

广发基金管理有限公司

关于以通讯方式召开广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

根据市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,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》等法律法规的规定和《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关约定,广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）（基金主代码: 162714,场内简称: 深证 100 基金,以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会,审议《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》,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 2024 年 6 月 4 日起,至 2024 年 7 月 1 日 15:00 止（投票表决时间以本次大会指定的收件人收到表决票时间为准）。

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在投票期间内,通过专人送交、邮寄等方式送达至本次大会指定收件人,具体地址和联系方式如下:

收件人: 广发基金管理有限公司客户服务中心

地址: 广州市海珠区琶洲大道东 3 号保利国际广场东裙楼 4 楼

联系人: 张琪骊

联系电话: 020-89188656

传真: 020-34281105、89899070

电子邮件: services@gffunds.com.cn

邮政编码: 510308

请在信封表面注明“广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》（以下简称《议案》），《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2024 年 6 月 3 日，即该日交易时间结束后，在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加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、投票

（一）纸质投票

1. 本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）下载等方式获取表决票。

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复印件。

（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（以下合称“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事业单位法人登记证书、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），并提供以下材料：①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；②该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或其他有效注册登记证明复印件；③取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；④如由授权代表在表决票上签字的，还需提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件。以上各项中的公章、批文、开户证明、登记证书等，以基金管理人的认可为准。

(3) 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。基金份额持有人的授权应当符合法律法规及本公告的规定。

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在投票期间内,通过专人送交、邮寄等方式送达至本次大会指定收件人处。

(二) 电话投票 (仅适用于个人持有人)

为方便基金份额持有人参与大会投票,自2024年6月4日起,至2024年7月1日15:00以前(以基金管理人指定系统记录时间为准),基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话(95105828或020-83936999)并按提示转人工坐席参与本次持有人大会的投票。基金管理人也可主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系。通话过程中将以回答提问方式核实基金份额持有人身份,身份核实后由人工坐席根据客户意愿进行投票记录从而完成持有人大会的投票。为保护基金份额持有人利益,整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话表决的方式仅适用于个人投资者,对机构投资者暂不开通。

(三) 短信投票 (仅适用于个人持有人)

为方便基金份额持有人参与大会投票,投票期间基金管理人向预留手机号码的个人持有人发送征集投票意见短信,持有人按规定格式回复短信即可直接投票。短信投票方式仅适用于个人投资者,不适用于机构投资者。

(四) 投票效力确定规则

1. 如果同一基金份额以有效纸面方式或非纸面方式进行多次表决的,以时间在最后的表决为准;

2. 如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他有效非纸面方式表决的,以有效纸面表决为准。

3. 表决的有效期自送达之日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,以最多重新召开持有人大会两次为限,上述表决继续有效。

五、授权

为便于基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以在投票期间自行投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。基金份额持有人授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

（三）授权方式

1. 纸面授权

本基金的基金份额持有人可通过法律法规认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。基金份额持有人通过纸面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录广发基金网站下载等方式获取授权委托书样本。

2. 纸面授权所需提供的文件

（1）个人基金份额持有人授权委托他人投票的，应由委托人填妥并签署授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并提供个人有效身份证明文件复印件。

如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为基金管理人的，无需提供受托人的企业法人营业执照复印件。

（2）机构持有人授权委托他人投票的，应由委托人填妥授权委托书原件（授

权委托书的格式可参考附件二的样本)并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构持有人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事业单位法人登记证书、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授权委托他人投票的,应由委托人填写授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件二的样本)并在授权委托书上加盖本单位公章(如有)或由授权代表在授权委托书上签字(如无公章),并提供以下材料:①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授权委托书的其他证明文件;②该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或其他有效注册登记证明复印件;③取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;④如由授权代表在授权委托书上签字的,还需提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件。

如受托人为个人,还需提供受托人的有效身份证明文件复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。如受托人为基金管理人的,无需提供受托人的企业法人营业执照复印件。

(3) 以上各项中的公章、批文、开户证明、登记证书等,以基金管理人的认可为准。

3. 纸面授权文件的送达

基金份额持有人纸面授权文件的送达方式、送达时间、收件地址、联系方式等与表决票送达要求一致。

4. 授权效力确定规则

(1) 如委托人既进行委托授权,又存在有效的直接投票表决,则以直接表决为有效表决,授权委托视为无效;

(2) 如同一基金份额存在多次以有效纸面方式授权的,以最后一次纸面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次,不能确定最后一次纸面授权的,以表示具体表决意见的纸面授权为准;最后时间收到的多次纸面授权均未表示具体表决意见的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准;若授权表示不一致,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权;

(3) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

(4) 上述授权有效期自授权之日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，以最多重新召开持有人大会两次为限，上述授权继续有效。

六、计票

1. 本次通讯会议的计票方式为：本公告通知的表决截止日后的2个工作日内，由基金管理人授权的两名监督员在基金托管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及结果予以公证。

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，所提供文件符合本会议公告规定，且在规定的时间内送达本公告规定的收件人的，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) 如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合会议通知规定的，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。

(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，或未能在规定的时间内送达本公告规定的收件人的，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直接投票优先。同一投资者既授权投票又自行投票的，以自行投票的表决票为准。②原件优先。同一投资者既送达投票原件又送达传真件或影印件的，以表决票原件为准。

③最后时间优先。投资者不同时间以相同方式多次投票的，以最后送达的有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回。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，邮寄的以收件人收到的时间为准，其他投票方式以系统记录时间为准。

七、决议生效条件

1. 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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；
2. 《议案》应当由提交有效表决票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。

八、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代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）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》及《基金合同》的规定，基金管理人可在规定的时间内就同一议案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基金份额的持有人参加。

重新召开基金份额持有人大会时，对于投票而言，除非投票人已不在持有人大会权益登记日名单中，基金份额持有人在本次基金份额持有人大会所投的有效表决票依然有效，但如果基金份额持有人重新进行投票的，则以最新的有效表决票为准。对于授权而言，除非授权文件另有载明，或授权委托人已不在持有人大会权益登记日名单中，本次基金份额持有人大会基金份额持有人做出的授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权或明确撤销授权，则以最新授权和投票为准，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。

九、本次大会相关机构

1. 召集人：广发基金管理有限公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 17 楼

联系人：晁梦婷

客服电话：95105828 或 020-83936999

传真：020-34281105、89899070

电子邮件：services@gffunds.com.cn

邮政编码：510308

2. 基金托管人：中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客服电话：95533

公司网址：www.ccb.com

3. 公证机构：广东省广州市南方公证处

地址：广州市越秀区仓边路 26 号 2 楼

联系人：邓军群

联系电话：020-83354571

4. 见证律师事务所：广东广信君达律师事务所

地址：广东省广州市天河区珠江东路 6 号周大福金融中心 29 层、10 层、
11 层（01-04 单元）

联系人：刘智

电话：(020)37181333

十、重要提示

1. 请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2. 如本次基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的有关规定，本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

3. 根据《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会公证费和律师费用等可从基金资产列支，上述费用支付情况将另行公告。

4. 本公告由广发基金管理有限公司解释。如有必要，广发基金管理有限公司可对本公告相关事项进行补充说明。

附件一：《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》及《〈关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案〉的说明》

附件二：《授权委托书（样本）》

附件三：《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票》

附件四：《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同修订对照表》

特此公告。

广发基金管理有限公司

2024 年 5 月 30 日

附件一：《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》及《〈关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案〉的说明》

广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

由于市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》的规定和《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称《基金合同》）的约定，广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的基金管理人经与基金托管人中国建设银行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，审议《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》（以下简称“议案”），拟将本基金基金的类别变更为 ETF 联接基金，并相应将基金名称变更为“广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，同时修改投资范围、变更基金收益分配原则、调整 A 类基金份额赎回费率等，以及根据最新法律法规对《基金合同》进行相应修改。

为实施本基金修改合同的方案，提议授权基金管理人办理本基金本次变更的有关具体事宜，并可在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对《基金合同》进行必要的修改和补充。修改《基金合同》的具体方案请详见本议案附件《〈关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案〉的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据本议案及其附件《〈关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案〉的说明》对《基金合同》进行修改。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，并予以公告。

以上议案，请予审议。

广发基金管理有限公司

2024 年 5 月 30 日

《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》的说明

一、声明

1. 由于市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据《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》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称《基金合同》）和《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称《招募说明书》）的有关规定，经与基金托管人中国建设银行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，审议《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》（以下简称“议案”）。

2. 本次议案须经参加本次持有人大会的本基金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，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3. 基金份额持有人大会决议通过的事项，基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。

