

**华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开
华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金份额持有人大会的第二次提示性公告**

根据华润元大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）于 2018 年 9 月 4 日发布的《华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会的公告》，本基金管理人决定以通讯方式召开华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议关于本基金转型有关事宜。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现将具体事宜提示如下：

一、召开会议基本情况

本基金于 2015 年 12 月 23 日成立，并于 2018 年 7 月 12 日收到中国证券监督管理委员会《关于准予华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更注册的批复》（证监许可[2018]1108 号），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》等法律法规和《华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2018 年 9 月 14 日起至 2018 年 10 月 10 日 17:00 止（送达时间以本公告列明的收件人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2018 年 10 月 11 日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：唐利利

地址：深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场三座 7 楼

邮编：518000

联系电话：0755-88399026

请在信封表面注明：“华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决专用”。

基金份额持有人或其代理人可通过专人送交、邮寄送达至上述地址的上述收件人。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 4000-1000-89（免长途费）咨询。

二、会议审议事项

《关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同等有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见附件四《关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的说明》。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2018 年 9 月 13 日，即在 2018 年 9 月 13 日下午交易时间（15:00）结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会并投票表决（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

四、表决票的填写和寄交方式

本次基金份额持有人大会提供纸质投票表决方式。

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录本基金管理人网站（www.cryuantafund.com）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下简称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构

投资者加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（5）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件于前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给本基金管理人指定联系地址（专人送达的以实际递交时间为准；通过邮寄方式提交的，以收件日邮戳时间为准）。

基金份额持有人可将填妥的表决票和所需的相关文件邮寄至基金管理人指定联系地址，具体地址和联系方式为：

收件人：唐利利

地址：深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场三座 7 楼

邮编：518000

联系电话：0755-88399026

请在信封表面注明：“华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 4000-1000-89（免长途费）咨询。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（招商证券股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议表决截止日后 2 个工作日内统计全部有效表决票，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达指

定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如多选或表决意见空白的表决票，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本公告的规定，则视为弃权表决，但其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数；

③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以指定联系地址收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、基金份额持有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），则本次通讯开会视为有效；

2、本次议案应当经出席会议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）通过方为有效；

3、基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起5日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要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权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定及《基金合同》的约定，基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但权益登记日仍为2018年9月13日。

重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会

授权期间基金份额持有人做出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新做出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：华润元大基金管理有限公司

办公地址：深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 7 层

联系电话：4000-1000-89（免长途费）

传真：0755-88399045

网址：www.cryuantafund.com

2、基金托管人：招商证券股份有限公司

3、公证机关：北京市中信公证处

4、见证律师：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务热线：4000-1000-89（免长途费）咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、如本次基金份额持有人大会不能成功召开，根据基金合同的有关约定，本基金可能会在规定时间内重新召开基金份额持有人大会。

5、本公告的有关内容由华润元大基金管理有限公司负责解释。

华润元大基金管理有限公司

2018 年 9 月 6 日

附件一：关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同等有关事项的议案

附件二：华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会通讯表决票

附件三：授权委托书

附件四：关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有

关事项的说明

附件五：华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同旧版与新版修改
条文对照表

附件一：

关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同等有关事项的议案

华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人：

为应对复杂多变的证券市场环境，维护基金份额持有人的利益，提高产品的市场竞争力，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》等法律法规和《华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，提议修改本基金名称为“华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金”并调整本基金以下内容：1. 调整投资范围；2. 调整投资策略；3. 调整业绩比较基准；4. 调整基金运作方式；5. 根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订基金合同；6. 根据前述变更及现行有效的法律法规相应修订基金合同和其他法律文件。基金合同的具体修改内容详见附件四《关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的说明》以及附件五《华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表》。

修改后形成的《华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》将自本次大会决议生效后的赎回选择期届满后 5 个工作日内生效（具体以基金管理人届时公告为准）。

以上议案，请予审议。

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

2018 年 9 月 6 日

附件二：

华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称：			
证件号码(身份证件号/营业执照号)	基金账户号		
受托人（代理人）名称：	受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号）：		
审议事项（请在表决意见下打钩）	同意	反对	弃权
关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同等有关事项的议案			
基金份额持有人/受托人（代理人）签名或盖章			
年 月 日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。 “基金账户号”仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。			

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.cryuantafund.com）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：

授权委托书

兹委托 先生/女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为 年 月 日的以通讯方式召开的华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）： _____

委托人身份证号或营业执照号： _____

委托人基金账户号： _____

受托人签字/盖章： _____

受托人身份证号或营业执照号： _____

委托日期： 年 月 日

附注：

- 1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。
- 2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。
- 3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。
- 4、如基金份额持有人就同一基金份额一次授权多个受托人或多次授权的，能够区分先后次序的，以最后一次授权为准；授权无法区分授权次序，但多次有效的授权意见一致的，以一致的授权表示为准；授权无法区分授权次序，且授权意见不一致的，视为弃权表决票。
- 5、如基金份额持有人既进行委托授权，又送达了有效表决票的，则以有效的表决票为准，

授权视为无效。

6、授权委托书中委托人所持基金的份额以持有人大会权益登记日为准。如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权委托书无效。

附件四：

**关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金合同有关事项的说明**

一、声明

1、华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）经 2015 年 7 月 7 日中国证券监督管理委员会准予注册文件第[2015]1579 号文准予募集注册，基金成立于 2015 年 12 月 23 日，基金代码为 001713。为应对复杂多变的证券市场环境，更好地维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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》等法律法规和《华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，提议对本基金进行变更注册。变更注册后，基金名称变更为华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金。基金合同修改的主要内容包括调整投资范围、投资策略、业绩比较基准、运作方式等内容，以及根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关条款修订基金合同等。

2、本次基金份额持有人大会需由出席会议的符合要求的基金份额持有人或其代理人所持有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）方可召开，且《关于修改华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同等有关事项的议案》需经参加本次持有人大会表决的基金份额持有人（或代理人）所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过，存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。中国证监会对本次华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金持有人大会决议的备案，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、方案要点

（一）修改投资范围

修改后为：本基金的投资范围主要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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、权证、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债等）、债券回购、资产支持证券、国债期货、

银行存款（包括同业存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。

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。

基金的投资组合比例为：

封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%–100%，每个交易日日终在扣除股指期货、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；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%–95%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在开放期和封闭期内，港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%。

