# 易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）上市交易公告书

**基金管理人:易方达基金管理有限公司**
**基金托管人:中国工商银行股份有限公司**
**基金登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司**
**上市地点:上海证券交易所**
**上市日期:2019年6月25日**
**公告日期:2019年6月20日**

一、重要声明与提示

易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）上市交易公告书（以下简称“本报告”）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,易方达基金管理有限公司（以下简称“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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本报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。凡本报告未涉及的有关内容,请详细阅读2019年5月25日刊登在《中国证券报》以及基金管理人网站（www.efunds.com.cn）上的《易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）。

二、基金概览

1.基金二级市场交易简称:225ETF。
2.二级市场交易代码:513000。
3.基金申购、赎回简称:225ETF。
4.申购、赎回代码:513001。
5.2019年6月18日基金份额总额:508,411,379.00份。
6.2019年6月18日基金份额净值:1.0002元。
7.本次上市交易份额:508,411,379.00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:2019年6月25日。
10.基金管理人:易方达基金管理有限公司。
11.基金托管人:中国工商银行股份有限公司。
12.基金登记结算机构:中国证券登记结算有限责任公司。
13.上市推荐人:广发证券股份有限公司。
14.目前,本基金的申购赎回代办券商为:广发证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司。若有新增本基金的申购赎回代办券商,基金管理人将另行公告。

基金管理人可根据情况变更申购赎回代办券商,并及时公告。

8.本次上市交易份额:508,411,379.00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2019年6月18日,本基金份额持有人户数为2,721户,平均每户持有的基金份额为186,847.25份。

（二）持有人结构

截至2019年6月18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209,520,379.00份,占基金总份额的41.21%;个人投资者持有的基金份额为298,891,000.00份,占基金总份额的58.79%。

（三）前十名基金份额持有人的情况:

截至2019年6月18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） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 易方达基金管理有限公司 | 50,006,000.00 | 9.84% |
| 2 | 夏多奇 | 12,000,000.00 | 2.36% |
| 3 | 蒋娜 | 11,000,000.00 | 2.16% |
| 4 | 广州腾冠投资合伙企业（有限合伙） | 10,000,000.00 | 1.97% |
| 5 | 财富证券有限责任公司 | 8,000,960.00 | 1.57% |
| 6 | 财富证券－广州农商行－财富证券畅盈9号集合资产管理计划 | 8,000,960.00 | 1.57% |
| 7 | 东兴证券股份有限公司 | 8,000,459.00 | 1.57% |
| 8 | 中信证券股份有限公司 | 8,000,000.00 | 1.57% |
| 9 | 恒泰证券股份有限公司 | 8,000,000.00 | 1.57% |
| 10 | 东北证券股份有限公司 | 8,000,000.00 | 1.57% |
| 11 | 金元顺安基金－南京银行－海通证券股份有限公司 | 8,000,000.00 | 1.57% |
| 12 | 王贺 | 8,000,000.00 | 1.57% |
| 13 | 中信建投证券股份有限公司 | 8,000,000.00 | 1.57% |

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1. 名称:易方达基金管理有限公司
2. 法定代表人:刘晓艳
3. 总裁:刘晓艳
4. 注册资本:12,000万元人民币
5. 注册地址:广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）
6. 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼
7. 设立批准文号:证监基金字[2001]4号
8. 工商登记注册号:企业法人营业执照文号:914400007279786660D
9. 经营范围:从开展集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理
10. 股权结构:广东粤财信托有限公司,持有股份25%;广发证券股份有限公司,持有股份25%;盈峰投资控股集团有限公司,持有股份25%;广东省广晟资产经营有限公司,持有股份16.67%;广州市广永国有资产经营有限公司,持有股份8.33%。
11. 内部组织结构及部门

自成立以来,公司不断致力于健全公司治理结构,严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求,建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构,保持公司规范运作,维护基金份额持有人的利益。

