鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2026 年 11 月 23 日

公告日期：2026 年 11 月 18 日

目录

一、 重要声明与提示 3
二、 基金概览 4
三、 基金的募集与上市交易 5
四、 持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人 7
五、 基金主要当事人简介 8
六、 基金合同摘要 15
七、 基金财务状况 15
八、 基金投资组合 16
九、 重大事件揭示 20
十、 基金管理人承诺 20
十一、 基金托管人承诺 21
十二、 基金上市推荐人意见 21
十三、 备查文件目录 21
附件：鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金合同摘要 23

一、 重要声明与提示

鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《深圳证券交易所证券投资基金上市交易规则》等规定编制，本基金管理人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,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。

本基金为主动 ETF，在基金运作过程中基于前一交易日日终的真实投资组合制作申购赎回清单，与指数 ETF 基于标的指数权重文件制作申购赎回清单存在差异。主动 ETF 的申购赎回清单兼具申赎对价与持仓披露作用，其内容可能因基金管理人主动调整投资组合而变动，且受组合主动投资策略和调仓策略等方面的影响，其变动频率和幅度可能高于指数 ETF。

本基金特有风险包括：（1）采用主动投资策略进行投资管理可能引致的特定风险，包括主动选股策略失效风险、潜在抢先交易风险、投资策略被复制风险等；（2）主动 ETF 运作的风险，包括基金份额参考净值（IOPV）偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险等。

本基金为主动 ETF，可能面临主动选股策略失效风险，即由于采用主动选股策略，可能存在策略失效、实际业绩落后于业绩比较基准的风险；可能面临潜在抢先交易风险，即因执行主动选股策略等原因发生调仓且难以在一个交易日内完成调整，可能出现股票调仓方向暴露、被其他投资者抢先交易组合证券的情形，进而影响基金投资收益；可能面临投资策略被复制风险，即基金每交易日公布基于前一交易日日终的真实投资组合的申购赎回清单，投资组合透明度较高，其他投资者可能据此跟踪、复制基金投资策略和持仓结构，从而可能削弱投资策略的有效性，对基金投资收益产生不利影响。

本基金可能面临基金份额参考净值（IOPV）偏离的风险。基金管理人委托深圳证券信息有限公司在交易时间内根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV）并通过深圳证券交易所发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。若基金于交易日内调仓，IOPV 仅反映申购赎回清单所列组合证券的价值，与实时的基金份额净值可能出现一定偏离，该等偏离并非 IOPV 计算错误所致。投资者若完全依赖 IOPV 进行投资决策，可能因上述偏离遭受损失。

基金份额在证券交易所的交易价格受供求关系等诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在折溢价的风险。基金管理人将通过采取完善流动性服务等措施降低基金份额折溢价幅度，但基金调仓期间 IOPV 与基金份额净值的偏离可能加大，套利机制的有效性可能下降，基金折溢价幅度可能较大，折溢价状态的持续时间可能较长。

ETF 运作的风险包括：申赎成本增加风险、IOPV 计算错误风险、股票停牌的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、非深市组合证券申赎处理规则带来的风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置不合理的风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、套利风险、第三方机构服务的风险。

本基金托管人保证本报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。

中国证监会、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产品相关的其他内容，请仔细阅读 2026 年 10 月 20 日刊登在中国证监会规定披露媒介上的《鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金招募说明书》。

二、 基金概览

1、 基金名称：鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金

基金简称：鹏华价值臻选主动管理ETF

场内简称：价值主动ETF鹏华

2、交易代码：158903

3、基金运作方式和基金类型：交易型开放式，股票型基金

4、本基金的存续期限为不定期。

5、基金份额总额：截至2026年11月16日，本基金的基金份额总额为2,000,114,281.00份

6、基金份额净值：截至2026年11月16日，本基金的基金份额净值为1.0078元

7、本次上市交易的基金份额总额：2,000,114,281.00份

8、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

9、上市交易日期：2026年11月23日

10、基金管理人：鹏华基金管理有限公司

11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

12、本次上市交易的基金份额登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

13、申购赎回代理券商：渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国盛证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华福证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、世纪证券有限责任公司、万和证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司

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准予注册文号：中国证券监督管理委员会2026年10月16日证监许可〔2026〕2861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：本基金自2026年10月23日至2026年11月3日进行发售。