（二）修改投资策略

修改后为：本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、投资标的的评估以及组合风险管理全过程中。本基金为灵活配置基金，封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%–100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%–95%。一般来说，首先根据宏观经济和政策预判，定性大类资产的边际变动方向。其次，参考全部 A 股整体估值（剔除金融）过去 20 年的历史情况，将 A 股历史估值区间划分成若干分位。如果在 25 分位下方，股票仓位变动是 60%–95%；如果估值在 25–50 分位，股票仓位变动是 50%–95%；如果估值在 50–75 分位，股票仓位在 40%–90%；如果估值在 75–90 分位，股票仓位变动是 30%–90%；如果估值在 90–100 分位，股票仓位在 0–60%。最后，根据短期上涨速度和获利水平，决定短期仓位变化。结合本基金封闭期和开放期的设置，采用不同的投资策略。

1、封闭期投资策略

（1）资产配置策略

本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。

1) 战略资产配置策略

在长期范围内，基金管理人将在对中长期大类资产收益预期的基础上获得战略资产配置的最优比例，并以此作为资产配置调整的可参照基准。主要考虑因素包括国内外宏观经济环境、财政及货币政策趋势、大类资产的历史回报、历史波动率、各类资产之间的相关性、行情驱动因素、类别风格轮动等，从其变动及趋势中得出未来资产回报、风险及相关性的可能变化。

2) 战术资产配置策略

在短期范围内，基金管理人将对组合进行战术资产配置，即在战略资产配置长期维持均衡的基础上积极主动地实现对大类资产配置的动态优化调整。重点考虑的因素包括：经济基本面及中短期波动、资本市场资金面和流动性、大类资产的估值变化以及市场情绪等。

(2) 股票投资策略

本基金将运用“价值和成长并重”的投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。

同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。

本基金将通过基本面分析，结合定量分析和定性分析，进一步筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。其中定量分析重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价值等方面；定性分析重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。

对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：

- 1) A股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A股缺乏投资标的的行业（如博彩）；
- 2) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；
- 3) 符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；

4) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

(3) 债券投资策略

本基金将采用“自上而下”的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在配置框架下进行具有针对性的券种选择。具体而言，基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策以及市场趋势调整因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期和市场信用偏好预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略，力争有效控制整体资产风险。在确定组合整体框架后，基金管理人将对收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行进一步预测，相机而动，积极调整。

在债券投资组合构建和管理过程中，基金管理人将具体采用久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断、信用风险评估等管理手段。在债券投资策略制定与执行的过程中，基金管理人将持续对风险进行动态评估和管理，以确保系统性的控制持仓风险，并且在寻求风险结构优化的过程中不断提高组合的收益水平。

(4) 权证投资策略

本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，主动进行部分权证投资。

(5) 股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

(6) 国债期货投资策略

本基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目的。本基金在国债期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

(7) 资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险。本基金本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置，同时注意流动性风险，严格控制资产支持证券的总量规模，对部分高质量的资产支持证券可以

采用买入并持有到期策略，实现基金资产增值增厚。

（8）可转换公司债投资策略

由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。可转债相对价值分析策略首先从可转债的债性和股性分析两方面入手。本基金用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征。本基金用可转债的平价溢价率和可转债的 Delta 系数来衡量可转债的股性特征。

此外，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，最终确定投资的品种。

2、开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，主要配置高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。

（三）修改后业绩比较基准

修改后为：沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%+中国债券总指数收益率*30%。

（四）修改基金运作方式

修改后为：契约型，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。

自基金合同生效之日起（包括该日），本基金进入第一个封闭期，直至基金合同生效日所对应的 6 个月月度对日的前一日（包括该日）为止。如 6 个月月度对日为非工作日，则顺延至该对日的下一个工作日；如 6 个月后的月度没有对应的日历日期，则顺延至对应日期所在月份最后一日的下一个工作日，以确保开放期起始日为工作日。

自封闭期结束之日后第一个工作日起（包括该日），本基金进入第一个开放期。每个开放期不少于 5 个工作日且最长不超过 20 工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期的 2 日前进行公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或

其他情形影响因素消除之日的下一工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。

第一个开放期结束之日次日起（包括该次日），本基金进入第二个封闭期，直至第一个开放期结束之日次日所对应的6个月月度对日前一日（包括该日）为止，如6个月月度对日为非工作日，则顺延至该对日的下一个工作日；如6个月后的月度没有对应的日历日期，则顺延至对应日期所在月份最后一日的下一个工作日，以此类推。

（五）其他修改

详见附件五

三、基金合同的具体修订

详见附件五

附件五

本次基金合同的修改内容如《华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表》所示，详见下表：

页码	章节	旧版条款	新版条款
	全文	投资者	投资人
1	第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律、法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《 <u>公开募集证券投资基金运作管理办法</u> 》(以下简称“《运作办法》”)、《 <u>证券投资基金销售管理办法</u> 》(以下简称“《销售办法》”)、《 <u>证券投资基金信息披露管理办法</u> 》(以下简称“《信息披露办法》”)、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> (以下简称“《 <u>流动性风险管理规定</u> 》”)和其他有关法律、法规。
1	第一部分 前言	三、华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。	三、 <u>华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金</u> 由华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来。 <u>华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金</u> 联接基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。
1	第一部分 前言	中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。	<u>中国证监会对华润元大中创100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u> 变更为本基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 <u>中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</u>

2	第一部分 前言	五、基金合同应当适用《基金法》及相关法律法规之规定，若因法律法规的修改或新法律法规的颁布施行导致基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。	<u>五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。</u>
2	第一部分 前言		新增内容： <u>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。</u>
2	第一部分 前言		新增内容： <u>七、本基金可根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。</u> <u>基金资产投资港股通标的股票可能使本基金面临港股通交易机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。本基金投资港股的具体风险</u>

			请参见招募说明书“风险揭示”部分。
3	第二部分 释义	基金管理人：指华润元大基金管理有限公司 基金托管人：指招商证券股份有限公司 基金合同：指《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充	基金管理人或本基金管理人：指华润元大基金管理有限公司 基金托管人或本基金托管人：指招商证券股份有限公司 基金合同或本基金合同：指《华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
	第二部分 释义	基金份额发售公告：指《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额发售公告》	删除
3	第二部分 释义	《基金法》：2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订	《基金法》：指2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
3-4	第二部分释义		《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
4	第二部分 释义		银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
4	第二部分 释义	个人投资者：指依据有关法律法规规定可以投资证券	个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券

		投资基金的自然人	投资基金的自然人
4	第二部分 释义	机构投资者：指依据有关法律法规规定可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织	机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
4	第二部分 释义		人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外机构投资者
4	第二部分 释义	投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称	投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称（以下或称“基金投资者”、“投资者”）
	第二部分 释义	ETF 联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称“联接基金” 目标 ETF：指由华润元大基金管理有限公司管理的华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金 标的指数：指深圳证券信息有限公司发布的中小企业创业板 100 指数（或简称“中创 100 指数”）及其未来可能发生的变更	删除

