中泰证券股份有限公司 首次公开发行股票发行结果公告

保荐机构（联席主承销商）：东吴证券股份有限公司
联席主承销商：安信证券股份有限公司 广发证券股份有限公司 西部证券股份有限公司

特别提示

中泰证券股份有限公司(以下简称"中泰证券"、"发行人")首次公开发行不超过69,686.2576万股人民币普通股(A股)(以下简称"本次发行")的申请已获中国证券监督管理委员会证监许可[2020]736号文核准。本次发行的保荐机构(联席主承销商)为东吴证券股份有限公司(以下简称"保荐机构(联席主承销商)"或"东吴证券"),联席主承销商为安信证券股份有限公司(以下简称"安信证券")、广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")和西部证券股份有限公司(以下简称"西部证券")(东吴证券、安信证券、广发证券和西部证券统称为"联席主承销商")。发行人的股票简称为"中泰证券",股票代码为"600918"。

本次发行采用网下向符合条件的投资者询价配售（以下简称"网下发行")和网上向持有上海市场非限售A股股份和非限售存托凭证市值的社会公众投资者定价发行(以下简称"网上发行")相结合的方式进行。经发行人和联席主承销商综合考虑发行人基本面、所处行业、可比公司估值水平、市场环境、募集资金需求、每股净资产及承销风险等因素,协商确定本次发行价格为4.38元/股,发行数量为696,862,576股,全部为新股发行,无老股转让。

回拨机制启动前,本次网下初始发行数量为487,812,576股,为本次发行数量的70.00%；网上初始发行数量为209,050,000股，为本次发行数量的30.00%。回拨机制启动后,网下最终发行数量为69,685,576股,占本次发行数量的10.00%;网上最终发行数量为627,177,000股,占本次发行总量90.00%。

本次发行的网上网下认购缴款工作已于2020年5月22日（T+2日)结束。

一、新股认购情况统计

联席主承销商根据上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司上海分公司(以下简称"中国结算上海分公司")提供的数据,对本次网上、网下发行的新股认购情况进行了统计,结果如下：

(一)网上新股认购情况

1. 网上投资者缴款认购的股份数量(股)：625,383,443
2. 网上投资者缴款认购的金额(元)：2,739,179,480.34
3. 网上投资者放弃认购数量(股)：1,793,557
4. 网上投资者放弃认购金额(元)：7,855,779.66

(二)网下新股认购情况

1. 网下投资者缴款认购的股份数量(股)：69,624,668
2. 网下投资者缴款认购的金额(元)：304,956,045.84
3. 网下投资者放弃认购数量(股)：60,908
4. 网下投资者放弃认购金额(元)：266,777.04

放弃认购的网下投资者具体名单如下：

序号	投资者	配售对象	获配数量（股）	应缴纳金额（元）	放弃认购股数（股）
1	张建平	张建平	7,983	34,965.54	7,983
2	前海开源基金管理有限公司	前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金	14,487	63,453.06	14,487
3	庄小萍	庄小萍	7,983	34,965.54	7,983
4	林垂楚	林垂楚	7,983	34,965.54	7,983
5	腾龙科技集团有限公司	腾龙科技集团有限公司	7,983	34,965.54	7,983
6	凯石基金管理有限公司	凯石湛混合型证券投资基金	14,487	63,453.06	14,487

未足额缴款的网下投资者具体名单如下：

序号	投资者	配售对象	获配数量（股）	应缴纳金额（元）	实际缴纳金额（元）	实际配售数量（股）	放弃认购股数（股）
1	范径武	范径武	7,983	34,965.54	34,965.00	7,982	1
2	苏景成	苏景成	7,983	34,965.54	34,965.50	7,982	1

二、联席主承销商包销情况

网上和网下投资者放弃认购的股份全部由联席主承销商包销。联席主承销商包销股份的数量为1,854,465股,包销金额为8,122,556.70元,联席主承销商包销比例为0.27%。

2020年5月26日(T+4日),联席主承销商将余股包销资金与网下、网上投资者缴款认购的资金扣除保荐承销费后一起划给发行人。发行人将向中国结算上海分公司提交股份登记申请,将包销股份登记至联席主承销商指定证券账户。