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售期限：共8个工作日。

7、发售方式：网上现金认购、网下现金认购两种方式。

8、发售机构：

（1）网下现金发售直销机构：鹏华基金管理有限公司

（2）网上现金发售代理机构

本基金网上现金认购可通过具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理，会员单位的具体名单如下：

爱建证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城国瑞、长城证券、长江证券、诚通证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、东莞证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联民生、国融证券、国盛证券、国泰海通、国投证券、国新证券、国信证券、国元证券、红塔证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华泰证券、华西证券、华源证券、华鑫证券、江海证券、金融街证券、金元证券、开源证券、联储证券、麦高证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申港证券、申万宏源、申万宏源西部、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天府证券、万和证券、万联证券、五矿证券、西部证券、西南证券、湘财证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券、甬兴证券（排名不分先后）

①基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员可通过深圳证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

②尚未取得基金代销资格，但属于深交所会员的其他机构，可在本基金上市交易后，代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的上市交易。

③销售机构办理本基金网上现金认购业务的城市（网点）的具体情况和联系方法，请参见各销售机构公告或网站。

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

本次募集的有效净认购金额为2,000,000,045.00元人民币，按照每一基金份额面值人民币1.00元计算，折合基金份额2,000,000,045.00份，有效认购户数为19,182户，利息结转份额114,236.00份，总确认份额为2,000,114,281.00份。上述有效净认购资金已划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金托管专户。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，鹏华基金管理有限公司（以下简称“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2026年

11月6日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

12、基金合同生效日：2026年11月6日

13、基金合同生效日的基金份额总额：2,000,114,281.00份

（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：深圳证券交易所深证上〔2026〕1521号

2、上市交易日期：2026年11月23日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基金简称：鹏华价值臻选主动管理ETF

场内简称：价值主动ETF鹏华

5、交易代码：158903

6、本次上市交易份额：2,000,114,281.00份

7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统揭示。

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、持有人结构及场内前十名持有人

（一）场内持有人户数

截至 2026 年 11 月 16 日，本基金场内份额持有人户数为 18,905 户，平均每户持有的基金份额为 105,798.16 份。

（二）场内持有人结构

截至 2026 年 11 月 16 日，本基金场内份额持有人结构如下：

机构投资者持有的场内基金份额为 230,596,331.00 份，占基金场内总份额的 11.53%；个人投资者持有的场内基金份额为 1,769,517,950.00 份，占基金场内总份额的 88.47%。

（三）前十名场内基金份额持有人情况

截至 2026 年 11 月 16 日，前十名场内基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额（份）	占基金场内总份额的比例
1	国信证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	22,673,165.00	1.13%
2	陈文平	20,001,651.00	1.00%
3	广西溥天建筑劳务有限公司	20,001,165.00	1.00%

4	张志刚	11,308,879.00	0.57%
5	中信信托有限责任公司－中信信托信赋共盈 2 号证券投资信托计划	10,000,776.00	0.50%
6	上海象限资产管理有限公司	10,000,291.00	0.50%
7	玄元私募基金投资管理（广东）有限公司－玄元科新 233 号私募证券投资基金	10,000,291.00	0.50%
8	泽元私募证券投资基金管理（广东）有限公司－泽元通宝 10 号私募证券投资基金	8,778,507.00	0.44%
9	泽元私募证券投资基金管理（广东）有限公司－泽元通宝 9 号私募证券投资基金	6,144,955.00	0.31%
10	格兰康希通信科技（上海）股份有限公司	6,000,408.00	0.30%

（四）截止到 2026 年 11 月 16 日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 0 份，占该基金总份额的比例为 0%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为 0 份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为 0 份。

五、 基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、名称：鹏华基金管理有限公司

2、法定代表人：张纳沙

3、总经理：邓召明

4、注册资本：1.5亿元人民币

5、注册地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层

6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]31号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：914403007084707880