二、本基金变更方案

（一）变更基金名称和基金的类别

本基金基金名称将由“广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）”变更为“广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”（以下简称“广发深证 100ETF 联接”）。

本基金基金的类别由“股票型证券投资基金”变更为“ETF 联接基金”。

（二）本基金变更后不在二级市场交易，基金合同中删除“基金份额的上市交易”章节，并在相关章节删除与基金份额上市交易有关的表述。

（三）保留 A 类基金份额场内申购、赎回业务

广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) A 类基金份额可通过场内、场外两种方式办理申购与赎回, C 类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。变更后, 广发深证 100ETF 联接 A 类基金份额仍可通过场内、场外两种方式办理申购与赎回, C 类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。

(四) 降低 A 类基金份额的赎回费

原 A 类基金份额赎回费为:

持有期限 (N 为日历日)	场外赎回费率
N < 7 日	1.5%
7 日 ≤ N < 1 年	0.5%
1 ≤ N < 2 年	0.25%
N ≥ 2 年	0
持有期限 (N 为日历日)	场内赎回费率
N < 7 日	1.5%
N ≥ 7 日	0.5%

对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费, 并将上述赎回费全额计入基金财产, 对于持续持有期不少于 7 日 (含) 的投资者收取的赎回费, 将不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产, 其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

变更后 A 类基金份额赎回费为:

持有期限 (N 为日历日)	场内、场外赎回费率
N < 7 日	1.5%
N ≥ 7 日	0

对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费, 并将上述赎回费全额计入基金财产。

(五) 变更基金收益分配原则

由“在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为 6 次, 每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

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”

变更为：

“本基金每月进行分红评估，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每季度最少分配 1 次、最多分配 3 次，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金场外份额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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额收益分配方式为现金分红，场内份额具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定”

(六) 修订后广发深证 100ETF 联接（本条目下称“本基金”）的基本情况

1. 基金名称：广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2. 基金类别：ETF 联接基金

3. 运作方式：契约型开放式

4. 投资目标：本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

5. 投资范围：本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括创业板、科创板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证）、银行存款、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许本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）。本基金的目标 ETF 为广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。

本基金可根据相关法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

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

6. 投资比例：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易

保证金后，现金及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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

7. 投资策略：本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金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控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。

8. 风险收益特征：本基金为 ETF 联接基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

9. 业绩比较基准：深证 100 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

10. 基金份额类别：本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而是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。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。

11. 费率水平

(1) 本基金的管理费率为 0.50%/年，本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。

(2) 本基金的托管费率为 0.15%/年，本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。

(3) C 类基金份额的销售服务费率 0.20%/年。

(4) 本基金对申购设置级差费率，A 类基金份额场外申购费率如下表，C 类基金份额不收取申购费。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金按照场外申购费率设定场内申购的申购费用。

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.2%

100 万元 \leq M<200 万元	0.8%
200 万元 \leq M<500 万元	0.4%
M \geq 500 万元	1000 元/笔

基金销售机构可以根据自身情况对申购费用实行一定的优惠，具体以实际收取为准。本基金对通过本公司直销中心申购 A 类基金份额的特定投资者与除此之外的其他普通投资者实施差别的申购费率，特定投资者范围及具体费率优惠详见基金管理人发布的相关公告。

(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。

1) 本基金 A 类基金份额的场内赎回和场外赎回均适用相同的赎回费率，具体如下：

持有期限 (N 为日历日)	赎回费率
N<7 日	1.5%
N \geq 7 日	0

对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

2) 本基金 C 类基金份额的赎回费率：

持有期限 (N 为日历日)	赎回费率
N<7 日	1.5%
N \geq 7 日	0

对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

(七) 其他修改

根据现时有效的法律法规及基金实际投资运作情况对《基金合同》进行其他必要的修订和补充，详见附件四《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 变更注册为广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修订对照表》。托管协议、招募说明书以及其他材料中涉及上述修改的地方，将一并修改。

三、《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的生效

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人落实上述变更事项，并授权基金管理人可根据业务规则和实际情况做相应调整。具体业务办理和时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

修订后的《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效时间将由基金管理人另行公告。

四、本次基金份额持有人大会的主要风险及预备措施

1. 持有人大会不能成功召开的风险

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，基金份额持有人大会应当有权益登记日代表基金份额二分之一（含二分之一）以上基金份额的持有人参加，方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前尽可能与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

2. 议案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范议案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后对议案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可以在必要的情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间，或更改其他会务安排，并予以公告。

如本次议案未获得基金份额持有人大会审议通过，则基金管理人可按照有关规定再次召集基金份额持有人大会进行审议。

3. 基金份额持有人集中赎回基金份额的流动性风险

在本基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的事项及《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》公告后，部分基金份额持有人可能选择提前赎回其持有的基金份额。

在基金份额持有人大会决议生效并公告前，持有人申请赎回其持有的基金份额仍需按照《基金合同》约定的方式进行。但如果发生了巨额赎回或可以暂停赎回的情形，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，或暂停接受基金的赎回申请、延缓支付赎回款项。同时，基金管理人也会提前做好流动性安排，对资产进行变现以应对可能的赎回。

四、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本议案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系：

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金管理人网站：www.gffunds.com.cn

客服电话：95105828 或 020-83936999

附件二：授权委托书

本人/本机构持有或所管理的产品持有广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的基金份额，就广发基金管理有限公司网站（www.gffunds.com.cn）及 2024 年 5 月 30 日《上海证券报》公布的《关于以通讯方式召开广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人/本机构的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

同意	反对	弃权

本人/本机构特此授权_____代表本人/本机构参加审议上述事项的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。本人/本机构同意受托人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止；但如果本基金根据本公告“八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权”章节的规定就相同审议事项重新召集持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（填写）：

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1. 本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》要求的授权委托书。

2. 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3. 如委托人未在授权委托书表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托书表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

4. 本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5. 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，则其授权无效。

附件四：广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）变更注册为广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金合同修订对照表

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
全文	指定媒介	规定媒介
全文	指定报刊	规定报刊
全文	指定网站	规定网站
全文	具有证券、期货相关业务资格	符合《证券法》规定
全文	具有证券相关业务资格	符合《证券法》规定
一、前言	<p>（一）订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>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》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p>（二）基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。</p>	<p>（一）订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p>（二）基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。</p>

<p>基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。</p> <p>(三)广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 由广发深证 100 指数分级证券投资基金转型而来, 广发深证 100 指数分级证券投资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。转型后的广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 已经中国证监会变更注册。《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效后, 原《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》自同一日终止, 原《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》的当事人, 即基金管理人、基金托管人和基金份额持有人自动转为《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的当事人。</p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策, 自行承担投资风险。</p> <p>本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求, 自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。(删除)</p> <p>.....</p>	<p>(三)广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 转型而来, 广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 由广发深证 100 指数分级证券投资基金转型而来。广发深证 100 指数分级证券投资基金经中国证监会 2012 年 2 月 15 日《关于核准广发深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]200 号文)核准募集, 《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 7 日起正式生效。经中国证监会 2018 年 10 月 19 日《关于准予广发深证 100 指数分级证券投资基金变更注册批复》, 并通过广发深证 100 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议。自 2020 年 5 月 26 日起, 《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效, 原《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。经中国证监会 2024 年 4 月 16 日《关于准予广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 变更注册的批复》(证监许可[2024]598 号文), 并通过广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议, 自 XX 年 XX 月 XX 日起, 广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 正式转型为广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金, 《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效, 《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》同日起失效。《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效后, 不再保留原广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 的上市交易功能。</p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件, 自主判断基金的投资价</p>
--	---

		值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。
二、释义	<p>在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：</p> <p>1. 基金或本基金：指<u>广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）</u></p> <p>.....</p> <p>4. 基金合同或本基金合同：指<u>《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》</u>及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之<u>《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）托管协议》</u>及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6. 招募说明书：指<u>《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》</u>及其更新</p> <p>7. 上市交易公告书：指<u>《广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)之 A 份额上市交易公告书》</u>（删除）</p> <p>.....</p> <p>9. 《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，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〉等七部法律的规定》<u>修改的《中华人民共和国证券投资基金法》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>10. 《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的<u>《证券投资基金销售管理办法》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1</p>	<p>在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：</p> <p>1. 基金或本基金：指<u>广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u></p> <p>.....</p> <p>4. 基金合同或本基金合同：指<u>《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》</u>及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之<u>《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》</u>及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6. 招募说明书：指<u>《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》</u>及其更新</p> <p>.....</p> <p>8. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 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》<u>修正的《中华人民共和国证券投资基金法》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>9. 《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的<u>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>10. 《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1</p>