公司下设44个部门:权益投资管理部、投资一部、投资二部、投资三部、研究部、固定收益投资部、现金管理部、固定收益组合管理部、固定收益研究部、固定收益交易部、混合资产投资部、华金投资部、指数管理总部、量化投资部、国际投资部、多资产投资部、机构客户总部、渠道与营销管理总部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、大连分公司、互联网金融部、客户服务与销售支持总部、全球投资客户部、养老金部、实体经济服务部、投资风险管理部、监察与合规管理总部、公司法律事务部、综合管理部、公司财务中心、技术运营部、系统研发部、系统规划实施部、金融科技部、核算部、集中交易室、数据信息支持部、宣传策划部、注册登记部、投资发展部、人力资源部。

1) 权益投资管理部负责主动权益类投资产品的管理工作。
2) 投资一部以团队形式负责所辖资产的投资管理工作。
3) 投资二部以团队形式负责所辖资产的投资管理工作。
4) 投资三部以专注于“长期投资有持续内生增长能力的价值型个股”的投资策略,以紧密团队合作的形式,负责该种策略下各类产品的投资管理工作。
5) 研究部负责对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种的研究。
6) 固定收益投资部负责债券类基金、专户的投资管理工作。
7) 现金管理部负责货币类以及短期理财类基金的投资管理工作。
8) 固定收益组合管理部负责固定收益纯债类组合、混合多策略组合、现金管理类组合的账户运作支持工作。
9) 固定收益研究部负责固定收益类投资品种的研究。
10) 固定收益交易部负责固定收益类投资品种的交易。
11) 混合资产投资部负责混合策略类基金、专户的投资管理工作。
12) 年金投资部负责企业年金、职业年金的投资管理工作。
13) 指数管理总部下设指数投资部、解决方案部、负责指数及SmartBeta产品的投资、研究、推广、运作及风险管理相关工作。
14) 量化投资部负责量化类公募基金及专户的投资、研究、运作及风险管理的相关工作。
15) 国际投资部负责管理和发展公司ODII、RODII以及其他境外证券市场投资业务,参与相关产品设计,配合客户服务工作,同时担当易方达公司境内和境外投资研究体系互动和交流的桥梁。
16) 多资产投资部负责跨区域、跨类别的多种资产的研究和投资管理工作。
17) 机构客户总部负责公司机构客户的销售和服务工作,下设银行客户部、非银行客户部两个二级部门,分别负责所属客户群体的销售和服务工作。
18) 渠道与营销管理总部下设渠道部、营销部,负责各类基金代销机构的合作开发及总部层面的维护工作;营销策划方案的制订、推动,营销效果及客群的数据挖掘、分析;公司产品宣传材料制作。
19) 北京分公司负责以北京为中心的华北地区的渠道销售和服务工作。
20) 上海分公司负责以上海为中心的华东地区的渠道销售和服务工作。
21) 广州分公司负责以广州为中心的华南地区的渠道销售和服务工作。
22) 成都分公司负责以成都为中心的西南西北地区的渠道销售和服务工作。
23) 大连分公司负责以大连为中心的东北及山东地区的渠道销售和服务工作。
24) 互联网金融部负责研发基于互联网的交易模式和服务模式,建设相应系统并持续改进用户体验,开展互联网金融业务的营销策划、方案制作、方案实施及对外的合作洽谈,负责公司网站及App建设、维护,为互联网上的客户提供服务等工作。
25) 客户服务与销售支持总部下设客户服务部、销售支持部,负责销售支持工作,为渠道、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持。
26) 全球投资客户部负责执行公司在国际市场的战略目标和定位,开拓国际市场客户,促进公司产品的境外销售,管理和维护客户关系;甄选公司的国际合作投资顾问,对其服务和产品进行管理。
27) 养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。
28) 实体经济服务部直接为实体经济服务。
29) 投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估,投资与市场的相关数据支持服务工作。
30) 监察与合规管理总部下设合规风控部、合规内审部,负责独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督,协助并督促各部门履行内控职责,确保公司各项经营活动稳合规,实现公司经营目标。
31) 公司法律事务部负责处理与公司运营相关的法律文件审核、法务咨询等事务（含母子公司等集团法律事务）,有效的范法律风险,保障公司合法合规经营。
32) 综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作,负责公司行政保卫和文书档案等工作。
33) 公司财务中心负责公司财务管理业务。
34) 技术运营部负责公司IT基础设施的规划与建设,公司日常运营的技术支持与服务,保障公司信息系统安全可靠高效运行。
35) 系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试,以及上线运营后的应用支持工作。
36) 系统规划实施部负责公司信息系统的规划和架构,规范指导公司信息系统的建设。
37) 金融科技部通过研究人工智能、大数据等创新技术,推动智能技术与公司业务的融合及智能化成果在公司的应用,推进相关项目的建设实施运营。
38) 核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作,负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作,以及各银行账户的管理工作。
39) 集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作,保存交易记录,备份交易数据。
40) 数据信息支持部负责参与公司数据中心的建设与应用,负责产品运作中跨部门数据的制作或统稿报送、产品生命周期中特殊事项的支持以及部分基金信息披露材料的牵头制作等工作。
41) 宣传策划部负责制作宣传材料,传播公司信息,管理媒体关系,管理广告投放等。
42) 注册登记部负责进行开放式基金、特定多个客户资产管理计划及养老金产品的注册登记业务。
43) 投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发;为市场营销工作提供专业支持。
44) 人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施,具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。
12. 人员情况

