核部总经理；2016年5月至2017年7月任公司合规管理部总经理；2017年2月至今任公司总裁助理。

(3) 公司高级管理人员

侯巍先生，请参见本节“董事会成员”。

乔俊峰先生，中共党员，硕士学位。2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工董事；2008年2月至2015年5月任公司职工董事；2008年10月至2010年9月任大华期货有限公司总经理；2010年9月至2013年9月任大华期货有限公司董事长；2010年2月至今担任公司党委委员。2010年12月至今任公司副总经理；2013年9月至2017年1月任格林大华期货有限公司董事长；2016年1月至今任山证国际金融控股有限公司董事长。2017年6月至今任公司上海资产管理分公司总经理。

汤建雄先生，学士学位。2008年2月至2013年3月任公司计划财务部总经理；2007年11月至2013年10月任大华期货有限公司董事；2009年4月至今担任中德证券有限责任公司董事；2010年4月至2015年12月任公司财务总监；2011年8月至今任公司副总经理；2011年7月至今任山证投资有限责任公司董事；2013年10月至今任格林大华期货有限公司董事；2015年2月至2016年1月代为履行合规总监职责，2016年1月至2017年6月任公司合规总监。2017年7月至今任公司首席风险官，2018年1月至今任公司财务负责人。

王怡里先生，请参见本节“董事会成员”。

高晓峰先生，中共党员，学士学位。1996年8月至1999年8月任职于山西省证券管理办公室证信证券培训中心；1999年8月至2010年3月先后任职于中国证监会山西监管局机构处、期货处和上市处；2010年3月至2014年8月先后任中国证监会山西监管局办公室副主任（主持工作）、主任；2014年8月至2015年11月任中国证监会山西监管局期货处处长；2015年11月至2017年3月任中国证监会山西监管局法制处处长（期间，2016年8月至2017年1月挂职山西金融投资控股集团有限公司投资管理部副总经理）；2017年6月至今，任公司副总经理、合规总监。

（4）公募基金公司人员情况

截止到2020年2月，公募基金公司共有员工42人，博士1人、硕士32人、本科9人。

4、信息披露负责人：薛永红

咨询电话：95573

5、基金管理业务情况简介：

截至2020年3月31日，山西证券股份有限公司旗下共管理8只开放式公募基金。

序号	基金名称
1	山西证券日日添利货币市场基金
2	山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金
3	山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金
4	山西证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金
5	山西证券超短债债券型证券投资基金
6	山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

7	山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金
8	山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金

6、基金经理

章海默女士, 复旦大学管理学院工商管理硕士, 具有基金从业资格。2003年进入华安基金管理有限公司, 15年证券从业经历, 超过8年的投资管理经历。其中, 2009年12月至2012年12月任华安上证180ETF以及联接基金基金经理助理, 2011年9月至2012年12月任华安深证300指数证券投资基金(LOF)基金经理, 2012年12月至2015年9月任华安上证180交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金经理, 2013年6月至2015年9月任华安基金指数与量化投资部总监助理, 2013年12月至2015年9月任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2014年11月至2015年9月任华安中证细分医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理; 2015年9月入职西部证券股份有限公司上海第一分公司, 2016年1月至2018年1月, 于西部证券股份有限公司上海第一分公司负责投资管理公司港股自营投资账户; 2018年3月至今, 任山西证券公募基金部研究总监; 2020年1月至今任山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

刘俊清女士, 中国人民大学MBA, 具有基金从业资格。2000年8月至2014年5月在山西证券研究所任证券研究员; 2014年5月起, 任山西证券公募基金部投资总监, 同时担任公募基金管理业务决策委成员; 2018年5月起担任山西证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2020年1月至今任山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

(二) 基金托管人

1、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: 刘连舸

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

2、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。

3、证券投资基金托管情况

截至 2019 年 12 月 31 日，中国银行已托管 764 只证券投资基金，其中境内基金 722 只，QDII 基金 42 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 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。

（三）上市推荐人

1、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：周杰

联系人：李楠

客服电话：95553

网站：www.htsec.com

2、中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东银城中路200号中银大厦39层

办公地址：上海市浦东银城中路200号中银大厦39层

法人代表：宁敏

联系人：李男

客服电话：021-61195566，400-620-8888（免长途通话费）

网址：<http://www.bocichina.com/>

（四）一级交易商

1、山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

组织形式：股份有限公司

存续期间：永续经营

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686966

传真：0351-8686667

联系人：谢武兵

客服电话：95573

网站：www.i618.com.cn

2、中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街35号2-6层

办公地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

组织形式：股份有限公司

存续期间：永续经营

法定代表人：陈共炎

电话：010-6656-8888

传真：010-6656-8640

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888

网站：<http://www.chinastock.com.cn/>

3、中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京东城区朝内大街2号 凯恒中心B座10层

组织形式：股份有限公司

存续期间：永续经营

法定代表人：王常青

电话：（010）65183880

传真：（010）65182261

联系人：刘畅

客服电话：400-888-8108

网站：<http://www.csc108.com/>

（五）验资机构

名称：中喜会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市崇文区崇文门外大街11号新城文化大厦A座11层