<p>日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>.....</p> <p><u>16. 银行业监督管理机构</u>：指中国人民银行和/或<u>中国银行保险监督管理委员会</u></p> <p><u>17. 标的指数</u>：指<u>深证 100 价格指数及其未来可能发生的变更</u></p> <p>.....</p> <p><u>21. 合格境外机构投资者</u>：指符合<u>现时有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者</u></p> <p><u>22. 投资人</u>：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人的合称</p> <p>.....</p> <p><u>24. 基金销售业务</u>：指基金管理人或<u>代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务</u></p> <p>.....</p> <p><u>29. 场内</u>：指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和<u>上市交易业务的场所</u></p> <p>.....</p> <p><u>32. 注册登记系统</u>：指本基金场外份额的登记结算系统。本基金场外 A 类份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，本基金 C 类份额登记在广发基金管理有限公司<u>登记结算系统</u></p>	<p>日实施，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《<u>关于修改部分证券期货规章的决定</u>》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>.....</p> <p><u>15. 银行业监督管理机构</u>：指中国人民银行和/或<u>国家金融监督管理总局</u></p> <p><u>16. 标的指数</u>：指<u>深圳证券信息有限公司编制并发布的深证 100 指数（指数代码：399330）及其未来可能发生的变更</u></p> <p>.....</p> <p><u>20. 合格境外投资者</u>：指符合《<u>合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法</u>》及相关法律法规规定，<u>可以使用来自境外的资金投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</u></p> <p><u>21. 投资人、投资者</u>：指个人投资者、机构投资者和合格境外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</p> <p>.....</p> <p><u>23. 基金销售业务</u>：指基金管理人或<u>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、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务</u></p> <p>.....</p> <p><u>28. 场内</u>：指通过深圳证券交易所会员单位和深圳证券交易所交易系统办理基金份额申购、赎回的<u>场所</u></p> <p>.....</p> <p><u>31. 注册登记系统</u>：指本基金场外份额的登记结算系统。本基金场外 A 类份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，本基金 C 类份额登记在广发基金管理有限公司<u>开放式基金登记过户系统</u></p>
---	---

<p>.....</p> <p><u>37. 基金交易账户</u>：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构<u>买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户</u></p> <p>.....</p> <p><u>39. 基金合同生效日</u>：指《<u>广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同</u>》生效日，原《<u>广发深证 100 分级指数证券投资基金基金合同</u>》自本基金合同生效日起<u>终止</u></p> <p>.....</p> <p><u>50. 会员单位</u>：指具有基金<u>代销业务</u>资格的深圳证券交易所会员单位</p> <p><u>51. 上市交易</u>：指基金合同生效后投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式<u>买卖基金份额的行为</u>（<u>删除</u>）</p> <p>.....</p> <p><u>54. 系统内转托管</u>：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行<u>转登记</u>的行为</p> <p><u>55. 跨系统转托管</u>：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行<u>转登记</u>的行为</p> <p><u>56. 定期定额投资计划</u>：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式</p> <p>.....</p> <p><u>60. 基金资产总值</u>：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>.....</p> <p><u>63. 基金资产估值</u>：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程</p>	<p>.....</p> <p><u>36. 基金交易账户</u>：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构<u>办理认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</u></p> <p>.....</p> <p><u>38. 基金合同生效日</u>：指《<u>广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同</u>》生效日，原《<u>广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同</u>》自本基金合同生效日起<u>失效</u></p> <p>.....</p> <p><u>49. 会员单位</u>：指具有基金<u>销售业务</u>资格的深圳证券交易所会员单位</p> <p>.....</p> <p><u>52. 系统内转托管</u>：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行<u>转托管</u>的行为</p> <p><u>53. 跨系统转托管</u>：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行<u>转托管</u>的行为</p> <p><u>54. 定期定额投资计划</u>：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及<u>受理</u>基金申购申请的一种投资方式</p> <p>.....</p> <p><u>58. 基金资产总值</u>：指基金拥有的各类有价证券及<u>票据价值</u>、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>.....</p> <p><u>61. 基金资产估值</u>：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程</p>
--	--

<p><u>64. 指定媒介</u>：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介（删除）</p> <p><u>65. 基金份额类别</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A类和C类不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是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</p> <p><u>66. 流动性受限资产</u>：指由于法律</p>	<p><u>62. 基金份额类别</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A类和C类不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用而不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是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</p> <p><u>63. 目标ETF</u>：指广发深证100交易型开放式指数证券投资基金（简称“广发深证100ETF”）</p> <p><u>64. ETF联接基金</u>：指将绝大多数基金财产投资于目标ETF，与目标ETF的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，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”</p> <p><u>65. 侧袋机制</u>：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> <p><u>66. 特定资产</u>：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p> <p><u>67. 规定媒介</u>：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介（新增，以下序号依次递增）</p> <p><u>68. 流动性受限资产</u>：指由于法律</p>
---	--

	<p>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</p> <p>.....</p> <p>68. 基金产品资料概要：指《<u>广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要</u>》及其更新</p> <p>.....</p>	<p>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<u>出借期限在 10 个交易日以上的转融通出借证券</u>、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</p> <p>69. <u>转融通证券出借业务</u>：指基金以一定费率通过<u>证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券</u>，<u>中国证券金融股份有限公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务</u>（<i>新增，以下序号依次递增</i>）</p> <p>.....</p> <p>71. 基金产品资料概要：指《<u>广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要</u>》及其更新</p> <p>.....</p>
<p>三、基金的基本情况</p>	<p>（一）基金的名称 <u>广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）</u></p> <p>（二）基金的类别 <u>股票型证券投资基金</u></p> <p>.....</p> <p>（四）基金的投资目标 <u>本基金采用指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制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小于 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对深证 100 指数的有效跟踪。</u></p> <p>（五）标的指数 <u>深证 100 价格指数。</u></p> <p>（六）基金份额的上市交易 <u>本基金基金合同生效后，本基金的 A 类份额将申请在深圳证券交易所上市交易。（删除）</u></p> <p>.....</p> <p>（八）基金份额类别</p> <p>.....</p>	<p>（一）基金的名称 <u>广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u></p> <p>（二）基金的类别 <u>ETF 联接基金</u></p> <p>.....</p> <p>（四）基金的投资目标 <u>本基金通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</u></p> <p>（五）标的指数 <u>深证 100 指数。</u></p> <p>.....</p> <p>（七）基金份额类别</p> <p>.....</p>

	<p>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。根据基金销售情况，在符合法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加、减少或调整基金份额类别设置、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式等，调整前基金管理人需及时公告。<u>本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。</u></p>	<p>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。根据基金销售情况，在符合法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加、减少或调整基金份额类别设置、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式等，调整前基金管理人需及时公告。</p> <p><u>(八) 本基金与目标 ETF 的联系与区别</u></p> <p><u>本基金的目标 ETF 是广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金（简称广发深证 100 ETF）。</u></p> <p><u>本基金为广发深证 100 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：</u></p> <p><u>(1) 在投资方法方面，目标 ETF 直接投资于标的指数的成份股及备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。</u></p> <p><u>(2) 在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标 ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，申赎目标 ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。</u></p> <p><u>本基金与目标 ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：</u></p> <p><u>(1) 法律法规对投资比例的要求。目标 ETF 作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产投资于标的指数成份股及备选成份股；而本基金作为普通的开放式基金，每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，仍需保留不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。</u></p>
--	---	---

		<p>(2)申购赎回的影响。目标 ETF 采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。<i>(新增)</i></p>
<p>四、基金的历史沿革与存续</p>	<p>(一) 本基金的历史沿革</p> <p>广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 由广发深证 100 指数分级证券投资基金变更而来。广发深证 100 指数分级证券投资基金经中国证监会 2012 年 2 月 15 日《关于核准广发深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]200 号文)核准募集，基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。</p> <p>.....</p> <p>自 2020 年 5 月 26 日起，《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效，原《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。</p> <p>(二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</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 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告</p>	<p>(一) 本基金的历史沿革</p> <p><u>广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 转型而来</u>，广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 由广发深证 100 指数分级证券投资基金转型而来。广发深证 100 指数分级证券投资基金经中国证监会 2012 年 2 月 15 日《关于核准广发深证 100 指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]200 号文)核准募集，基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。</p> <p>.....</p> <p>自 2020 年 5 月 26 日起，《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效，原《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。</p> <p><u>经中国证监会 2024 年 4 月 16 日《关于准予广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 变更注册的批复》(证监许可[2024]598 号文)</u>，并通过广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会决议。自 XX 年 XX 月 XX 日起，<u>广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 正式转型为广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>，《广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》同日起失效。<i>(新增)</i></p> <p>(二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</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 5,000 万</p>