三、联席主承销商联系方式

网上、网下投资者对本公告所公布的发行结果如有疑问,请与本次发行的联席主承销商联系。具体联系方式如下：

保荐机构(联席主承销商)：东吴证券股份有限公司
联系电话：0512-62936311、62936312、62936313
联系人：东吴证券资本市场部
联席主承销商：安信证券股份有限公司
联系电话：0755-82825446
联系人：安信证券资本市场部
联席主承销商：广发证券股份有限公司
联系电话：020-66338151、66338152
联系人：广发证券资本市场部
联席主承销商：西部证券股份有限公司
联系电话：010-68518078
联系人：西部证券资本市场部

发行人：中泰证券股份有限公司
保荐机构（联席主承销商）：东吴证券股份有限公司
联席主承销商：安信证券股份有限公司
联席主承销商：广发证券股份有限公司
联席主承销商：西部证券股份有限公司
2020年5月26日

常州市凯迪电器股份有限公司 首次公开发行股票网上定价发行结果公告

保荐机构（主承销商）：中信建投证券股份有限公司

常州市凯迪电器股份有限公司（以下简称"凯迪股份"或"发行人"）首次公开发行不超过1,250万股人民币普通股（A股）（以下简称"本次发行"）的申请已获中国证券监督管理委员会证监许可[2020]878号文核准。本次发行的保荐机构（主承销商）为中信建投证券股份有限公司（以下简称"保荐机构（主承销商）"）。发行人的股票简称为"凯迪股份",股票代码为"605288"。

本次发行采用网上按市值申购向社会公众投资者直接定价发行（以下简称"网上发行"）的方式进行,不进行网下询价和配售。发行人和保荐机构（主承销商）综合考虑发行人基本面、所处行业、可比公司估值水平、市场情况、募集资金需求及承销风险等因素,协商确定本次发行价格为92.59元/股,网上发行数量为1,250万股,占本次发行总量的100.00%。

本次发行的网上认购缴款工作已于2020年5月22日（T+2日）结束。

一、新股认购情况统计

保荐机构（主承销商）根据上海证券交易所和中国证券登记结算有限公司上海分公司（以下简称"中国结算上海分公司"）提供的数据,对本次网上发行的新股认购情况进行了统计,结果如下：

（1）网上投资者缴款认购的股份数量：12,404,334股
（2）网上投资者缴款认购的金额：1,148,517,285.06元
（3）网上投资者放弃认购数量：95,666股
（4）网上投资者放弃认购金额：8,857,714.94元

二、保荐机构（主承销商）包销情况

网上投资者放弃认购的股份全部由保荐机构（主承销商）包销。保荐机构（主承销商）包销股份数量合计为95,666股,包销金额为8,857,714.94元,保荐机构（主承销商）包销比例为0.77%。

2020年5月26日（T+4日）,保荐机构（主承销商）将余股包销资金与网上发行募集资金扣除承销保荐费后一起划给发行人,发行人向中国结算上海分公司提交股份登记申请,将包销股份登记至保荐机构（主承销商）指定证券账户。

三、保荐机构（主承销商）联系方式

网上投资者对本公告所公布的发行结果如有疑问,请与本次发行的保荐机构（主承销商）联系。具体联系方式如下：

联系人：资本市场部
联系电话：010-86451551、010-86451552

发行人：常州市凯迪电器股份有限公司
保荐机构（主承销商）：中信建投证券股份有限公司
2020年5月26日

股票代码：600387 股票简称：海越能源 公告编号：临2020-027

海越能源集团股份有限公司 关于解除违规担保事项的进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

一、担保情况概述

截止2020年5月19日，公司为控股股东及其关联方提供担保余额累计6.066亿元,具体金额详见下表：

被担保方	期末担保余额	担保方式	担保起始日	担保到期日
浙江海越科技有限公司	38,000,000.00	质押融资	2019年6月27日	2024年6月27日
浙江海越科技有限公司	25,000,000.00	质押融资	2019年6月28日	2024年6月28日
浙江海越科技有限公司	50,000,000.00	质押融资	2019年9月9日	2020年9月9日
浙江海越科技有限公司	53,000,000.00	质押融资	2019年9月11日	2020年9月11日
洋浦国兴工程建设有限公司	90,000,000.00	质押融资	2019年10月14日	2020年10月14日
洋浦国兴工程建设有限公司	95,400,000.00	质押融资	2019年10月15日	2020年10月15日
浙江海越科技有限公司	158,200,000.00	质押融资	2019年10月24日	2020年10月24日
上海海航物联网有限公司	97,000,000.00	质押融资	2020年3月26日	2021年3月25日