4	第二部分 释义	基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回等业务	基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
4	第二部分 释义	直销机构：指华润元大基金管理有限公司 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金销售业务的机构	销售机构：指华润元大基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构
	第二部分 释义	26、销售机构：指直销机构和代销机构 27、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点	删除
4	第二部分 释义	登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等	登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和 <u>结算</u> 业务，具体内容包括 <u>投资人</u> 基金账户的建立和管理、 <u>基金份额注册</u> 登记、 <u>基金销售业务</u> 的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
5	第二部分 释义	基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户	基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理 <u>申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资</u> 等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
5	第二部分 释义	基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基	基金合同生效日：指 <u>《华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》</u> 生效日

		金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期	
	第二部分 释义	基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月	删除
5-6	第二部分 释义		<p><u>封闭期：指本基金基金合同生效之日起（包括该日）或自每一个开放期结束之日的次日起（包括该次日）至 6 个月月度对日的前一日（包括该日）的期间。如 6 个月月度对日为非工作日，则顺延至该对日的下一个工作日；如 6 个月后的月度没有对应的日历日期，则顺延至对应日期所在月份最后一日的下一个工作日。</u></p> <p><u>本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起（包括该日）至 6 个月月度对日前一日的期间。第二个封闭期为自首个开放期结束之日次日起（包括该次日）至首个开放期结束之日次日的 6 个月月度对日前一日的期间，以此类推。本基金在封闭期内不接受申购、赎回、转换转入、转换转出等交易申请</u></p> <p><u>开放期：指自每一个封闭期结束之日后第一个工作日起（包括该日）不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日的期间。本基金每个开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期的 2 日前进行公告。开放期内，投资人可办理基金份额申购与赎回业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日起，</u></p>

			继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求
6	第二部分释义	开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日	开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准）
	第二部分 释义	认购：指在基金募集期内，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为	删除
6	第二部分 释义		新增内容： 销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用 基金份额类别：指本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额
6	第二部分 释义	转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的行为	转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作
7	第二部分 释义	巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%的情形	巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一 <u>工作日</u> 基金总份额的

			20%的情形
7	第二部分 释义		<p>新增内容： <u>港股通：指投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所/深圳证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票</u></p>
7	第二部分 释义		<p><u>流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</u></p>
7	第二部分 释义		<p><u>摆动定价机制：指当本基金各类份额遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
8	第三部分 基金的基本情况 二、基金的类别	ETF 联接基金	<u>混合型证券投资基金</u>
8	第三部分 基金的基本情况 三、基金的运作方式	三、基金的运作方式 契约型开放式	三、基金的运作方式 契约型，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。

			<p>自基金合同生效之日起（包括该日），本基金进入第一个封闭期，直至基金合同生效日所对应的6个月月度对日前一日（包括该日）为止。如6个月月度对日为非工作日，则顺延至该对日的下一个工作日；如6个月后的月度没有对应的日历日期，则顺延至对应日期所在月份最后一日的下一个工作日，以确保开放期起始日为工作日。</p> <p>自封闭期结束之日后第一个工作日起（包括该日），本基金进入第一个开放期。每个开放期不少于5个工作日且最长不超过20工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期的2日前进行公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。</p> <p>第一个开放期结束之日次日起（包括该次日），本基金进入第二个封闭期，直至第一个开放期结束之日次日所对应的6个月月度对日前一日（包括该日）为止，如6个月月度对日为非工作日，则顺延至该对日的下一个工作日；如6个月后的月度没有对应的日历日期，则顺延至对应日期所在月份最后一日的下一个工作日，</p>
--	--	--	---

			以此类推。
8	<p>第三部分 基金的基本情况</p> <p>四、基金的投资目标</p>	<p>通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化</p>	<p><u>本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。</u></p>
	<p>第三部分 基金的基本情况</p> <p>况</p>	<p>五、基金的最低募集份额总额</p> <p>本基金的最低募集份额总额为 2 亿份</p> <p>六、基金份额发售面值和认购费用</p> <p>本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元</p> <p>本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示</p> <p>八、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中创 100 指数</p> <p>九、本基金与目标 ETF 的差异</p> <p>本基金的目标 ETF 为中创 100 交易型开放式指数证券投资基金，本基金为目标 ETF 的联接基金。本基金与目标 ETF 均采用指数化投资方式，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。</p> <p>本基金与目标 ETF 的差异主要在于：</p> <p>（1）投资方法不同。目标 ETF 属交易型开放式指数证券投资基金，以股票为主要投资标的，通过投资标的指数成份股及其备选成份股达成投资目标；本金属</p>	<p>删除</p>

		<p>契约型开放式指数证券投资基金，以目标 ETF 为主要投资标的，通过投资目标 ETF 达成投资目标；</p> <p>(2) 交易方式不同。目标 ETF 的投资人可通过申购赎回代理券商申购赎回基金份额，在基金符合上市条件申请上市成功后，投资人也可在二级市场买卖目标 ETF 的基金份额；本基金的投资人只能通过本基金的销售机构申购赎回本基金的基金份额；</p> <p>(3) 申购赎回方式不同。目标 ETF 的投资人依据申购赎回清单，按以组合证券为主的申购对价、赎回对价进行申购赎回，申购赎回均以份额申报；本基金的投资人依据基金份额净值，以现金方式进行申购赎回，金额申购、份额赎回；</p> <p>(4) 价格揭示机制不同。目标 ETF 有实时市场交易价格和每日净值；本基金只揭示每日基金净值。</p> <p>此外，尽管均采用指数化投资方式，且投资目标相同，但投资对象和投资范围的不同，可能会导致本基金与目标 ETF 的业绩表现出现差异。引致差异的因素主要包括：</p> <p>(1) 目标 ETF 对现金或者到期日在一年以内的政府债券的最低比例没有要求；本基金对现金或者到期日在一年以内的政府债券的最低比例要求为 5%；</p> <p>(2) 目标 ETF 申购赎回采用组合证券方式，交易成</p>	
--	--	--	--

		<p>本和冲击成本较小；本基金申购赎回采用现金方式，交易成本和冲击成本较大；</p> <p>(3) 投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同。</p>	
8-9	第三部分基金的基本情况		<p>新增内容： <u>六、基金份额类别的设置</u> <u>本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、赎回时收取赎回费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。</u> <u>本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。</u> <u>投资人可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。</u> <u>本基金有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。</u> <u>在不违反法律法规规定和基金合同约定的前提下，根据基金运作情况，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后停止现有基金份额类别的销</u></p>