	<p>中予以披露；<u>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。</u></p> <p>.....</p>	<p>元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；<u>连续 50 个工作日出现上述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。</u></p> <p>.....</p>
五、基金份额的上市交易	(整章删除)	

<p>五、基金 份额的申 购与赎回</p>	<p>本基金合同生效后,投资人在本基金的开放日可通过场外或场内两种方式对基金份额进行申购与赎回。</p> <p>本基金C类基金份额暂时仅接受场外申购和赎回。本基金A类基金份额可接受场内和场外申购与赎回。其中,登记在注册登记系统中的基金份额可直接办理场外申购与赎回等场外基金业务,也可通过办理跨系统<u>转登记</u>业务将基金份额<u>转登记</u>到证券登记结算系统中,再办理场内申购、赎回业务;登记在证券登记结算系统中的A类基金份额可直接办理场内申购、赎回业务,也可以通过办理跨系统<u>转登记</u>业务将基金份额<u>转登记</u>到注册登记系统中,再办理场外申购与赎回等场外基金业务。</p> <p>(一) 申购和赎回场所</p> <p>基金份额场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外销售机构的销售网点;基金份额场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。具体的销售网点和办理申购赎回业务的会员单位将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减<u>代销机构</u>,并在基金管理人网站公示。</p> <p>投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理本基金基金份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的<u>代销机构</u>开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行本基金基金份额的申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。</p> <p>(二) 申购和赎回的开放日及时间</p> <p>2. 申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日</p>	<p>本基金合同生效后,投资人在本基金的开放日可通过场外或场内两种方式对基金份额进行申购与赎回。</p> <p>本基金C类基金份额暂时仅接受场外申购和赎回。本基金A类基金份额可接受场内和场外申购与赎回。其中,登记在注册登记系统中的基金份额可直接办理场外申购与赎回等场外基金业务,也可通过办理跨系统<u>转托管</u>业务将基金份额<u>转托管</u>到证券登记结算系统中,再办理场内申购、赎回业务;登记在证券登记结算系统中的A类基金份额可直接办理场内申购、赎回业务,也可以通过办理跨系统<u>转托管</u>业务将基金份额<u>转托管</u>到注册登记系统中,再办理场外申购与赎回等场外基金业务。<u>基金管理人有权根据相关业务规则 and 实际情况制定跨系统转托管的具体实施方案。</u></p> <p>(一) 申购和赎回场所</p> <p>基金份额场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外销售机构的销售网点;基金份额场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。具体的销售网点和办理申购赎回业务的会员单位将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减<u>销售机构</u>,并在基金管理人网站公示。</p> <p>投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理本基金基金份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的<u>销售机构</u>开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行本基金基金份额的申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。</p> <p>(二) 申购和赎回的开放日及时间</p> <p>2. 申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人可根据实际情况依法</p>
-------------------------------	--	---

<p>起不超过三个月开始办理本基金基金份额的申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>.....</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各类基金份额的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>.....</p> <p>(四) 申购与赎回的程序</p> <p>.....</p> <p>3. 申购和赎回的款项支付</p> <p>申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的<u>代销机构</u>将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。</p> <p>.....</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1. 本基金各类份额的基金份额净值的计算，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日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内披露。遇特殊情况，<u>经中国证监会同意</u>，可以适当延迟计算或披露。</p> <p>.....</p> <p>3. 赎回金额的计算及处理方式：本基金各类份额赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>.....</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的各类基金份额的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>.....</p> <p>(四) 申购与赎回的程序</p> <p>.....</p> <p>3. 申购和赎回的款项支付</p> <p>申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的<u>销售机构</u>将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。</p> <p>.....</p> <p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1. <u>由于基金费用的不同，本基金各A类基金份额的和C类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为：</u></p> <p><u>计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日该类基金份额余额总数（新增）</u></p> <p>本基金各类份额的基金份额净值的计算，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日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内披露。遇特殊情况，<u>经履行适当程序后</u>，可以适当延迟计算或披露。</p> <p>.....</p> <p>3. 赎回金额的计算及处理方式：本基金各类份额赎回金额的计算详见《招募说明书》，<u>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的费用</u>，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金</p>
---	---

	<p>.....</p> <p>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。对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产，<u>对于持续持有期不少于 7 日(含)的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</u></p> <p>.....</p> <p>7. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。</p> <p>.....</p> <p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>.....</p> <p>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，<u>从而损害</u>现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>.....</p> <p>7. 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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p>	<p>财产承担。</p> <p>.....</p> <p>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。<u>赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，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。</u>其中，对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。</p> <p>.....</p> <p>7. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、<u>基金赎回费率、转换费率和销售服务费率。</u></p> <p>.....</p> <p>(七) 拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>.....</p> <p>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，<u>或发生其他</u>损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>.....</p> <p>7. 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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。</p> <p><u>8. 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系</u></p>
--	---	--

	<p>8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述暂停申购情形（除第 4 和 6 项外）且基金管理人决定暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在<u>指定媒介</u>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。</p> <p>.....</p> <p>（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>.....</p> <p>5. 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</p>	<p>统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p><u>9. 目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。（新增，以下序号依次递增）</u></p> <p><u>10. 目标 ETF 暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。</u></p> <p>法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述暂停申购情形（除第 4 和 6 项外）且基金管理人决定<u>拒绝或暂停</u>申购接受投资者的申请时，基金管理人应当根据有关规定在<u>规定媒介</u>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。</p> <p>.....</p> <p>（八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>.....</p> <p>5. 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。</p> <p><u>6. 发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。</u></p> <p><u>7. 目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u></p> <p><u>8. 目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或证券交易所场内交易停牌等有必要暂停本基金赎回的情形。</u></p> <p><u>9. 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系</u></p>
--	--	---

	<p>6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形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，对于场外赎回申请，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。<u>若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒介上公告。</u>投资人在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。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在本基金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予以公告。</p> <p>.....</p> <p>（十一）基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。<u>本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额之间暂不允许进行相互转换。</u></p> <p>.....</p>	<p><u>统或基金会计系统无法正常运行。（新增，以下序号依次递增）</u></p> <p>10. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形<u>之一</u>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，基金管理人应按规定报中国证监会备案，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，对于场外赎回申请，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资人在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。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。<u>若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。</u>在本基金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予以公告。</p> <p>.....</p> <p>（十一）基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。</p> <p>.....</p>
--	---	---

<p>六、基金份额的登记、转托管及其他业务</p>	<p>(一) 基金份额的登记</p> <p>本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购<u>买入</u>的基金份额登记在注册登记机构的基金账户下；场内申购或<u>上市交易买入</u>的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在<u>深圳证券交易所上市交易</u>，也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记机构基金账户下的基金份额可申请场外赎回。</p> <p>(二) 基金的转托管</p> <p>.....</p> <p>1. A类基金份额的系统内转托管</p> <p>.....</p> <p>(3) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回的会员单位（交易单元）、<u>或变更办理基金份额上市交易的会员单位（交易单元）</u>时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。</p> <p>.....</p>	<p>(一) 基金份额的登记</p> <p>本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购的基金份额登记在注册登记机构的基金账户下；场内申购的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额可以直接申请场内赎回。登记在注册登记机构基金账户下的基金份额可申请场外赎回。</p> <p>(二) 基金的转托管</p> <p>.....</p> <p>1. A类基金份额的系统内转托管</p> <p>.....</p> <p>(3) 基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回的会员单位（交易单元）时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。</p> <p>.....</p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>.....</p> <p>住所：<u>广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）</u></p> <p><u>办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼（删除）</u></p> <p>法定代表人：<u>孙树明</u></p> <p>.....</p> <p>(四) 基金管理人的权利</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：</p> <p>.....</p> <p>8. 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、融券；</p> <p>.....</p> <p>10. 选择、<u>更换代销机构</u>，并依据基金销售服务<u>代理协议</u>和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；</p> <p>.....</p> <p>(五) 基金管理人的义务</p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>.....</p> <p>住所：<u>广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室</u></p> <p>法定代表人：<u>葛长伟</u></p> <p>.....</p> <p>(四) 基金管理人的权利</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：</p> <p>.....</p> <p>8. 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、融券、<u>转融通证券出借业务</u>；</p> <p>.....</p> <p>10. 选择、<u>更换销售机构</u>，并依据基金销售服务协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；</p> <p>.....</p> <p>(五) 基金管理人的义务</p>