截至2019年3月31日,本公司有正式员工735人,硕士及以上学历人员占比76%,其中527人具有硕士研究生学历,29人具有博士研究生学历。

13. 信息披露负责人:张南

电话:020-85102688

14. 基金管理业务介绍

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于2001年4月17日,总部设在广州,在北京、上海、香港、深圳、成都、大连等地设有办公场所,并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下,通过市场化、专业化的运作,为投资人的资产实现持续稳定的保值增值,成为国内领先的综合性资产管理机构,具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一,拥有公募、社保、年金、专户、QDII、QFII、RQFII、保险资金委托投资、基本养老保险基金投资等业务资格,投资业务包括主动权益、指数量化、固定收益、国际投资、多资产投资、另类投资等六大板块,为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至2019年3月31日,易方达的总资产管理规模达到1.3万亿元,其中公募基金管理规模7207亿元。

15. 本基金基金经理

FAN BING(范冰)先生,商学硕士。曾任里家加拿大银行托管部核算专员,美国道富集团Middle Office中台交易支持专员,巴克莱资产管理公司悉尼金融数据国高级金融数据分析员、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管,贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理。现任易方达基金管理有限公司对冲基金产品管理部基金经理、易方达标普全球高端消费品指数证券投资基金基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普500指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普生物科技指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达纳斯达克100指数证券投资基金(QDII) 基金经理（自2017年3月25日起任职）、易方达MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2018年5月17日起任职）、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2019年1月18日起任职）、易方达MSCI中国A股国际通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（自2019年3月13日起任职）、易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（自2019年6月12日起任职）。

余海燕女士,经济学硕士。曾任汇丰银行Consumer Credit Risk信用风险分析师,华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理,易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。现任易方达基金管理有限公司易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2013年9月23日起任职）、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2014年6月26日起任职）、易方达沪深300非银行金融发起式联接基金基金经理（自2015年1月22日起任职）、易方达上证50指数分级证券投资基金基金经理（自2015年4月15日起任职）、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理（自2015年6月15日起任职）、易方达军工指数分级证券投资基金基金经理（自2015年7月8日起任职）、易方达证券公司指数分级证券投资基金基金经理（自2015年7月8日起任职）、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（自2016年4月16日起任职）、易方达中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2016年4月16日起任职）、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理（自2016年4月16日起任职）、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年1月4日起任职）、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年7月14日起任职）、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年7月27日起任职）、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2017年11月22日起任职）、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理（自2018年5月11日起任职）、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2018年8月11日起任职）、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2019年1月18日起任职）、易方达中证500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（自2019年3月20日起任职）、易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（自2019年6月12日起任职）。

（二）基金经理人情况

1. 基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1994年1月1日

法定代表人:陈四清

注册资本:人民币34,932,123.46万元

基金托管业务批准文号:中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

联系电话:010-66105799

信息披露负责人:廖明

资产托管部负责人:李勇

2.主要人员情况

截至2019年3月,中国工商银行资产托管部共有员工208人,平均年龄33岁,96%以上员工拥有大学本科以上学历,商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控控制体系,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、ECROW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2019年3月,中国工商银行共托管证券投资基金945只。自2003年以来,本行连续十六年获得香港《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65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）上市推荐人