8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

9、存续期间：持续经营

10、股东及其出资比例：公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。

11、内部组织结构及职能：

权益投资一部

负责公司权益类公募基金、社保养老及专户组合的投资管理

权益投资二部

负责公司权益类公募基金、社保养老及专户组合的投资管理

权益投资三部

负责公司权益类公募基金、社保养老及专户组合的投资管理

稳定收益投资部

负责公司稳定收益类公募基金及专户组合的投资管理

指数与量化投资部

负责量化公募基金、社保养老及专户组合投资研究工作

债券投资一部

负责公司固定收益类产品（包括公募基金、社保养老及专户组合）的研究与投资

债券投资二部

负责公司固定收益类产品（包括公募基金、社保养老及专户组合）的研究与投资

混合资产投资部

负责公司固定收益类产品（包括公募基金、社保养老及专户组合）的研究与投资

现金投资部

负责公司固定收益类产品（包括公募基金、社保养老及专户组合）的研究与投资

多元资产投资部

负责公司固定收益类产品（包括公募基金、社保养老及专户组合）的研究与投资

固定收益研究部

负责公司固定收益类产品（包括公募基金、社保养老及专户组合）的研究与投资

研究部

负责行业及上市公司研究，为公司投资部门提供支持

指数与量化研究部

主要负责基础研究、观点输出、策略研发、指数创新等工作

集中交易室

负责完成基金经理/投资经理下达的投资指令，防范交易风险，提供投资建议和分析报告

国际业务部

负责 QDII 基金海外投资研究和 QFII 投顾业务开拓，研究分析相关国际业务产品

基础设施基金投资部

负责公司公募 REITS 的承揽承做、运营管理和投资研究等相关业务工作

资产配置与基金投资部

负责大类资产配置研究、FOF 基金投资管理

产品规划部

负责制定公司产品规划与发展策略，以及产品设计、产品管理和产品研究工作，完善公司产品线，丰富公司产品储备

监察稽核部

负责公司的监察稽核与内部审计、合规管理与法律事务、反洗钱、信息披露工作

风控管理部

负责投资风控，落实风险管理委员会的各项风险管理决策和风险管理制度，提出风险管理建议

党群行政部

负责公司党群行政工作

财务部

负责公司财务工作

办公室

负责公司股东会、董事会、监事会的会议组织和日常运作，公司重要业务会议的计划和组织，公司领导的日常服务，公司重大决策和领导批示的督办和执行，公司层面的战略研究、战略规划、战略管控

人力资源部

负责公司人力资源管理工作，包括但不限于岗位、薪酬、绩效、激励、招聘、培训、职业发展等

登记结算部

负责资产组合的估值、注册登记及资金清算业务，保障后台运作正常运行

金融科技部

负责公司信息技术系统开发、运行和维护，为公司战略和业务发展提供信息技术支持

市场发展部

负责基金销售组织、督导和支持，银行渠道管理、零售产品宣传等工作

总行部

负责银行总行的前台商务对接，开拓新的总部渠道（包括银行总行、保险公司总部等）以及相关中后台工作

客户关系管理中心

负责公司客户服务、客户投诉处理、营销支持、信息披露等工作

品牌管理部

负责公司品牌宣传、媒体管理、舆情管理、投资者教育、战略产品宣传等工作

机构理财部

负责开展公募基金机构直销、专户理财等各项机构业务的营销和服务工作

机构理财一部

负责开展公募基金机构直销、专户理财等各项机构业务的营销和服务工作，负责维护北方地区的银行客户

机构理财二部

负责开展公募基金机构直销、专户理财等各项机构业务的营销和服务工作，负责维护华东地区的银行客户

机构理财三部

负责开展公募基金机构直销、专户理财等各项机构业务的营销和服务工作，负责维护北方地区的非银客户

华南机构理财中心（企业客户发展部）

负责机构体系华南团队金融机构业务及全国企业客户业务

机构理财四部

负责开展公募基金机构直销、专户理财等各项机构业务的营销和服务工作，负责维护华东地区的非银客户

社保及养老金业务部

负责社保、基本养老金业务的服务与开拓工作，牵头企业年金及职业年金资格申请工作，同时参与社保及个人养老金政策与产品研究工作

电子商务部

负责公司电商平台的搭建、业务推广和公司网站、移动终端等平台的日常内容更新和运营维护，以及外部互联网金融业务合作及第三方销售机构的渠道管理工作

券商业务部

负责券商渠道的管理、开拓和基金销售工作

北京分公司

负责公司与北京地区各家银行、券商总部及国家相关部委的日常沟通、信息反馈工作

北方营销中心

贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护北京、河北、山西、天津、内蒙古及东北区域营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务

上海分公司

贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护上海、浙江、江西及周边区域营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务

武汉分公司

贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护江苏、山东、安徽、湖北、河南区域营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务

华南营销中心

贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护深圳、福建、湖南、海南、西北（陕西、甘肃、宁夏、青海）等区域营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务

广州分公司

贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护广东区域（除深圳）、广西、贵州、云南、四川、重庆、新疆及西藏等营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务