<p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：</p> <p>14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露； </p> <p>17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料； </p> <p>（七）基金托管人的义务 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：</p> <p>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应予保密，不得向他人泄露； </p> <p>9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料； </p> <p>（八）基金份额持有人的权利</p> <p>5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权； </p>	<p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：</p> <p>14. 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露，<u>但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；</u> </p> <p>17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，<u>保存期限不低于法律法规规定的最低期限；</u> </p> <p>（七）基金托管人的义务 根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：</p> <p>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应予保密，不得向他人泄露；<u>但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；</u> </p> <p>9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，<u>保存期限不低于法律法规规定的最低期限；</u> </p> <p>（八）基金份额持有人的权利</p> <p>5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权； 6. <u>按照目标 ETF 基金合同的约定出席或者委派代表出席目标 ETF 基金份额持有人大会并对目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</u> <i>（新增，以下次序依次更新）</i> </p>
---	---

	<p>(九) 基金份额持有人的义务</p> <p>8. 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、<u>代销机构</u>、其他基金份额持有人处获得的不当得利;</p>	<p>(九) 基金份额持有人的义务</p> <p>8. 返还在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、<u>销售机构</u>、其他基金份额持有人处获得的不当得利;</p>
<p>八、基金份额持有人大会</p>	<p>.....</p> <p>本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。</p> <p>(一) 召开事由</p> <p>1. 除法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定外, 当出现或需要决</p>	<p>.....</p> <p>本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。</p> <p><u>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金, 本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系, 本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决, 其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为: 在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日, 本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例。计算结果按照四舍五入的方法, 保留到整数位。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的, 须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的, 由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。(新增)</u></p> <p>(一) 召开事由</p> <p>1. 除法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定外, 当出现或需要决</p>

<p>定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>.....</p> <p>(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求调整该等报酬标准的除外；</p> <p>.....</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略（<u>法律法规和中国证监会另有规定的除外</u>）；</p> <p>.....</p> <p>2. 在不违反有关法律法规和《基金合同》约定，并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：</p> <p>.....</p> <p>(8) 增加基金份额类别；</p> <p>.....</p> <p>(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</p> <p>.....</p> <p>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>书面表决意见</u>寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>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</p>	<p>定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>.....</p> <p>(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准<u>或提高销售服务费率</u>，但法律法规要求调整该等报酬标准<u>或提高销售服务费率</u>的除外；</p> <p>.....</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略，<u>但由于目标 ETF 交易方式变更、终止上市或目标 ETF 基金合同终止而变更本基金投资目标、范围或策略的情况以及法律法规和中国证监会另有规定的除外</u>；</p> <p>.....</p> <p>2. 在不违反有关法律法规和《基金合同》约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，<u>履行适当程序后</u>，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：</p> <p>.....</p> <p>(8) 增加基金份额类别；</p> <p><u>(9) 由于目标 ETF 终止上市或基金合同终止，而变更本基金投资目标、范围或策略；</u></p> <p><u>(10) 因目标 ETF 变更或调整业绩比较基准，本基金相应对业绩比较基准进行变更或调整；（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p>.....</p> <p>(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</p> <p>.....</p> <p>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>表决意见</u>寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>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</p>
--	--

<p>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<u>书面表决意见</u>的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p> <p>（四）基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>.....</p> <p>2. 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>.....</p> <p>（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对<u>书面表决意见</u>的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的<u>书面表决意见</u>；基金管理人或基金托管人经通知不参加收取<u>书面表决意见</u>的，不影响表决效力；</p> <p>（3）本人直接出具<u>书面意见</u>或授权他人代表出具<u>书面意见</u>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50%（含50%）；</p> <p>（4）上述第（3）项中直接出具<u>书面意见</u>的基金份额持有人或受托代表他人出具<u>书面意见</u>的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具<u>书面意见</u>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，并与基金登记注册机构记录相符。</p> <p>.....</p> <p>（六）表决</p>	<p>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<u>表决意见</u>的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。</p> <p>（四）基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>.....</p> <p>2. 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式<u>或大会公告载明的其他方式</u>在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式<u>或大会公告载明的其他方式</u>进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>.....</p> <p>（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对<u>表决意见</u>的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的<u>表决意见</u>；基金管理人或基金托管人经通知不参加收取<u>表决意见</u>的，不影响表决效力；</p> <p>（3）本人直接出具<u>表决意见</u>或授权他人代表出具<u>表决意见</u>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50%（含50%）；</p> <p>（4）上述第（3）项中直接出具<u>表决意见</u>的基金份额持有人或受托代表他人出具<u>表决意见</u>的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具<u>表决意见</u>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，并与基金登记注册机构记录相符。</p> <p>.....</p> <p>（六）表决</p>
--	--

	<p>.....</p> <p>2. 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p> <p>.....</p> <p>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<u>书面表决意见</u>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<u>书面意见</u>的基金份额持有人所代表的基金份额总数。</p> <p>.....</p> <p>（七）计票</p> <p>.....</p> <p>2. 通讯开会</p> <p>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<u>书面表决意见</u>的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。</p> <p>（八）生效与公告</p> <p>.....</p> <p>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。</p>	<p>.....</p> <p>2. 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p> <p>.....</p> <p>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<u>表决意见</u>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<u>表决意见</u>的基金份额持有人所代表的基金份额总数。</p> <p>.....</p> <p>（七）计票</p> <p>.....</p> <p>2. 通讯开会</p> <p>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<u>表决意见</u>的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。</p> <p>（八）生效与公告</p> <p>.....</p> <p>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。</p> <p><u>（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</u></p> <p>若本基金实施侧袋机制，则相关<u>基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，</u></p>
--	---	--

		<p>但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：</p> <p>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；</p> <p>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；</p> <p>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；</p> <p>6、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；</p> <p>7、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。</p> <p>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。（新增，以下次序依次更新）</p> <p>.....</p>
<p>十、基金的托管</p>	<p>基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《广发深证</p>	<p>基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《广发深证</p>

	<p>100 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责, 确保基金财产的安全, 保护基金份额持有人的合法权益。</p>	<p>100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责, 确保基金财产的安全, 保护基金份额持有人的合法权益。</p>
<p>十二、基金的投资</p>	<p>(一) 投资目标</p> <p>本基金采用指数化投资方式, 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段, 力争控制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小于 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%, 实现对深证 100 指数的有效跟踪。</p> <p>(二) 投资范围</p> <p>本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括深证 100 指数成份股 (含存托凭证)、备选成份股 (含存托凭证)、其他股票 (包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、权证、股指期货、债券 (包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款及其他银行存款) 以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>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, 其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%, 其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或者到期日在一年以内的政府债券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。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或</p>	<p>(一) 投资目标</p> <p>本基金通过主要投资于目标 ETF, 紧密跟踪业绩比较基准, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>(二) 投资范围</p> <p>本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股 (含存托凭证) 为主要投资对象。此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于非成份股 (包括创业板、科创板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证)、银行存款、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金的目标 ETF 为广发深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>本基金可根据相关法律法规的规定参与转融通证券出借业务。</p> <p>基金的投资组合比例为: 投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 现金及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%, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许</p>

	<p>监管机构的规定执行。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。</p> <p><u>(三) 投资理念</u></p> <p><u>本基金以跟踪标的指数为基本原则，进行被动式指数化长期投资，为投资者提供一个投资深证100指数的有效投资工具，谋求分享中国经济长期增长的回报。(删除)</u></p> <p><u>(四) 投资策略</u></p> <p><u>本基金为指数型基金，主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。当成份股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。</u></p> <p><u>1. 资产配置策略</u></p> <p><u>本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。</u></p> <p><u>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%，其中投资于深证100指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</u></p>	<p>本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。</p> <p><u>(三) 投资策略</u></p> <p><u>本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金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控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。</u></p> <p><u>1. 资产配置策略</u></p> <p><u>本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证），其中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括创业板、科创板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证）、银行存款、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指</u></p>
--	---	--