广发证券股份有限公司

注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

客户服务电话:95575或02095575

网址:www.gf.com.cn

1.广发证券股份有限公司

注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

客户服务电话:95575或02095575

网址:www.gf.com.cn

2.国盛证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼

办公地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大厦

法定代表人:徐丽峰

联系人:占文驰

联系电话:0791-86283372

客户服务电话:4008-222-111

传真:0791-86281305

网址:www.gszq.com

3.华泰证券股份有限公司

注册地址:南京市江东中路228号

办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人:周易

联系人:施晓芸

联系电话:0755-82492193

客户服务电话:95597

传真:0755-82492962

网址:www.htsc.com.cm

4.中国银河证券股份有限公司

注册地址: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号国际企业大厦C座

法定代表人:陈共炎

联系人:宋国政

联系电话:010-83574507

客户服务电话:4008-888-888或95551

传真:010-66568532

网址:www.chinastock.com.cn

5.招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路111号

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

联系人:黄婵君

联系电话:0755-82943666

客户服务电话:95565,400-8888-111

传真:0755-82943636

网址:www.newone.com.cn

（五）基金验资机构

会计师事务所:安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

主要经营场所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人:Tony Mao 毛毅宁

电话:(010)58153000

传真:(010)85188298

经办注册会计师:赵雅、马婧

联系人:赵雅

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

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

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

| 本基金截至2019年6月18日的资产负债表如下: | 本报告期末（2019年6月18日;单位:人民币元） |
|---|---|
| 资 产: | |
| 银行存款 | 508,384,899.00 |
| 结算备付金 | – |
| 存出保证金 | – |
| 交易性金融资产 | 2,781,723.50 |
| 其中:股票投资 | – |
| 债券投资 | – |
| 资产支持证券投资 | – |
| 基金投资 | 2,781,723.50 |
| 衍生金融资产 | – |
| 买入返售金融资产 | – |
| 应收证券清算款 | – |
| 应收利息 | 72,444.82 |
| 应收股利 | – |
| 应收申购款 | – |
| 其他资产 | 124,412.36 |
| 资产合计 | 511,363,479.68 |
| 负债和所有者权益: | |
| 短期借款 | – |
| 交易性金融负债 | – |
| 衍生金融负债 | – |
| 卖出回购金融资产款 | – |
| 应付证券清算款 | 2,803,278.87 |
| 应付赎回款 | – |
| 应付管理人报酬 | 16,719.19 |
| 应付托管费 | 4,179.80 |
| 应付销售服务费 | – |
| 应付交易费用 | – |
| 应付税费 | – |
| 应付利息 | – |
| 应付利润 | – |
| 其他负债 | 2,236.19 |
| 负债合计 | 2,826,414.05 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 508,411,379.00 |
| 未分配利润 | 125,686.63 |
| 所有者权益合计 | 508,537,065.63 |
| 负债与持有人权益合计: | 511,363,479.68 |

八、基金投资组合

截至2019年6月18日,本基金的投资组合情况如下:

（一）报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | – | – |
| | 其中:普通股 | – | – |
| | 存托凭证 | – | – |
| | 优先股 | – | – |
| | 房地产信托 | – | – |
| 2 | 基金投资 | 2,781,723.50 | 0.54 |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中:债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 金融衍生品投资 | – | – |
| | 其中:远期 | – | – |
| | 期货 | – | – |
| | 期权 | – | – |
| | 权证 | – | – |
| 5 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 6 | 货币市场工具 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 508,384,899.00 | 99.42 |
| 8 | 其他资产 | 196,857.18 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 511,363,479.68 | 100.00 |

（二）报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金于2019年6月18日未持有股票及存托凭证。

（三）报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金于2019年6月18日未持有股票及存托凭证。

（四）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及存托凭证投资明细

本基金于2019年6月18日未持有股票及存托凭证。

（五）报告期末按债券品种划分的债券投资组合

本基金于2019年6月18日未持有债券。

（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五名债券投资明细

本基金于2019年6月18日未持有债券。

（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十名资产支持证券投资明细

本基金于2019年6月18日未持有资产支持证券。

（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金融衍生品投资明细

本基金于2019年6月18日未持有金融衍生品。

（九）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | NIKKO ETF－NKY 225 | ETF基金 | 开放式 | Nikko Asset Management Co.,Ltd. | 2,781,723.50 | 0.55 |