具体内容详见公司于2020年5月19日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的临2020-025公告。

二、解除担保情况

为尽快消除违规担保对公司的影响,经公司、公司控股股东及其关联方努力，已于2020年5月25日解除4.142亿元质押融资担保。截至本公告日,公司为控股股东及其关联方提供担保余额累计1.924亿元。

三、风险提示

公司控股股东及其关联方计划于2020年5月29日前解决剩余违规担保事项。自公司2019年年报披露之日起一个月内,公司为关联方提供的违规担保若未能解决的,可能存在公司股票触及上海证券交易所《股票上市规则》第13.4.1条第（五）条规定的其他风险警示的情况。

公司将关注相关进展情况并及时履行信息披露义务。敬请广大投资者关注公司公告,注意投资风险。

特此公告。

海越能源集团股份有限公司
董事会
二〇二〇年五月二十六日

证券代码：600556 证券简称：天下秀 公告编号：临2020-059

天下秀数字科技（集团）股份有限公司 关于延期回复上海证券交易所问询函的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

天下秀数字科技（集团）股份有限公司（以下简称"公司"）于2020年5月18日收到上海证券交易所上市公司监管二部下发的《关于天下秀数字科技（集团）股份有限公司2019年年度报告的信息披露监管问询函》（上证公函[2020]0516号）（以下简称"《问询函》"），并及时在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn)披露了《关于天下秀数字科技（集团）股份有限公司2019年年度报告的信息披露监管问询函》（公告编号：临2020-057）。《问询函》要求公司在2020年5月26日前对该《问询函》进行回复并予以披露。

公司收到《问询函》后高度重视,积极组织对《问询函》中涉及的问题进行逐项落实回复。鉴于《问询函》中相关问题尚需进一步核实和补充完善,并需要相关中介机构出具意见。为确保回复的真实性、准确性和完整性，经向上海证券交易所申请，公司将延期回复《问询函》。公司正在加快落实、推进相关工作,将于2020年6月2日前向上海证券交易所回复并予以披露。

公司指定的信息披露媒体为《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn),敬请广大投资者及时关注公司公告,注意投资风险。

特此公告。

天下秀数字科技（集团）股份有限公司
董事会
二〇二〇年五月二十六日

（上接A69版）

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

（1）修改《基金合同》的重要内容或者终止《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）终止基金上市,但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；
（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、在不违反法律法规和基金合同的规定,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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、调低赎回费率或变更收费方式、调整基金份额类别的设置；
（3）因相应的法律法规、证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
（4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
（5）基金推出新业务或服务；
（6）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、收益分配、非交易过户等业务规则；
（7）标的指数更名或调整指数编制方法,变更业绩比较基准；
（8）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；
（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,在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知至少载明以下内容：

（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和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、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、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（法律法规或中国证监会另有规定的除外）、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2.议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。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）本部分对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的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金收益分配原则

1、基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到0.1%以上时,基金管理人可进行收益分配;

2、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。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除息后的基金份额净值低于面值;

3、本基金的收益分配采取现金分红的方式;

4、《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

5、每一基金份额享有同等分配权;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对持有人利益无实质性不利的影响下,基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整,并及时公告。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、支付方式等内容。

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2日内在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

（四）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、基金的指数许可使用费及数据使用费；
4、基金上市费及年费、登记结算费用、IOPV计算与发布费用；
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券、期货交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资费、证券相关账户费用及其他类似性质的费用等）；
9、基金的银行汇划费用；
10、账户开户费用和账户维护费；
11、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5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、公休假或不可抗力等,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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.05%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。

3、基金合同生效后的指数许可使用费及数据使用费

本基金作为指数基金,需根据与中债金融估值中心有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中债金融估值中心有限公司支付指数许可使用费及数据使用费。费用的计算方法及支付方式详见招募说明书及相关公告。

若中债金融估值中心有限公司与基金管理人对指数许可使用费及数据使用费的费率及支付方式另有约定的,从其最新约定。

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

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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

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

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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%,年化跟踪误差不超过3%。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好的实现投资目标,本基金还可投资于其他债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、国债期货、信用衍生品、银行存款（包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款）、同业存单、资产支持证券、债券回购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）。本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产的80%,且不低于非现金基金资产的80%。