			售、或者调低现有基金份额类别的费率水平、或者增加新的基金份额类别等，调整实施前基金管理人需依照《信息披露办法》的规定及时公告并报中国证监会备案。
	第四部分 基金份额的发售	<p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。</p> <p>3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。</p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用 本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，认购费主要用于基金的市场推广、销售、登记等基金募集期间</p>	删除

		<p>发生的各项费用。</p> <p>2、募集期资金与利息的处理方式</p> <p>基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期间形成的利息折算成基金份额计入基金投资者的账户，具体份额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算</p> <p>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购申请的确认</p> <p>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。</p> <p>5、认购份额余额的确认</p> <p>认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤</p>	
--	--	--	--

		<p>销。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。</p> <p>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。</p>	
10	<p>第四部分</p> <p>基金的历史沿革</p>		<p>新增内容：</p> <p><u>第四部分 基金的历史沿革</u></p> <p><u>华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金由华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来。</u></p> <p><u>华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金经中国证监会证监许可[2015]1579 号文准予募集注册，基金管理人为华润元大基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。自 2015 年 11 月 9 日至 2015 年 12 月 18 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 1,441 户，募集资金及其产生的利息共计 332,856,785.18 元，折合基金份额 332,856,785.18 份。华润元大基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于 2015 年 12 月 23 日获书面确认，《华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自该日起正式</u></p>

			<p>生效。</p> <p>2017年*月*日，华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》，内容包括调整本基金的投资目标、投资范围、投资策略等内容，基金更名为“华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金”。并基于上述变更，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金的其他部分条款进行相应修改。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效，基金管理人已就上述基金份额持有人大会决议报中国证监会备案。</p> <p>自201*年*月*日起，《华润元大润睿锦定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》同时失效。</p>
11	<p>第五部分 基金备案</p>	<p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件</p> <p>本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金</p>	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>基金合同生效后，连续20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5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国</p>

	<p>管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用； 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息； 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 	<p><u>证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</u></p>
--	--	---

		<p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模基金合同生效后，连续 20 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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>	
12	<p>第六部分基金份额的申购与赎回</p> <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p>	<p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p>	<p>1、开放日及开放时间</p> <p><u>本基金开放期内，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。在封闭期内，本基金不办理申购、赎回业务，也不上市交易。</u></p>
12-13	<p>第六部分基金份额的申购与赎回</p>	<p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始</p>	<p>2、<u>开放期及业务办理时间</u></p> <p><u>本基金开放期的期限为自每一个封闭期结束之日后第</u></p>

	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>2、开放期及业务办理时间</p>	<p>办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。</p>	<p><u>一个工作日起（包括该日）不少于5个工作日且最长不超过20个工作日的期间。本基金每个开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期的2日前进行公告。</u></p> <p><u>如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。</u></p> <p><u>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为该开放期下一开放日该类别基金份额申购、赎回的价格；但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换申请的，视为无效申请。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见招募说明书及基金管理人届时发布的相关公告。</u></p>
13	<p>第六部分基金份额的申购与赎回</p> <p>三、申购与赎回的原则</p>	<p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、</p>	<p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类别基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购</p>

		申购的先后次序进行顺序赎回。	的先后次序进行顺序赎回； <u>5、本基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额两个类别，适用不同的申购费率、赎回费率或销售服务费，投资人在申购时可自行选择基金份额类别。</u>
14	第六部分基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制	五、申购和赎回的数额限制 1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。 2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。 3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。	五、申购和赎回的 <u>数量</u> 限制 1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书 <u>或相关公告</u> 。 2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书 <u>或相关公告</u> 。 3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、 <u>单日或单笔申购金额及比例上限、本基金的总规模限额</u> ，具体规定请参见招募说明书 <u>或相关公告</u> 。
14	第六部分基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制		新增 <u>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见招募说明书或相关公告。</u>
14	第六部分基金份额的申购	4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述	5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上

	与赎回 五、申购和赎回的数量限制	规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。	述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。
14-15	第六部分基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。	1、本基金基金份额分为A类和C类基金份额。投资人申购A类基金份额在申购时支付申购费用，申购C类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。 2、本基金A类基金份额和C类基金份额的份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。
15	第六部分基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	3、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
15	第六部分基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应	4、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金A类和C类基金份额的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于

		的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。	<u>1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。</u> 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日 <u>该类基金份额净值</u> 并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
15	第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。	5、 <u>本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担</u> ，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用； <u>C 类基金份额不收取申购费用。</u>
15	第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费归入基金财产的比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。	6、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。 <u>赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产</u> ，具体比例详见招募说明书，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。
15	第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途	6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法……	7、本基金申购费率、申购份额具体的计算方法……
16	第六部分 基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途		新增内容： <u>9、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。摆动定价机制适用的具体情形、处理原则与操作规范遵循</u>

			法律法规、行业自律规则的规定。
16	第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。	4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
16	第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。	5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
16	第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	6、目标 ETF 暂停基金资产估值； 7、目标 ETF 暂停申购、暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌；	删除
16	第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形		新增： 6、接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50%以上的。 7、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。 8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认

			后，基金管理人暂停基金估值并采取暂停接受基金申购申请的措施。
16	第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	发生上述第 1、2、3、5、6、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	发生上述第 1、2、3、5、 <u>8、9</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理， <u>且开放期按暂停申购的期间相应延长。</u>
	第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形	4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。 5、目标 ETF 暂停基金资产估值； 6、目标 ETF 暂停申购、暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌；	删除
17	第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形		<u>新增：</u> 5、 <u>当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停基金估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</u>
17	第六部分 基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付	发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付

		部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。	部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，且开放期间按暂停赎回的期间相应延长。
17	第六部分基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 1、巨额赎回的认定	若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。	若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。
17	第六部分基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。	当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或 <u>延缓支付赎回款项</u> 。
18	第六部分基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转	(2) <u>延缓支付赎回款项</u> ：基金管理人符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应全部予以接受和确认。但对于已接受的赎回申请，当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时， <u>基金管理人当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限最长不超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</u>

		<p>入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p>	
18	<p>第六部分基金份额的申购与赎回</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p>		<p>新增：</p> <p><u>(3) 在开放期内，当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额 40% 的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一估值日基金总份额 40% 的前提下，对其余赎回申请可以延期办理。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推。如延期办理期限超过开放期的，开放期相</u></p>

			<u>应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 40%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</u>
18	第六部分基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 3、巨额赎回的公告	当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。	<u>当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项或延期赎回的情形时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</u>
18-19	第六部分基金份额的申购与赎回 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告	2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。 3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人应最迟于重新开放日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的基金份额净值。	2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。 3、 <u>如果发生暂停的时间超过 1 日但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。</u> 4、 <u>如果发生暂停的时间超过两周，基金管理人最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的各类基金份额净值。</u>