	<p><u>数。</u></p> <p><u>本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。</u></p> <p><u>2. 目标 ETF 投资策略</u></p> <p><u>(1) 投资组合的投资方式</u></p> <p><u>本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券交易所场内交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。当目标 ETF 申购、赎回或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。</u></p> <p><u>(2) 投资组合的调整</u></p> <p><u>本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资目标 ETF 的时间和方式。</u></p> <p><u>1) 当净申购时，本基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、目标 ETF 的申购或买入等；</u></p> <p><u>2) 当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定目标 ETF 的赎回或卖出等。（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p><u>2. 股票投资策略</u></p> <p><u>(1) 股票组合的构建</u></p> <p><u>本基金主要采取完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股的构成及其权重构建指数化投资组合。但是当基金管理人预期标的指数成份股将调整，或由于标的指数成份股发生分红、增发、配股等行为，或由于成份股出现停牌限制、流动性问题等可能影响跟踪效果的情形时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪。</u></p> <p><u>(2) 股票组合的调整</u></p> <p><u>1) 股票组合调整原则</u></p> <p><u>本基金为完全复制的指数型基金，所构建的股票投资组合将根据深证 100 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情</u></p>	<p><u>数。</u></p> <p><u>本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。</u></p> <p><u>2. 目标 ETF 投资策略</u></p> <p><u>(1) 投资组合的投资方式</u></p> <p><u>本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券交易所场内交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。当目标 ETF 申购、赎回或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。</u></p> <p><u>(2) 投资组合的调整</u></p> <p><u>本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资目标 ETF 的时间和方式。</u></p> <p><u>1) 当净申购时，本基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、目标 ETF 的申购或买入等；</u></p> <p><u>2) 当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定目标 ETF 的赎回或卖出等。（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p><u>3. 股票投资策略</u></p> <p><u>(1) 股票组合构建原则</u></p> <p><u>根据标的指数，结合研究判断和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。</u></p> <p><u>(2) 股票组合构建方法</u></p> <p><u>本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些</u></p>
--	--	--

<p>况、配股增发因素等变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的跟踪误差最小化。</p> <p><u>2) 股票组合调整方法</u></p> <p><u>①定期调整</u></p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据所跟踪的深证100指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。由于深证100指数成份股的定期调整定于每年1月和7月的第一个交易日实施，通常在前一年的12月和当年的6月的第二个完整交易周的第一个交易日提前公布样本调整方案，所以本基金指数化投资组合的调整期间原则上定为：每年一月和七月的调整方案公布日至指数正式调整日之前。</p> <p>本基金将按照深证100指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。</p> <p><u>②不定期调整</u></p> <p>A. 根据指数编制规则，当深证100指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据深证100指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。</p> <p>B. 若个别成份股因停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得本基金无法按照其所占标的指数权重进行购买时，本基金将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，对投资组合进行相应调整。</p> <p>C. 本基金将根据申购、赎回情况对投资组合的影响，以有效跟踪标的指数为目的，对投资组合进行相应调整。</p> <p>D. 针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。</p> <p>E. 其他影响指数复制的因素，本基金可以根据实际情况，结合以往经验，在跟踪误差最小化的条件下，对本基金</p>	<p>影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。</p> <p><u>(3) 股票组合的调整</u></p> <p><u>①定期调整</u></p> <p>本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p><u>②不定期调整</u></p> <p>基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p> <p>本基金参与非标的指数成份股投资的，应当坚守产品定位，符合投资目标、投资策略、跟踪误差等要求，具有充分的投资依据，并履行基金管理人内部决策程序。</p>
--	--

<p>资产进行适当调整。</p> <p><u>(3) 投资组合绩效评估</u> <u>本基金对标的指数的跟踪目标是：力争控制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小于0.35%，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基金跟踪偏离度和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。</u></p> <p><u>(4) 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。(删除)</u></p> <p><u>3. 债券投资策略</u> <u>基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。</u></p> <p><u>4. 股指期货投资策略</u> <u>本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</u></p> <p><u>本基金运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标</u></p>	<p><u>4. 存托凭证投资策略</u> <u>为更好地实现投资目标，本基金可投资存托凭证。基金管理人将在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，审慎参与存托凭证的投资。(新增，以下次序依次更新)</u></p> <p><u>5. 债券投资策略</u> <u>本基金将通过自上而下的宏观分析，结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。</u></p> <p><u>6. 金融衍生品投资策略</u> <u>为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。</u></p> <p><u>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，力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。</u></p> <p><u>本基金投资国债期货将按照风险</u></p>
---	--

<p>的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p><u>5. 权证投资策略</u> <u>权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于提高基金资产的投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。</u> <u>若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。（删除）</u></p> <p><u>6. 资产支持证券投资策略</u> <u>本基金将重点对市场利率、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影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</u></p> <p><u>（五）标的指数与业绩比较基准</u> <u>1. 标的指数</u> <u>本基金的标的指数为深证100价格指数。</u> <u>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出</u></p>	<p>管理的原则，以套期保值为主要目的。<u>基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。</u></p> <p><u>本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与股票期权投资。</u></p> <p><u>7. 资产支持证券投资策略</u> <u>本基金将重点对市场利率、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影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</u></p> <p><u>8. 参与转融通证券出借业务策略</u> <u>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎性原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。（新增）</u></p> <p><u>（四）业绩比较基准</u></p>
--	---

<p>等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。</p> <p>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。（删除）</p> <p><u>2. 业绩比较基准</u></p> <p>本基金的业绩比较基准：<u>95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。</u></p> <p>本基金以深证100价格指数为标的指数，但由于相关法规的要求，本基金投资股票的资产不超过基金资产净值的95%；且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，因此，选用“95%×深证100价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）”作为业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。</p> <p><u>（六）风险收益特征</u></p> <p>本基金为完全复制指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> <p><u>（七）投资决策依据和决策程序</u></p> <p><u>1. 投资决策依据</u></p> <p>有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。</p> <p><u>2. 投资管理体制</u></p>	<p>本基金的业绩比较基准：<u>深证100指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%</u></p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。</p> <p><u>（五）风险收益特征</u></p> <p>本基金为ETF联接基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>
---	--

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3. 投资管理程序

(1) 研究：指数投资部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、成份股流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策：投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理根据指数成份股的权重构建投资组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

(4) 交易执行：交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 绩效评估：绩效评估与风险管理小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。

(6) 组合监控与调整：基金经理将根据标的指数的变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

<p><u>基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中予以公告。</u>（删除）</p> <p><u>（八）投资限制</u></p> <p>1. 组合限制</p> <p>基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p><u>（1）本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于深证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；</u></p> <p><u>（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%；</u></p> <p><u>（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%；</u></p> <p><u>（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></p> <p><u>（5）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>（删除）</p> <p><u>（6）</u>每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p><u>（7）</u>本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：</p> <p>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，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、<u>权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）</u>等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不</p>	<p><u>（六）投资限制</u></p> <p>1. 组合限制</p> <p>基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p><u>（1）本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%；</u></p> <p><u>（2）</u>每个交易日日终在扣除股指期货合约、<u>国债期货合约、股票期权合约</u>需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及<u>应收申购款</u>等；</p> <p><u>（3）</u>本基金参与股指期货交易的，应当符合下列投资限制：</p> <p>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，持有的买入股指期货合约、<u>国债期货合约</u>价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指<u>目标 ETF、股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）</u>等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期</p>
--	--

	<p>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<u>股票市值</u>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>.....</p> <p>（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；</p> <p><u>（13）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；（删除）</u></p> <p>.....</p> <p><u>（14）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</u></p>	<p>货合约价值不得超过基金持有的股票及目标 ETF 总市值的 20%；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%；本基金所持有的<u>股票和买入、卖出股指期货合约价值合计</u>（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><u>（4）本基金参与转融通证券出借业务的，还须符合以下限制：出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%；参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%；最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p>.....</p> <p>（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；</p> <p>.....</p> <p><u>（10）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。因期货市场波动、证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>（11）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；（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p><u>（12）基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</u></p>
--	---	---

	<p><u>(15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%，因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</u></p> <p><u>(16) 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；(删除)</u></p> <p><u>(17) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；</u></p>	<p><u>(13) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；</u></p> <p><u>(14) 本基金参与股票期权交易的，应当符合下列风险控制指标要求：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；</u></p> <p><u>(15) 本基金参与国债期货交易，应当符合下列投资限制：</u></p> <p><u>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%；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；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%；</u></p> <p><u>(16) 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</u></p>
--	--	---

<p><u>(18) 法律法规、基金合同规定的其他比例限制。</u></p> <p><u>如果法律法规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。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行相关程序后投资不再受相关限制。</u></p> <p>除上述第(6)、(12)、(15)和(16)条外，因<u>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</u>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。</p> <p>.....</p> <p>2. 禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>.....</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资；</p> <p><u>(4) 买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；(删除)</u></p> <p>.....</p> <p><u>(6) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行相关程序后投资不再受相关限制。</u></p> <p>.....</p> <p>如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用本基金，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定，不需另行召开基金份额持有人大会。</p>	<p>总量；<u>(新增，以下次序依次更新)</u></p> <p><u>(17) 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。</u></p> <p>除第(2)、(4)、(9)、(10)、(11)条规定的情形外，因期货市场波动、<u>证券市场波动、基金规模变动、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌</u>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。</p> <p><u>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(4)项规定的，基金管理人不得新增出借业务。基金参与出借业务不终止确认出借证券。基金持有证券的持有期计算不因出借而受影响，出借证券应纳入基金投资运作指标计算范围。</u></p> <p>.....</p> <p>2. 禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>.....</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资；</p> <p>.....</p> <p><u>(7) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行相关程序后投资不再受相关限制。</u></p> <p>.....</p> <p>如法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用本基金，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制，自动遵守届时有效的法律法规或监管规定，不需另行召开基金份额持有人大会。</p> <p><u>(七) 目标ETF发生相关变更情形时的处理</u></p> <p><u>目标ETF出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；</u></p>
--	--