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。

（三）投资策略

本基金为被动管理基金,主要采用代表性分层抽样复制策略,投资于标的指数中具有代表性的部分成份券,或选择非成份券作为替代,使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。

1、债券指数化投资策略

（1）组合构建策略

构建投资组合的过程主要分为3步:指数成份券流动性筛选、确定目标组合和逐步调整建仓。

①指数成份券流动性筛选:通过相关定量和定性指标,筛选具有较好流动性的指数成份券作为组合备选券。

②确定目标组合:使用代表性分层抽样法确定各备选券权重,使组合总体特征与指数相似。

③逐步调整建仓:根据市场实际流动性情况和投资机会,进一步调整和优化组合并逐步建仓。

在一般情况下,本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产的80%。本基金将在基金合同生效之日起6个月内达到这一投资比例。此后,如因标的指数编制规则调整、债券利息税等其他原因,导致基金跟踪偏离度或跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

（2）债券投资组合的调整

①定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份债券的调整而进行相应调整。

②不定期调整

a）基金管理人将基于久期、权重、信用等级、期限分布匹配的基础上,综合考虑样本券流动性、交易规模等因素,对债券投资组合进行动态抽样调整,以期实现对标的指数的有效跟踪。

b）若成份券遇到包括但不限于债券还本派息、退市、流动性不足、债券到期等法规限制或组合优化需要等情况,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

（3）替代性策略

当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因,导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时,基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合,对标的指数进行跟踪复制。替代组合的构建将以债券流动性为约束条件,按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则,控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。构建替代组合的方法如下：

①按照与被替代债券久期、信用评级相似的原则,在其他可投资标的中选择成份券替代券;

②根据成份券替代券个券过去较长一段时间的历史数据,分析其与被替代债券的相关性,选择正相关度较高的债券进一步考察;

③分析上述债券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券,从而使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

（4）跟踪误差目标

在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%,年化跟踪误差不超过3%。如因标的指数编制规则调整、债券利息税等其他原因，导致基金跟踪偏离度或跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,将跟踪偏离度和跟踪误差控制在约定范围内。

2、其他债券投资策略

对于非成份券的债券,本基金综合运用久期管理策略、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外,本基金债券投资将适当运用杠杆策略,通过债券回购融入资金,然后买入收益率更高的债券以获得收益。

①久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素,确定组合的整体久期,有效控制基金资产风险。

②收益率曲线策略是指在确定组合久期以后,根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理,确定组合期限结构的分布方式,合理配置不同期限品种的配置比例。

③类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上,根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重,即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。

3、资产支持证券投资策略

本基金将选择相对价值低估的资产支持证券类属或个券进行投资,并通过期限和品种的分散投资降低组合投资资产支持证券的信用风险、提前偿付风险、利率风险和流动性风险等。同时,依靠纪律化的投资流程和一体化的风险预算机制控制并提高投资组合的风险调整收益。

4、衍生品投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

本基金在进行信用衍生品投资时,将根据风险管理原则,以风险对冲为目的,通过对宏观经济周期、行业景气度、发行主体资质和信用衍生品市场的研究,运用衍生品定价模型对其进行合理定价。基金管理人将充分考虑信用衍生品的收益性、流动性及风险性特征,运用信用衍生品适当投资风险收益比较高的债券,以达到分散信用风险、提高资产流动性、增强组合收益的目的。

衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数或复制标的指数的相关重要特征,以便更好地实现基金的投资目标。基金的衍生品投资只能用于风险对冲而不能用于投机。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于基金资产的80%,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）本基金进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期；

（8）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（9）本基金参与国债期货交易,遵循以下中国证监会规定的投资限制：

1）本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%；

2）本基金在任何交易日日终,持有的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%；

3）本基金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%；

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

5）本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

（10）本基金持有单只企业中期票据，其市值不得超过基金资产净值的10%；

（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前述所规定比例限制的,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基金合同约定的投资范围保持一致；

（13）处于封闭期的基金出借证券资产不得超过基金资产净值的50%,出借到期日不得超过封闭期到期日,中国证监会认可的特殊情形除外；

（14）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

除上述第（6）、（11）、（12）项另有约定外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、标的指数成份债券调整、标的指数成份债券流动性限制、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