21	第七部分 基金合同当事人及权利义 务 一、基金管理人 (一) 基金管理人简况	住所：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合办公楼 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：路强 注册资本：人民币 2 亿元	住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：邹新 注册资本：人民币 3 亿元
22	第七部分 基金合同当事人及权利义 务 一、基金管理人 (二) 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： (14) 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； (15) 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、转换和非交易过户等业务规则；	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： <u>(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；</u> <u>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</u> (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
22	第七部分 基金合同当事人及权利义 务 一、基金管理人 (二) 基金管理人的权利与义务	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、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申购、赎回和登记事宜；
22-23	第七部分 基金合同当事人及权利义	(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规	(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，

	务 一、基金管理人 (二) 基金管理人的权利与义务	定, 按有关规定计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;	按有关规定计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;
	第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 (二) 基金管理人的权利与义务	(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;	删除
24	第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人 (一) 基金托管人简况	法定代表人: 宫少林 注册资本: 人民币 46.61 亿元	法定代表人: 霍达 注册资本: 人民币 66.99 亿元
24	第七部分 基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人 (二) 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, 基金托管人的权利包括但不限于: (4) 根据相关市场规则, 为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户, 为基金办理证券交易资金清算;	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: (4) 根据相关市场规则, 为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户, 为基金办理证券、期货交易资金清算;
26	第七部分 基金合同当事人及权利义务 三、基金份额持有人	每份基金份额具有同等的合法权益。	<u>同一类别</u> 每份基金份额具有同等的合法权益。
26	第七部分 基金合同当事人及权利义务	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、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:

	务 三、基金份额持有人	(3) 依法申请赎回其持有的基金份额;	(3) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额;
27	第七部分 基金合同当事人及权利义务 三、基金份额持有人	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： (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；	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： (4) 缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
	第八部分 基金份额持有人大会	目标 ETF 召开基金份额持有人大会的，本基金应当提前召开本基金的基金份额持有人大会基金份额持有人大会的表决意见征求本基金基金份额持有人的意见。本基金的基金管理人应当分别按照权益登记日本基金基金份额持有人大会各类表决意见的具体比例参加目标 ETF 基金份额持有人大会投票表决。 本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使目标 ETF 的基金份额持有人大会的表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。	删除
28	第八部分 基金份额持有人大会	本基金份额持有人大会不设日常机构。	本基金份额持有人大会未设日常机构。
28	第八部分	1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金	1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基

	基金份额持有人大会 一、召开事由	份额持有人大会： （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外； （6）变更基金类别，但根据基金合同约定变更为跟踪同一标的指数的指数基金的除外； （8）变更基金投资目标、范围或策略，但根据基金合同约定变更为跟踪同一标的指数的指数基金的除外； （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；	金份额持有人大会： （5） <u>调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费</u> ，但根据法律法规的要求 <u>调整该等报酬标准或提高销售服务费的除外</u> ； <u>（6）变更基金类别</u> ； （8）变更基金投资目标、范围或策略； （12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
28	第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由	2、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）调低基金管理费、基金托管费和其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；	2、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）调低 <u>除基金管理费、基金托管费以外的其他</u> 应由本基金或基金份额持有人承担的费用；
29	第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由	（3）在法律法规和基金合同规定的范围内调低本基金的申购费率、调低赎回费率或在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式；	（3）在法律法规和基金合同规定的范围内 <u>且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下</u> ， <u>调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费或变更收费方式、调整基金份额类别设置</u> ；
30	第八部分 基金份额持有人大会 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	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。	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、 <u>书面</u> 表决意见寄交的截止时间和收取方式。
31-	第八部分	1、现场开会。……	1、现场开会。……

32	基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式	<p>(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三个月以后、六个月以内, 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)。</p> <p>2、通讯开会。……</p> <p>(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三个月以后、六个月以内, 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 (含三分之一) 以上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;</p>	<p>(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 <u>3个月</u> 以后、<u>6个月</u> 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)。</p> <p>2、通讯开会。……</p> <p>(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 <u>3个月</u> 以后、<u>6个月</u> 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 (含三分之一) 以上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;</p>
35	第八部分 基金份额持有人大会	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	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。	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。
36-37	<p>第九部分</p> <p>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p>	<p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；</p>	<p>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，<u>自表决通过之日起生效</u>；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案；</p> <p>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。<u>临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值</u>；</p>
37	<p>第九部分</p> <p>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p> <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p>	<p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议</p>	<p>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，<u>自表决通过之日起生效</u>；</p>

	(二) 基金托管人的更换程序	<p>须报中国证监会备案；</p> <p>6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；</p> <p>7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。审计费用在基金财产中列支。</p>	<p>4、备案：基金份额持有人大会<u>选任基金托管人</u>的决议须经中国证监会备案；</p> <p>6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人<u>或者临时基金托管人</u>应与基金管理人核对基金资产总值；</p> <p>7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；<u>审计费用在基金财产中列支。</u></p>
42	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>一、投资目标</p>	<p>一、投资目标</p> <p>通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p>	<p>一、投资目标</p> <p><u>本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。</u></p>
42	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>二、投资范围</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以目标 ETF、标的指数的成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许</p>	<p>二、投资范围</p> <p><u>本基金的投资范围主要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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、权证、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、</u></p>

		<p>基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%,每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p><u>可分离交易可转债等)、债券回购、资产支持证券、国债期货、银行存款(包括同业存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</u></p> <p><u>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</u></p> <p><u>基金的投资组合比例为:</u></p> <p><u>封闭期内,股票资产占基金资产的比例为 0%-100%,每个交易日日终在扣除股指期货、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;开放期内,股票资产占基金资产的比例为 0%—95%,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在开放期和封闭期内,港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%。</u></p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>三、标的指数</p>	<p>中创 100 指数。</p> <p>如果华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金变更其标的指数,或者深圳证券交易所变更或停止</p>	<p>删除</p>
	<p>三、标的指数</p>		

		<p>中创指数的编制及发布，或者中创 100 指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致中创 100 指数不宜继续作为目标基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于本基金投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在取得基金托管人的同意并履行适当程序后，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据目标 ETF 的标的指数、市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。</p>	
42-46	<p>第十二部分 基金的投资 三、投资策略</p>	<p>四、投资策略</p> <p>本基金以华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理，主要以一级市场申购的方式投资于目标 ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标 ETF 基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标 ETF 的基金份额。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要通过投资于目标 ETF 以实现对业绩比较基准的良好跟踪。本基金投资于目标 ETF 的资产比例将不低于基金资产净值的 90%,其余资产可投资于标的指</p>	<p>三、投资策略</p> <p><u>本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、投资标的的评估以及组合风险管理全过程中。本基金为灵活配置基金，封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%-100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。一般来说，首先根据宏观经济和政策预判，定性大类资产的边际变动方向。其次，参考全部 A 股整体估值（剔除金融）过去 20 年的历史情况，将 A 股历史估值区间划分成若干分位。如果在 25 分位下方，股票仓位变动是 60%-95%；如果估值在 25-50 分位，股票仓位变动是 50%-95%；如</u></p>