	<p><u>(九) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法</u></p> <p>.....</p> <p>4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。</p>	<p><u>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，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。</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(2) 目标ETF终止上市；</u></p> <p><u>(3) 目标ETF基金合同终止；</u></p> <p><u>(4) 目标ETF的基金管理人发生变更(但变更后本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外)。</u></p> <p><u>若目标ETF变更标的指数，本基金将相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。若目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。</u></p> <p><u>(新增，以下次序依次更新)</u></p> <p><u>(八) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法</u></p> <p>.....</p> <p>4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。</p> <p><u>(九) 基金的融资业务</u></p> <p><u>本基金可以按照监管机构的有关规定参与融资等相关业务，参与范围和比例、信息披露、风险控制及估值核算等应符合监管机构的有关规定。</u></p> <p><u>(十) 侧袋机制的实施和投资运作安排</u></p> <p><u>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。</u></p>
--	--	---

		<p><u>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</u></p> <p><u>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。（新增）</u></p>
十三、基金的财产	<p>（一）基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。</p> <p>.....</p> <p>（四）基金财产的处分</p> <p>基金财产独立于基金管理人、基金托管人和<u>代销机构</u>的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。</p> <p>.....</p>	<p>（一）基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及<u>票据价值</u>、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。</p> <p>.....</p> <p>（四）基金财产的处分</p> <p>基金财产独立于基金管理人、基金托管人和<u>销售机构</u>的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。</p> <p>.....</p>
十四、基金资产估值	<p>（一）估值日</p> <p>本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。</p>	<p>（一）估值日</p> <p>本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。</p> <p><u>（二）估值原则</u></p> <p><u>基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。</u></p> <p><u>1. 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该</u></p>

	<p style="text-align: center;"><u>(二) 估值方法</u></p> <p>1. 证券交易所上市的<u>权益类</u>证券的估值</p> <p>交易所上市的<u>权益类</u>证券（包括股票、<u>权证</u>等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价</p>	<p><u>资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。</u></p> <p><u>与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</u></p> <p><u>2. 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。</u></p> <p><u>3. 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p style="text-align: center;"><u>(三) 估值方法</u></p> <p><u>1、目标 ETF 份额的估值</u></p> <p><u>本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日基金份额净值估值，若估值日为非交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p><u>2、证券交易所上市的有价证券（目标 ETF 除外）的估值</u></p> <p><u>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影</u></p>
--	--	--

	<p>(收盘价)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>2. 处于未上市期间或流通受限的<u>权益类</u>证券应区分如下情况处理:</p> <p>.....</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票和权证,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。</p> <p>(3) <u>流通受限股票</u>(包括首次公开发行有明确锁定期的股票、非公开发行有明确锁定期的股票、通过大宗交易取得的带限售期的股票等),按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。</p>	<p>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) <u>交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种</u>,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价;<u>交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种</u>,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定。</p> <p>(3) <u>交易所上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股的债券</u>,实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价;</p> <p>(4) <u>交易所上市不存在活跃市场的有价证券</u>,采用估值技术确定公允价值。(新增)</p> <p>3. 处于未上市期间或流通受限的<u>有价</u>证券应区分如下情况处理:</p> <p>.....</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值;</p> <p>(3) <u>在发行时明确一定期限限售期的股票</u>,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值;</p> <p>(4) <u>交易所未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种</u>,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术</p>
--	---	---

	<p><u>3. 交易所市场交易的固定收益品种的估值</u></p> <p><u>(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外), 选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</u></p> <p><u>(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券, 按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值; 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;</u></p> <p><u>(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券, 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。</u></p> <p><i>(删除)</i></p> <p><u>4. 银行间市场交易的固定收益品种, 选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市, 且第三方估值机构未提供估值价格的债券, 按成本估值。</u></p>	<p><u>确定其公允价值。(新增)</u></p> <p><u>4. 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种, 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价; 对全国银行间市场上含权的固定收益品种, 选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。</u></p> <p><u>对全国银行间市场未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种, 应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</u></p> <p><u>5. 对于含投资者回售权的固定收益品种, 行使回售权的, 在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。</u></p> <p><u>6. 对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息, 或者有其</u></p>
--	---	---

	<p><u>5. 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</u></p> <p><u>6. 因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</u></p> <p><u>7. 本基金投资股指期货合约，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。（删除）</u></p> <p><u>8. 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，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</u></p> <p><u>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。</u></p>	<p><u>它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p><u>7. 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</u></p> <p><u>8. 期货合约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。</u></p> <p><u>9. 本基金投资期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。</u></p> <p><u>10. 本基金参与转融通证券出借业务，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p><u>11. 当本基金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。</u></p> <p><u>12. 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。（新增，以下次序依次更新）</u></p> <p><u>13. 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。</u></p>
--	---	--

<p>10. <u>本基金投资存托凭证的估值核算,依照境内上市交易的股票执行。</u>(删除)</p> <p>.....</p> <p>根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人<u>对基金资产净值的计算结果</u>对外予以公布。</p> <p><u>(三) 估值对象</u></p> <p>基金所拥有的<u>股票、权证、股指期货、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。</u></p> <p><u>(四) 估值程序</u></p> <p>1. <u>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 0.0001 元,小数点后第五位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。国家另有规定的,从其规定。</u></p> <p>每个<u>工作日</u>计算基金资产净值及各类<u>基金份额的基金份额净值</u>,并按规定公告。</p> <p>2. 基金管理人应每个<u>工作日</u>对基金资产估值。基金管理人每个<u>工作日</u>对基金资产估值后,将各类<u>基金份额的基金份额净值结果</u>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。<u>月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</u></p> <p><u>(五) 估值错误的处理</u></p> <p>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 4 位以内(含第 4 位)发生<u>差错时</u>,视为基金份额净值错误。</p> <p>本基金合同的当事人应<u>按照以下</u>约定处理:</p>	<p>.....</p> <p>根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人<u>对基金净值信息的计算结果</u>对外予以公布。</p> <p><u>(四) 估值对象</u></p> <p>基金所拥有的<u>目标ETF份额、股票、股指期货合约、国债期货合约、期权合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</u></p> <p><u>(五) 估值程序</u></p> <p>1. <u>各类基金份额的基金份额净值是按照每个估值日各类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额总数计算,精确到 0.0001 元,小数点后第五位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。</u>国家另有规定的,从其规定。</p> <p>每个<u>估值日</u>计算基金资产净值及各类<u>基金份额净值</u>,并按规定披露。</p> <p>2. 基金管理人应每个<u>估值日</u>对基金资产估值。基金管理人每个<u>估值日</u>对基金资产估值后,将各类<u>基金份额净值结果</u>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>按照规定</u>对外公布。</p> <p><u>(六) 估值错误的处理</u></p> <p>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<u>任一类基金份额净值</u>小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生<u>估值错误时</u>,视为<u>该类</u>基金份额净值错误。</p> <p>本基金合同的当事人应<u>按照以下</u></p>
--	---

	<p>1. <u>差错类型</u></p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、<u>或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错</u>，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“<u>差错处理原则</u>”给予赔偿，承担赔偿责任。</p> <p>上述<u>差错</u>的主要类型包括但不限于：<u>资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。</u></p> <p><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差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。（删除）</u></p> <p>2. <u>差错处理原则</u></p> <p>（1）<u>差错</u>已发生，但尚未给当事人造成损失时，<u>差错</u>责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正<u>差错</u>发生的费用由<u>差错</u>责任方承担；由于<u>差错</u>责任方未及时更正已产生的<u>差错</u>，给当事人造成损失的，由<u>差错</u>责任方对直接损失承担赔偿责任；若<u>差错</u>责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则<u>差错</u>责任方应当承担相应赔偿责任。<u>差错</u>责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保<u>差错</u>已得到更正。</p> <p>（2）<u>差错</u>的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对<u>差错</u>的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因<u>差错</u>而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但<u>差错</u>责任方仍应对<u>差错</u>负责。如果由于</p>	<p>约定处理：</p> <p>1. <u>估值错误类型</u></p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、<u>或登记结算机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误</u>，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该<u>估值错误</u>遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“<u>估值错误处理原则</u>”给予赔偿，承担赔偿责任。</p> <p>上述<u>估值错误</u>的主要类型包括但不限于：<u>资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。</u></p> <p>2. <u>估值错误处理原则</u></p> <p>（1）<u>估值错误</u>已发生，但尚未给当事人造成损失时，<u>估值错误</u>责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正<u>估值错误</u>发生的费用由<u>估值错误</u>责任方承担；由于<u>估值错误</u>责任方未及时更正已产生的<u>估值错误</u>，给当事人造成损失的，由<u>估值错误</u>责任方对直接损失承担赔偿责任；若<u>估值错误</u>责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。<u>估值错误</u>责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保<u>估值错误</u>已得到更正。</p> <p>（2）<u>估值错误</u>的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对<u>估值错误</u>的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因<u>估值错误</u>而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但<u>估值错误</u>责任方仍应对<u>估值错误</u></p>
--	--	--