12、人员情况

截至 2026 年 6 月 30 日，公司共有员工 680 人，其中，博士：占比 3.2%；硕士：占比 79.5%；本科：占比 16.3%；大专及以下：占比 1.0%。

13、信息披露负责人及咨询电话

高永杰 0755－81395402

14、本基金基金经理

陈鸿旭先生，国籍中国，理学硕士，5 年证券从业经验。2021 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任量化及衍生品投资部助理量化研究员、量化研究员、资深量化研究员，现担任指数与量化投资部基金经理。2026 年 04 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2026 年 04 月至今担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 05 月至今担任鹏华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 05 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2026 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2026 年 11 月至今担任鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金经理，2026 年 11 月至今担任鹏华上证综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，陈鸿旭先生具备基金从业资格。

张华恩先生，国籍中国，经济学硕士，15 年证券从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师、海通证券股份有限公司分析师、平安证券股份有限公司分析师。2017 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、投资经理，现担任研究部副总经理/基金经理。2020 年 08 月至今担任鹏华价值驱动混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月至今担任鹏华价值优势混合型证券投资基金（LOF）基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华品质甄

选混合型证券投资基金基金经理，2026 年 11 月至今担任鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金经理，张华恩先生具备基金从业资格。

（二）基金托管人

（1）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：廖林

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

联系人：郭明

联系电话：（010）66105799

（2）主要人员情况

截至 2025 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 209 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（3）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、 QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至

2025 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1481 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续二十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 96 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：隋强

联系人：丁志勇

电话：0755-25941405

传真：0755-25987133

（四）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：陈臻

电话：（021）31358666

传真：（021）31358666

联系人：陈颖华

经办律师：陈颖华、吴曹圆

（五）会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国北京 东长安街 1 号 东方广场毕马威大楼 8 层

法定代表人：邹俊

办公室地址：中国北京 东长安街 1 号 东方广场毕马威大楼 8 层

联系电话：(0755)2547 1000

传真：(0755)8266 8930

联系人：蔡正轩

经办会计师：叶凯韵、叶云晖

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 2026 年 11 月 16 日资产负债表如下：

资 产	2026 年 11 月 16 日	负债和净资产	2026 年 11 月 16 日
	余额		余额
资 产 ：		负债:	
货币资金	765,716,968.94	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	1,250,452,480.81	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	1,250,452,480.81	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	547,482.19
资产支持证券投资	-	应付托管费	82,122.34
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	-

资产支持证券投资	-	负债合计	629,604.53
其他投资	-		
其他债权投资	-		
其他权益工具投资	-		
应收清算款	-		
应收股利	-		
应收申购款	-		
递延所得税资产	-		
其他资产	141,217.97		
		净资产:	
		实收基金	2,000,114,281.00
		其他综合收益	-
		未分配利润	15,566,782.19
		净资产合计	2,015,681,063.19
资产总计:	2,016,310,667.72	负债和净资产总计:	2,016,310,667.72

八、 基金投资组合

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

截至 2026 年 11 月 16 日，本基金的投资组合如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 （元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,250,452,480.81	62.02
	其中：股票	1,250,452,480.81	62.02
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	765,716,968.94	37.98
8	其他各项资产	141,217.97	0.01
9	合计	2,016,310,667.72	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末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	22,085,100.00	1.10
B	采矿业	82,965,787.00	4.12
C	制造业	362,943,029.00	18.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,023,647.00	2.13
E	建筑业	43,844,728.00	2.18
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	56,594,311.00	2.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,264,747.51	0.91
J	金融业	607,351,359.30	30.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,379,772.00	0.66
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	1,250,452,480.81	62.04

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	1,171,500.00	64,022,475.00	3.18
2	600036	招商银行	1,430,800.00	62,096,720.00	3.08
3	000333	美的集团	658,700.00	61,048,316.00	3.03
4	601939	建设银行	3,788,700.00	46,449,462.00	2.30
5	601288	农业银行	5,172,500.00	39,259,275.00	1.95
6	601166	兴业银行	1,900,300.00	38,215,033.00	1.90
7	002142	宁波银行	918,400.00	32,355,232.00	1.61
8	600030	中信证券	1,212,030.00	30,531,035.70	1.51
9	601328	交通银行	3,361,200.00	29,309,664.00	1.45
10	600919	江苏银行	2,001,600.00	26,921,520.00	1.34

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（十一）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