	<p>数的成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券，货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)，其目的是为了使本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好的跟踪标的指数。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，基金管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争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 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、目标 ETF 的投资策略</p> <p>本基金投资目标 ETF 有如下两种方式：</p> <p>1) 申购和赎回：目标 ETF 开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回。</p> <p>2) 二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。</p>	<p>果估值在 50-75 分位，股票仓位在 40%-90%；如果估值在 75-90 分位，股票仓位变动是 30%-90%；如果估值在 90-100 分位，股票仓位在 0-60%。最后，根据短期上涨速度和获利水平，决定短期仓位变化。结合本基金封闭期和开放期的设置，采用不同的投资策略。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人<u>对大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。</u></p> <p>（1）战略资产配置策略</p> <p>在长期范围内，基金管理人将在对中长期大类资产收益预期的基础上获得战略资产配置的最优比例，并以此作为资产配置调整的可参照基准。主要考虑因素包括国内外宏观经济环境、财政及货币政策趋势、大类资产的历史回报、历史波动率、各类资产之间的相关性、行情驱动因素、类别风格轮动等，从其变动及趋势中得出未来资产回报、风险及相关性的可能变化。</p> <p>（2）战术资产配置策略</p> <p>在短期范围内，基金管理人将对组合进行战术资产配</p>
--	--	---

	<p>当目标 ETF 申购、赎回或二级市场交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。</p> <p>3、本基金可通过买入标的指数成分股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p> <p>本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以及国债期货投资。基金投资国债期货将本着谨慎的原则，充分考虑其流动性和风险收益特征，适度参与国债期货投资。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金</p>	<p>置，即在战略资产配置长期维持均衡的基础上积极主动地实现对大类资产配置的动态优化调整。重点考虑的因素包括：<u>经济基本面及中短期波动、资本市场资金面和流动性、大类资产的估值变化以及市场情绪等。</u></p> <p><u>2、股票投资策略</u></p> <p>本基金将运用“价值和成长并重”的投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，<u>综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。</u></p> <p><u>同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。</u></p> <p><u>本基金将通过基本面分析，结合定量分析和定性分析，进一步筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。其中定量分析重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价值等方面；定性分析重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。</u></p>
--	---	---

		<p>可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> <p>4、投资组合的调整</p> <p>本基金将根据每个交易日申购赎回情况及本基金实际权益类资产仓位情况，来决定对目标 ETF 的操作方式和数量。</p> <p>1) 当收到净申购时，本基金将根据净申购规模及实际权益类资产仓位情况，确定是否需要买入成份股，并申购目标 ETF 的操作；</p> <p>2) 当收到净赎回时，本基金将根据净赎回规模及实际权益类资产仓位情况，确定是否需要目标 ETF 进行赎回，并卖出赎回所得成份股；</p> <p>3) 在部分情况下，本基金将会根据目标 ETF 二级市场交易情况，适时选择对目标 ETF 进行二级市场交易操作。</p>	<p>对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者 (QDII) 境外投资额度进行境外投资。</p> <p>本基金将重点关注：</p> <p><u>(1) A 股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A 股缺乏投资标的行业（如博彩）；</u></p> <p><u>(2) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；</u></p> <p><u>(3) 符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；</u></p> <p><u>(4) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。</u></p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将采用“自上而下”的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在配置框架下进行具有针对性的券种选择。具体而言，基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策以及市场趋势调整因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期和市场信用偏好预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略，力争有效控制整体资产风险。在确定组合整体框架后，基金管理人将对收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行进一步预测，相机而动，积极调整。</p>
--	--	--	---

		<p>在债券投资组合构建和管理过程中，基金管理人将具体采用久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断、信用风险评估等管理手段。在债券投资策略制定与执行的过程中，基金管理人将持续对风险进行动态评估和管理，以确保系统性的控制持仓风险，并且在寻求风险结构优化的过程中不断提高组合的收益水平。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，主动进行部分权证投资。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>本基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目的。本基金在国债期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险</p>
--	--	---

			<p>可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p><u>7、资产支持证券投资策略</u></p> <p>本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险。本基金本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置，同时注意流动性风险，严格控制资产支持证券的总量规模，对部分高质量的资产支持证券可以采用买入并持有到期策略，实现基金资产增值增厚。</p> <p><u>8、可转换公司债投资策略</u></p> <p>由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。可转债相对价值分析策略首先从可转债的债性和股性分析两方面入手。本基金用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征。本基金用可转债的平价溢价率和可转债的 Delta 系数来衡量可转债的股性特征。</p>
--	--	--	---

			<p>此外，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，最终确定投资的品种。</p> <p><u>(二) 开放期投资策略</u></p> <p>开放期内，本基金为保持较高的流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，主要配置高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
46	<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p>	<p>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>(2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(3) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p>	<p><u>(1) 封闭期内，本基金股票投资占基金资产净值的比例为 0% - 100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%；</u></p> <p><u>(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</u></p> <p><u>(6) 基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</u></p>
46	<p>第十二部分 基金的投资</p>		<p>新增：</p> <p><u>(3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司</u></p>

	四、投资限制 1、组合限制		在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算)，其市值不超过基金资产净值的 10%； <u>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；</u>
46	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；	<u>(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；</u>
46	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(5) 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%；	<u>(8) 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%；</u>
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(6) 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%；	<u>(9) 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%；</u>
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(7) 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%；	<u>(10) 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%；</u>

47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(8) 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%；	<u>(11) 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%；</u>
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(9) 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；	<u>(12) 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；</u>
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(10) 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；	<u>(13) 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；</u>
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(11) 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%；	<u>(14) 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，债券回购到期后不得展期；</u>
47-48	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(12) 本基金若投资股指期货、国债期货的，则应当遵守下列限制： 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，在任何交易日内交易（不包括	<u>(15) 本基金参与股指期货、国债期货交易，除中国证监会另有规定，应当遵守下列要求：</u> 1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%； 2) <u>在封闭期内任何交易日日终，本基金持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资</u>