办公地址：北京市崇文区崇文门外大街11号新城文化大厦A座11层

法定代表人：张增刚

电话：010-68085873

经办注册会计师：白银泉、张伟

联系人：张伟

六、 基金合同摘要

基金合同摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金 2020 年 4 月 1 日资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资产	期末余额_1	负债和所有者权益	期末余额_2
资产：	-	负债：	-
银行存款	12,031,862.12	短期借款	-
结算备付金	0.00	短期借款	-
存出保证金	95,663.92	交易性金融负债	-
交易性金融资产	229,573,720.05	衍生金融负债	-
股票投资	229,573,720.05	卖出回购金融资产款	-
债券投资	-	应付证券清算款	9,761,704.43
资产支持证券投资	-	应付赎回款	-
理财投资	-	应付管理人报酬	105,423.82
权证投资	-	应付托管费	21,084.77
基金投资	-	应付销售服务费	-
衍生金融资产	-	应付投资顾问费	-
可供出售金融资产减值准备	-	应付交易费用	230,285.01
买入返售金融资产	-	应付税费	-
应收证券清算款	941,480.72	应付利息	-
应收利息	8,465.46	应付利润	-
应收股利	-	应付代减持资产	-

应收申购款	-	其他负债	58,160.88
其他资产		负债合计	10,176,658.91
	-	所有者权益	-
	-	实收基金	264,443,862.00
	-	资本公积	-
	-	未分配利润	-31,969,328.64
	-	所有者权益合计	232,474,533.36
资产总计	242,651,192.27	负债和所有者权益合计	242,651,192.27

注：截至 2020 年 4 月 1 日，本基金份额为 264,443,862.00 份，基金净值为 232,474,533.36 元，基金份额净值为 0.8791 元。

八、基金投资组合

截止到 2020 年 4 月 1 日，本基金的投资组合如下：

1.1 基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	229,573,720.05	94.61
	其中：股票	229,573,720.05	94.61
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	12,031,862.12	4.96
8	其他资产	1,045,610.10	0.43
9	合计	242,651,192.27	100.00

1.2 按行业类别分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	25,105,728.00	10.80
C	制造业	158,069,236.35	67.99
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	402,483.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮 政业	8,177,613.00	3.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	3,150,623.20	1.36
J	金融业	7,473,830.00	3.21

K	房地产业	27,194,206.50	11.70
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	229,573,720.05	98.75

1.2.2 按行业分类的港股通投资股票投资组合

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有港股通股票投资。

1.3 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

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	600519	贵州茅台	24,700.00	27,244,100.00	11.72
2	000333	美的集团	377,000.00	18,314,660.00	7.88
3	000002	万科A	651,300.00	17,344,119.00	7.46
4	600104	上汽集团	770,800.00	15,200,176.00	6.54
5	600028	中国石化	3,241,200.00	14,228,868.00	6.12
6	600887	伊利股份	446,400.00	13,079,520.00	5.63
7	000858	五粮液	102,000.00	11,730,000.00	5.05
8	600309	万华化学	239,300.00	9,904,627.00	4.26
9	601601	中国太保	267,400.00	7,473,830.00	3.21
10	601006	大秦铁路	1,101,600.00	7,413,768.00	3.19

1.4 按债券品种分类的债券投资组合

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有债券投资。

1.5 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有债券投资。

1.6 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有资产支持证券。

1.7 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有贵金属。

1.8 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 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有权证。

1.9 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有股指期货。

1.10 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有国债期货。

1.11 投资组合报告附注

基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

1.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	95,663.92
2	应收证券清算款	941,480.72
3	应收股利	-
4	应收利息	8,465.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,045,610.10

1.11.2 持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有可转换债券。

1.11.3 前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2020 年 4 月 1 日，本基金未持有流通受限股票。

九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人，就本基金上市交易后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运营基金财产。

（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）在知悉可能对基金份额价格产生误导性影响或者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

基金托管人就山西证券中证红利潜力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

上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

（一）本基金上市符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》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，符合法律法规规定。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的文件；
- 2、《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、《山西证券中证红利潜力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和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照