招商银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

建设银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局的处罚。

农业银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

兴业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

宁波银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局宁波监管局、中国人民银行宁波市分行的处罚。

交通银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

江苏银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

2、基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

3、其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	125,146.51
7	待摊费用	16,071.46
8	其他	-
9	合计	141,217.97

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前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、深圳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

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

(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、基金合同的规定,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有重大违规行为,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

本基金无上市推荐人。

十三、 备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会准予鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金募集的文件

2、中国证监会关于鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金备案确认的文件

3、《鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金合同》

4、《鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金托管协议》

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

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司。

（三）查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（www.phfund.com.cn）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788533。

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、招募说明书、基金产品资料概要。敬请投资者注意投资风险。

鹏华基金管理有限公司

2026年11月18日

附件：鹏华价值臻选主动管理交易型开放式股票证券投资基金基金合同摘要

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）交纳基金认购款项、应付申购对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利、义务

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

（1）依法募集资金；

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

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

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

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

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

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

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资所产生的权利；

（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等业务；

（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、证券经纪机构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、赎回等业务规

则；

（17）若本基金采用证券经纪机构交易结算模式，基金管理人有权选择代表本基金进行场内交易、作为结算参与人代理本基金进行结算的证券经纪机构，并与基金托管人一同与选择的证券经纪机构签订证券经纪服务协议；本基金管理人亦有权决定本基金证券交易模式的转换；

（18）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、申购对价、赎回对价和注销价格的方法符合《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，向监管机构、司法机关等有权机关，以及审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不少于法律法规的规定；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户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，向监管机构、司法机关等有权机关，以及审计、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；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不少于法律法规的规定；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）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。本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置和相关规则按照法律法规的有关规定进行。

若本基金推出本基金的联接基金，则：

鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额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。

（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，法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

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

（9）变更基金投资目标、范围或策略；

（10）变更基金份额持有人大会程序；

（11）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

（13）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（2）调整本基金的申购费率或变更收费方式；

（3）增加、减少、调整基金份额类别设置；

（4）基金管理人、相关证券交易所、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；

（5）经依法履行适当程序，基金推出新业务或服务；

（6）因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记机构的相关业务规则以及中国证监会的相关规定发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（7）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；

（8）调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；调整申购赎回清单的内容、申购赎回清单计算和公告时间或频率；

（9）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额

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

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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书面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基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。

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

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；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。基金份额持有人亦可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、监管机构另有规定或本基金合同另有约定的，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 2 日内在规定媒介上公告。

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，基金管理人按照《信息披露办法》的规定公告后，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、每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配采用现金方式；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、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；

5、法律法规、监管机关、登记机构、证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可在依法履行适当程序后，调整基金收益分配原则和支付方式。

（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，由基金管理人在 2 日内在规定媒介公告。

（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、《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；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费、诉讼费、公证费和认证费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券等交易、结算费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金相关账户的开户费用及维护费用；

9、基金的上市初费及年费、登记结算费用、IOPV 计算与发布费用；

10、收益分配中发生的费用；

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 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.00%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支取的，支取日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3－11 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、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、基金财产的投资目标、投资范围和投资限制

（一）投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主

板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许发行的股票、存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于债券、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款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的相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的80%。

如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，经基金管理人依法履行适当程序后以变更后的比例为准。

（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）本基金投资于股票（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 80%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（4）本基金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%；

（5）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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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；

（9）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；

（10）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（11）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；

（12）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；

（13）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（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）本基金是主动 ETF，需遵守下列要求：

a.本基金持有的证券数量不低于 30 只；

b.本基金持有的前 10 大证券市值权重占比合计不超过基金资产净值的 60%；

c.本基金持有的股票最近 1 年日均成交金额应当位于其所在证券交易所全部上市股票的前 80%；

如未来《主动 ETF 业务指引》发生修改，本基金将做相应调整且不需召开基金份额持有人大会；

（16）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（8）、（11）、（12）项情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在依法履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

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。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在依法履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

六、基金净值信息的计算方法和公告方式

（一）基金净值信息的计算方法

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）基金净值信息的公告方式

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

在开始办理基金份额申购或者赎回后或基金份额上市交易的，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、基金合同变更和终止的事由、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基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

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，经依法履行相关程序后，《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 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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、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》终止情形出现且基金财产清算小组成立后，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财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法律法规的规定。

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，如经友好协商未能解决的，任何一方均应将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有裁定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同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（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区法律和台湾地区的有关规定）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》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。