		<p>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%; 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;</p> <p>2) 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%; 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%; 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%; 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;</p> <p>3) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货和国债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 95%; 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)、权证、资产支持证券等;</p>	<p>产净值的 100%; 在开放期内任何交易日日终, 本基金持有的买入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 95%。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)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>3) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;</p> <p>4) 在封闭期内, 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; 在开放期内, 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)应当不超过基金资产净值的 95%;</p> <p>5) 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%;</p> <p>6) 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%;</p> <p>7) 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%;</p> <p>8) 基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债</p>
--	--	--	---

			<u>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%；</u>
	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(13) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；	删除
48	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(14) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；	<u>(16) 在封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；在开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</u>
48	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制		增加如下内容： <u>(17) 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%；</u> <u>(18) 在开放期内，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%；</u> <u>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款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u>

			(19)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；
48	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	(16) 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。	(20) 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。
48-49	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1、组合限制	<p>因证券、期货市场波动、上市公司合并、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、目标 ETF 申购、赎回、交易被暂停或交收延迟、股权分置改革中支付对价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。法律法规另有规定时，从其规定。</p> <p>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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投</p>	<p>除上述第（2）、（12）、（18）、（19）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。</p> <p>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。</p> <p>如果法律法规或监管部门对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法</p>

		资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。	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。
49	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 2、禁止行为	(4) 向基金管理人、基金托管人出资；	<u>(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</u> (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
49	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 2、禁止行为	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…… 若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。	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 <u>其他</u> 重大利害关系的公司发行的证券或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的原则…… <u>若法律、行政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。</u>
49-50	第十二部分 基金的投资 五、业绩比较基准	中创 100 指数收益率×95%+银行活期存款收益率（税后）×5% 若本基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本基金	<u>本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%+中国债券总指数收益率*30%。</u> <u>其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国</u>

		<p>管理人可以在与基金托管人协商同意后变更业绩比较基准的组成和权重。若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案并在指定媒介公告。若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应于变更前在指定媒介上公告。</p>	<p><u>A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于2001年12月31日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。</u></p> <p><u>本基金业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会。</u></p>
50	第十二部分	七、风险收益特征	六、风险收益特征

	基金的投资	<p>本基金属于 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中创 100 指数，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所表现的市场组合的风险收益特征相似。</p>	<p><u>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。</u></p> <p><u>本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。</u></p>
	第十二部分 基金的投资	<p>八、目标 ETF 发生相关变更情形的处理方式</p> <p>目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金可在履行适当程序后由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，不需召开持有人大会；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后可选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现； 2、目标 ETF 终止上市； 3、目标 ETF 基金合同终止； 4、目标 ETF 与其他基金进行合并； 5、目标 ETF 的基金管理人发生变更； 6、中国证监会规定的其他情形。 	删除
52	第十四部分	基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、权证、股指期货	基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约、国

	基金资产估值 二、估值对象	合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
52	第十四部分基金资产估值 三、估值方法	<p>1、目标 ETF 估值方法</p> <p>本基金投资的目标 ETF 份额按照估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。</p> <p>2、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的价格估值，估值日没有交易且本基金采用的是按收盘价或第三方估值机构提供的价格估值的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的价格估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；</p> <p>(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得</p>	<p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），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，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，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；</p> <p>(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的价格估值；</p> <p><u>(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价或第三方估值机构提供的价格进行估值；估值日没有交易且本基金采用的是按收盘价估值的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，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；</u></p> <p><u>(4) 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。交易所上市的资产支持证券，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。</u></p>

		到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整并确定公允价格。	
53-54	第十四部分 基金资产估值 三、估值方法	4、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。 7、中小企业私募债券，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。 8、本基金投资股指期货、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。 9、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。 10、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估	5、国债期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。 6、本基金投资股指期货合约，以其估值日在期货交易所公布的结算价估值；估值日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的结算价估值。 7、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。 8、持有的银行存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。 9、对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调

		<p>值。</p> <p>11、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。</p>	<p><u>整。</u></p> <p><u>10、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以</u> <u>采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体</u> <u>处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、</u> <u>自律规则的规定。</u></p> <p>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。</p> <p>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，<u>基金管理人和基金托管人</u>协商解决。</p>
54	第十四部分 基金资产估值 四、估值程序	<p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p>	<p>1、<u>各类</u>基金份额净值是按照每个工作日闭市后，<u>该</u> <u>类</u>基金资产净值除以当日<u>该类</u>基金份额的余额数量计算，精确到<u>0.0001</u>元，小数点后第<u>5</u>位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个工作日计算基金资产净值及<u>各类</u>基金份额净值，并按规定公告。</p>
54	第十四部分 基金资产估值 四、估值程序	<p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将</p>	<p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，<u>但</u> <u>基金</u>管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，</p>

		基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。	将 <u>各类</u> 基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人 <u>按约定</u> 对外公布。
54	第十四部分 基金资产估值 五、估值错误的处理	基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。	基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后第 <u>4</u> 位以内（含第 <u>4</u> 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。
55	第十四部分 基金资产估值 五、估值错误的处理 1、估值错误类型		增加如下内容： <u>对于因技术原因引起的估值错误，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。</u> <u>由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该估值错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。</u>
56	第十四部分 基金资产估值 五、估值错误的处理 2、估值错误处理原则	(5) 估值错误责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人估值错误造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人估值错误造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向估值错误方追偿；追偿过程中产生	(<u>5</u>) 按法律法规规定的其他原则处理估值差错。

		<p>的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。</p> <p>(6) 如果出现估值错误的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现估值错误的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。</p> <p>(7) 按法律法规规定的其他原则处理估值差错。</p>	
56	<p>第十四部分 基金资产估值 五、估值错误的处理 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：</p>	<p>(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。</p>	<p>(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、<u>通报基金托管人并报中国证监会备案。</u> 增加如下内容： <u>(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。</u></p>
56-57	<p>第十四部分基金资产估值 六、暂停估值的情形</p>	<p>3、基金所投资的目标 ETF 暂停估值或暂停公告基金份额净值时；</p>	<p>3、<u>当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的，应当暂停基金估值；</u></p>
57	<p>第十四部分基金资产估值 七、基金净值的确认</p>	<p>用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基</p>	<p>用于基金信息披露的基金资产净值和<u>各类</u>基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。</p>