（二）存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者可以通过以下途径咨询相关事宜：

- 1、客服热线：95573
- 2、公司公募基金业务网站：<http://publiclyfund.sxzq.com:8000>

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。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

山西证券股份有限公司

2020年4月3日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

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

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

(10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(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、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、上海证券交易所及基金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、转换、非交易过户和转托管等业务规则；

(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 15 年以上；

(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，同时将募集期间网下股票认购所募集的已冻结的股票由登记机构予以解冻；

- (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，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需的其他账户，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，向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
- (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 15 年以上；
- (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监管机构，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》、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) 根据法律法规及证券交易所相关规定进行认购、申购，并及时履行因认购、申购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务；
- (5) 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；
- (6) 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；
- (7) 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；
- (8) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (9) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (10) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；
- (11) 提供基金管理人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时地更新和补充，并保证其真实性；
- (12) 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。

若以本基金为目标基金，且基金管理人和基金托管人与本基金基金管理人和基金托管人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和联接基金的相关性，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本基金的基金份额持有人大会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。在计算参会份额和票数时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会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持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特

定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

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

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、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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) 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、调低赎回费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(5) 基金管理人、代销机构、登记机构调整有关基金申购、赎回、转换、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) 按照本基金合同的约定，变更本基金的标的指数和基金名称、调整业绩比较基准；

(7) 基金推出新业务或服务；

(8) 基金管理人调整基金收益分配原则；

(9) 按照指数编制公司的要求，根据指数使用许可协议的约定，变更标的指数许可使用费费率和计算方法；

(10) 调整基金份额类别设置、调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成、开通基金的场外申购赎回、跨系统转托管等业务；

(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。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在法律法规或监管机构允许的前提下，经会议通知载明，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他非现场方式进行表决，或者采用网络、电话或其他非书面方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开

会和通讯方式开会的程序进行。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

点结果。

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

2、通讯开会

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

(八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议, 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依照《信息披露办法》在指定媒介上公告。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、本基金收益分配方式采用现金方式；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、当基金份额净值增长率超过同期标的指数同期增长率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配。在收益评价日，基金管理人就基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见《招募说明书》；
- 4、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还原后基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；
- 5、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配；
- 6、基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配；
- 7、法律、法规或监管机构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实质不利影响的情况下，基金管理人、登记机构经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（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》在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日。

（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、运作有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 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；
- 11、基金收益分配中发生的费用；
- 12、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管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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：

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

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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

3、基金的指数许可使用费

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。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。此项变更无需召开基金份额持有人大会审议，但基金管理人应按照基金合同的约定在指定媒介予以公告。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4—12 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、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。

为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）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、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权等）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的相关规定）。

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%，且不低于基金非现金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份股和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）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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(9) 本基金参与股指期货和国债期货交易，则需遵守下列投资比例限制：

i. 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%；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%；

ii. 本基金参与国债期货或股指期货交易，在任何交易日日终，持有的买入国债期货和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；

iii. 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%；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%；

iv. 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%；

v. 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；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；

(10) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

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

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

等价物；

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

(14) 本基金参与融资的，每个交易日日终，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交易，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的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资产的范围；

(16) 本基金参与转融通证券出借交易，在任何交易日日终，参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

(17) 本基金参与转融通证券出借交易，最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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

(19) 本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(20) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手方开展逆回购交易的，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；

(21) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。除上述第(6)、(19)、(20)项外，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。

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

符合上述第(15)、(16)、(17)、(18)项规定的,基金管理人不得新增出借业务。

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

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制,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。

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上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制性规定,如适用于本基金,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) 基金资产净值的计算方法

1、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、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

2、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。

3、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。

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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

6) 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。

(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市价（收盘价）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。

(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) 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值; 选定的第三方估值机构未提供估值价格的, 按成本估值。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值。

(6) 因持有股票而享有的配股权, 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。

(7) 本基金投资股票期权合约, 一般以股票期权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。

(8) 交易所上市的股指期货合约, 以其估值日在交易所挂牌的结算价估值。估值日无交易的, 以最近交易日的结算价; 如法律法规今后另有规定的, 从其规定。

(9) 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。

(10) 本基金参与转融通证券出借业务的, 按照法律法规和相关行业规定估

值，确保估值的公允性。

(11) 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。

(12) 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。

(二) 基金净值公告

《基金合同》生效后，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指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，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

(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》在指定媒介公告。

（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、连续 40 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；
- 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、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、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具有证券、期货相关业务资格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指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（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。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。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》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。