（十）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没有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。

2.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。

3.其他各项资产构成

| 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 | 72,444.82 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | 124,412.36 |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 196,857.18 |

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于2019年6月18日未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2019年6月18日未持有股票。

九、重大事件揭示

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

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺:

（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。

（四）除法律法规、基金合同规定的情况下,未经基金托管人书面同意,基金管理人不从事任何以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。

（五）保证基金管理人与基金托管人就基金签订的与基金有关的重大合同及有关文件,按时、准确、完整地履行其应有的责任和义务,及时通知基金托管人。

（六）按规定开设基金证券账户、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。

（七）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;

（八）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值;

（九）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、半年度和年度基金报告出具意见,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,还应当说明基金管理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）建立并保存基金份额持有人名册;

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

（17）参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

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

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

（20）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）根据《基法法》、《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,并在文件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）根据《基法法》、《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;

（22）保护基金份额持有人利益,按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督,如发现投资指令或资金汇出入违法、违规,应当及时向中国证监会、外管局报告;

（23）每月结束后7个工作日内,向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况,并按相关规定进行国际收支申报;

（24）基金托管人应办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务;

（25）基金托管人应保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料,其保存的时间应当不少于20年;

（26）按照有关法律法规、《基金合同》的规定以受托人名义或指定的代理人名义登记资产;

（27）确保基金按照有关法律法规、《基金合同》约定的投资范围和限制进行管理;

（28）确保基金根据有关法律法规、《基金合同》确定并实施收益分配方案;

（29）确保基金按照有关法律法规、《基金合同》的规定进行认购、申购、赎回等日常交易;

（30）对基金的境外财产,基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责,境外托管人在履行职责过程中,因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的,基金托管人承担相应责任;

（31）法律法规及中国证监会、外管局规定的和《基金合同》约定的其他义务。

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。

本基金份额持有人大会暂不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的,以届时有效的法律法规为准。

（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（法律法规和中国证监会另有规定的除外）,但由于标的ETF基金交易方式变更、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外;

（9）变更基金份额持有人大会程序;

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

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

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

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

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

（1）法律法规要求增加的基金费用的收取;

（2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;

（3）因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记结算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重大变化;

（5）调整有关认购、申购、赎回、交易、非交易过户、质押等业务规则（包括申购赎回清单的调整、开放时间的调整等）,或证券交易所和登记结算机构调整上述业务规则;

（6）在基金管理人、基金托管人、提名新的基金管理人、基金托管人不派代表参加基金份额持有人大会的情况下,可以进行基金份额持有人大会议程;

（7）选择、更换境外托管人,可授权境外托管人代为履行其承担的受托人职责;

（8）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2,根据《基法法》、《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）以域实信用、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,具有符合要求的管理业务所需帐户、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）保管基金财产的其他义务。

（6）按照有关法律法规,在基金合同项下的与基金有关的重大合同及有关文件,按时、准确、完整地履行其应有的责任和义务,及时通知基金托管人。

（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;

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值;

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,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,还应当说明基金管理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）建立并保存基金份额持有人名册;

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

（17）参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

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

（19）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;

（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）执行生效的基金份额持有人大会的决议;

（22）保护基金份额持有人利益,按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督,如发现投资指令或资金汇出入违法、违规,应当及时向中国证监会、外管局报告;

（23）每月结束后7个工作日内,向中国证监会和外管局报告基金管理人境外投资情况,并按相关规定进行国际收支申报;

（24）基金托管人应办理基金管理人就管理本基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务;

（25）基金托管人应保存基金管理人就管理本基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料,其保存的时间应当不少于20年;

（26）按照有关法律法规、《基金合同》的规定以受托人名义或指定的代理人名义登记资产;

（27）确保基金按照有关法律法规、《基金合同》约定的投资范围和限制进行管理;

（28）确保基金根据有关法律法规、《基金合同》确定并实施收益分配方案;

（29）确保基金按照有关法律法规、《基金合同》的规定进行认购、申购、赎回等日常交易;

（30）对基金的境外财产,基金托管人可授权境外托管人代为履行其承担的职责,境外托管人在履行职责过程中,因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的,基金托管人承