		金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。	基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和 <u>各类</u> 基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。
57	第十四部分基金资产估值 八、特殊情况的处理	1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数公司及登记机构发送的数据错误等其他原因……	1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于不可抗力，或由于证券、期货交易所、 <u>期货公司</u> 、 <u>登记结算公司</u> 等机构发送的数据错误等原因……
58	第十五部分 基金费用与税收 一、基金费用的种类	3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用； 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费； 5、基金份额持有人大会费用； 6、基金的证券交易费用； 7、基金的银行汇划费用； 8、账户开户费用、账户维护费用 9、基金收益分配中发生的费用； 10、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。	3、 <u>C 类基金份额的销售服务费</u> ； 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用； 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、 <u>诉讼费和仲裁费</u> ； 6、基金份额持有人大会费用； 7、基金的证券、 <u>期货</u> 交易费用； 8、基金的银行汇划费用； 9、 <u>基金的开户费用、账户维护费用</u> ； 10、 <u>因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用</u> ； 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。
58	第十五部分 基金费用与税收 二、基金费用计提方法、	本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：	本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70%年费率计提。 <u>管理费的计算方法如下：</u> $H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$

	<p>计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p>	<p>$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在月初 5 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。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。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p>	<p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在月初 5 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。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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</p>
58-59	<p>第十五部分</p> <p>基金费用与税收</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、基金托管人的托管费</p>	<p>本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> <p>$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务</p>	<p>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：</p> <p>$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在月初 5 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。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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，</p>

		数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。	<u>顺延至最近可支付日支付。</u>
59	第十五部分 基金费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式	3、上述“一、基金费用的种类”中除管理费、托管费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。	3、C类基金份额的销售服务费 <u>本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：</u> $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为C类基金份额前一日基金资产净值 C类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，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，自动在月初5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。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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的， <u>顺延至最近可支付日支付。</u> <u>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。</u>
	第十五部分 基金费用与税收	四、基金管理费和基金托管费的调整 基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费	删除

		和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。	
61	第十六部分 基金的收益与分配 三、基金收益分配原则		新增： 1、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费， <u>C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；</u>
61	第十六部分 基金的收益与分配 三、基金收益分配原则	4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；	2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为 <u>该类别</u> 基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红； <u>基金份额持有人可对其持有的A类和C类基金份额分别选择不同的收益分配方式；选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的分红资金将按权益登记日该类别的基金份额净值转成相应的同一类别的基金份额；同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；</u>
61	第十六部分 基金的收益与分配 三、基金收益分配原则	1、本基金的每份基金份额享有同等分配权； 2、本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%；	3、 <u>基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类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；</u>

		<p>3、若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；</p> <p>5、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；</p> <p>6、基金收益分配后每一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；</p> <p>7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。</p> <p>在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于调整实施日前在指定媒介公告。</p>	<p>4、同一类别每一基金份额享有同等分配权；</p> <p>5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p> <p><u>本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。</u></p> <p><u>在符合法律法规及基金合同约定并对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，此项调整不需要召开基金份额持有人大会。</u></p>
62	<p>第十六部分</p> <p>基金的收益与分配</p> <p>四、收益分配方案</p>	<p>基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、支付方式等内容。</p>	<p>基金收益分配方案中应载明<u>截止</u>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、<u>分配</u>方式等内容。</p>
62	<p>第十六部分</p> <p>基金的收益与分配</p> <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p>	<p>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个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。</p> <p>在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。</p> <p>法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	<p>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并报中国证监会备案。</p> <p><u>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。</u>在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划</p>

			付。 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
62	第十六部分 基金的收益与分配 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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照业务规则执行。	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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为该类基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。
63	第十七部分 基金的会计与审计 一、基金会计政策	2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；	2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
64	第十八部分 基金的信息披露 二、信息披露义务人	本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。	本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。
64	第十八部分 基金的信息披露 四、信息披露文本规范	四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。	四、 <u>信息披露文本规范</u> 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。
65	第十八部分 基金的信息披露	(一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资	(一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投

	五、公开披露的基金信息	<p>者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。</p>	<p>资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p>
	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	<p>(二) 基金份额发售公告</p> <p>基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。</p>	删除
	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	<p>(三) 基金合同生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。</p>	删除
65	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	<p>(四) 基金资产净值、基金份额净值</p> <p>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公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应</p>	<p>(二) 基金资产净值、基金份额净值</p> <p>基金合同生效后，<u>在封闭期内</u>，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额净值。<u>基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日，披露开放期前最后一个工作日的各类基金份额的基金份</u></p>

		<p>当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p>	<p><u>额净值和基金份额累计净值。</u></p> <p>在开放期内，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的<u>各类基金份额净值和各类基金份额累计净值</u>。基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和<u>各类基金份额净值</u>。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、<u>各类基金份额净值和各类基金份额累计净值</u>登载在指定媒介上。</p>
65	<p>第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息</p>	<p>（五）基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</p>	<p>（三）基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式、<u>有关 A 类基金份额的申购费率及 A 类和 C 类基金份额的赎回费率</u>，并保证投资者能够在<u>基金份额销售网点</u>查阅或者复制前述信息资料。</p>
66	<p>第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息</p>		<p>（四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p><u>新增：</u></p> <p><u>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p>

			<u>本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u>
	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	7、基金募集期延长；	删除
67	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；	<u>15、管理费、托管费、销售服务费</u> 等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
67	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	21、本基金开始办理申购、赎回；	20、本基金 <u>进入开放期</u> ；
67	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	23、本基金发生巨额赎回并延期办理；	22、本基金发生巨额赎回并 <u>延缓支付赎回款项</u> ；
	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；	删除
	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	26、变更目标 ETF 或标的指数；	删除
67	第十八部分		新增内容：

	基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		<u>25、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u> <u>26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</u> <u>27、调整基金份额类别设置；</u>
68	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(十二) 投资国债期货信息	(八) 投资国债期货的信息
68	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息		增加如下内容： <u>(十) 投资港股通标的股票的信息</u> 基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。
	第十八部分 基金的信息披露 五、公开披露的基金信息	(十三) 投资中小企业私募债券信息 基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。	删除
69	第十八部分基金的信息披露 六、信息披露事务管理	基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金	基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、 <u>各类基金份额净值</u> 、基金份额申购赎回价格、

		定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。 基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的媒介。	基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。 基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。
72	第二十部分 违约责任	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人可以免责：	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人可以免责：
	第二十部分 违约责任	4、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由商业银行、证券经纪机构等其他机构负责清算交收的委托资产及其收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产带来的损失等，但由于基金托管人过错造成的除外； 5、基金管理人、基金托管人对由于第三方（包括但不限于证券交易所、中登公司等）发送或提供的数据错误给本基金资产造成的损失等； 6、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或基金份额持有人损失，基金	删除

		管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。	
73	第二十一部分 争议的处理和适用的法律	<p>……仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。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。</p> <p>基金合同受中华人民共和国（不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区）法律管辖。</p>	<p>……仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，<u>仲裁费用由败诉方承担。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>基金合同受<u>中国</u>（不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区）法律管辖。</p>
74	第二十二部分 基金合同的效力	1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。	1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章。