<p>获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则<u>差错责任方</u>应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给<u>差错责任方</u>。</p> <p>（4）<u>差错调整</u>采用尽量恢复至假设未发生<u>差错</u>的正确情形的方式。</p> <p>（5）<u>差错责任方拒绝进行赔偿时</u>，如果因<u>基金管理人过错造成基金财产损失时</u>，<u>基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿</u>，如果因<u>基金托管人过错造成基金财产损失时</u>，<u>基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿</u>。<u>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</u>，由<u>基金管理人负责向差错方追偿</u>；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。</p> <p>（6）<u>如果出现差错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过错的当事人进行追索，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。</u></p> <p>（7）<u>按法律法规规定的其他原则处理差错。</u>（删除）</p> <p>3. <u>差错处理程序</u></p> <p><u>差错</u>被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>（1）查明<u>差错</u>发生的原因，列明所有的当事人，并根据<u>差错</u>发生的原因确定<u>差错</u>的责任方；</p> <p>（2）根据<u>差错</u>处理原则或当事人协商的方法对因<u>差错</u>造成的损失进行</p>	<p>负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则<u>估值错误责任方</u>应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给<u>估值错误责任方</u>。</p> <p>（4）<u>估值错误调整</u>采用尽量恢复至假设未发生<u>估值错误</u>的正确情形的方式。</p> <p>3. <u>估值错误处理程序</u></p> <p><u>估值错误</u>被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>（1）查明<u>估值错误</u>发生的原因，列明所有的当事人，并根据<u>估值错误</u>发生的原因确定<u>估值错误</u>的责任方；</p> <p>（2）根据<u>估值错误</u>处理原则或当事人协商的方法对因<u>估值错误</u>造成的</p>
--	--

<p>评估；</p> <p>(3) 根据<u>差错</u>处理原则或当事人协商的方法由<u>差错</u>的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4) 根据<u>差错</u>处理的方法，需要修改基金<u>注册登记机构</u>交易数据的，由基金<u>注册登记机构</u>进行更正，并就<u>差错</u>的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4. 基金份额净值<u>差错</u>处理的<u>原则</u>和<u>方法</u>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。</p> <p><u>(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。</u></p> <p><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> <p><u>(删除)</u></p> <p>.....</p> <p><u>(六) 暂停估值的情形</u></p> <p>1. 基金投资所涉及的<u>证券</u>交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2. 因不可抗力<u>或其它</u>情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3. <u>占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；</u></p> <p>4. 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<u>一致的</u>，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>.....</p>	<p>损失进行评估；</p> <p>(3) 根据<u>估值错误</u>处理原则或当事人协商的方法由<u>估值错误</u>的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4) 根据<u>估值错误</u>处理的方法，需要修改基金<u>登记结算机构</u>交易数据的，由基金<u>登记结算机构</u>进行更正，并就<u>估值错误</u>的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4. 基金份额净值<u>估值错误</u>处理的方法如下：</p> <p>(2) <u>任一</u>类基金份额净值计算错误偏差达到<u>该类</u>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<u>该类</u>基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，<u>并报中国证监会备案。</u></p> <p>.....</p> <p><u>(七) 暂停估值的情形</u></p> <p>1. 基金投资所涉及的交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2. 因不可抗力情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3. <u>基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</u></p> <p>4. 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商<u>确认后</u>，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>.....</p>
---	--

	<p><u>(七) 基金净值的确认</u></p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的<u>基金份额净值</u>由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。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<u>对基金净值予以公布</u>。</p> <p><u>(八) 特殊情况的处理</u></p> <p>1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的<u>第 9 项</u>进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2. 由于不可抗力原因，或由于<u>证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等</u>，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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人<u>和基金托管人免除赔偿责任</u>。但基金管理人<u>和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响</u>。</p>	<p><u>(八) 基金净值的确认</u></p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和各类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>各类基金份额净值</u>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<u>对基金净值信息予以公布</u>。</p> <p><u>(九) 实施侧袋机制期间的基金资产估值</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。</u>（<u>新增，以下次序依次更新</u>）</p> <p><u>(十) 特殊情况的处理</u></p> <p>1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的<u>第 13 项</u>进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2. 由于不可抗力原因，或由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人<u>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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人<u>和基金托管人免除赔偿责任</u>。但基金管理人<u>和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响</u>。</u></p>
<p>十五、基金费用与税收</p>	<p><u>(一) 基金费用的种类</u></p> <p>.....</p> <p>3. C 类基金份额的销售服务费；</p> <p>.....</p> <p>6. 基金份额持有人大会费用；</p> <p>7. <u>基金上市初费和上市月费</u>；</p> <p>8. <u>基金的指数使用许可费</u>；<u>（删除）</u></p> <p>9. <u>基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费</u>；</p> <p>10. <u>基金的证券交易费用</u>；</p> <p>.....</p> <p>12. <u>依法可以在基金财产中列支的</u></p>	<p><u>(一) 基金费用的种类</u></p> <p>.....</p> <p>3. <u>从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费</u>；</p> <p>.....</p> <p>6. 基金份额持有人大会费用；</p> <p>7. <u>基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费</u>；</p> <p>8. <u>基金的证券、期货交易费用</u>；</p> <p>.....</p> <p>10. <u>按照国家有关规定和《基金合</u></p>

	<p>其他费用。</p> <p>.....</p> <p>(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1. 基金管理人的管理费</p> <p><u>在通常情况下</u>，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日基金资产净值</p> <p>.....</p> <p>2. 基金托管人的托管费</p> <p><u>在通常情况下</u>，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值</p> <p>.....</p> <p>3. C 类基金份额的销售服务费</p> <p>.....</p> <p>销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后在次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给登记机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p>	<p><u>同》约定</u>，可以在基金财产中列支的其他费用。</p> <p><u>本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。</u></p> <p>.....</p> <p>(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1. 基金管理人的管理费</p> <p><u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</u></p> $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ <p>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—<u>前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0</u></p> <p>.....</p> <p>2. 基金托管人的托管费</p> <p><u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</u></p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>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—<u>前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0</u></p> <p>.....</p> <p>3. <u>从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费</u></p> <p>.....</p> <p>销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后在次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给登记机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p><u>销售服务费主要用于支付销售机</u></p>
--	---	---

	<p>4. <u>基金的指数使用许可费</u> <u>基金的指数使用许可费自合同生效之日算起，收取标准和方法为：</u> $H=E \times 0.02\% / \text{当年天数}$ <u>H=每日应付的指数使用许可费</u> <u>E=前一日基金资产净值</u> <u>基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度5万元，即不足5万元时按照5万元收取。</u> <u>指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。</u>（删除）</p> <p>5. <u>除管理费、托管费、销售服务费和基金的指数使用许可费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</u></p> <p>（四）<u>不列入基金费用的项目</u></p> <p>4. <u>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。</u></p> <p>（五）<u>基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</u></p> <p>.....</p>	<p><u>构佣金，及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。</u>（新增）</p> <p>4. <u>除管理费、托管费和销售服务费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</u></p> <p>（四）<u>不列入基金费用的项目</u></p> <p>4. <u>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。</u></p> <p>（五）<u>实施侧袋机制期间的基金费用</u> <u>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但基金管理人不得就侧袋账户资产收取管理费，详见招募说明书的规定。</u></p> <p>.....</p>
<p>十六、基金的收益与分配</p>	<p>.....</p> <p>（三）<u>收益分配原则</u></p> <p>1. <u>在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分</u></p>	<p>.....</p> <p>（三）<u>收益分配原则</u></p> <p>1. <u>本基金每月进行分红评估，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每季度最少分配1次、最多分配3次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；</u></p>

	<p>配；</p> <p>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；</p> <p>3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>.....</p> <p>（四）收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</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，依照《信息披露办法》的有关规定在<u>指定媒介</u>公告。</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>（删除）</p> <p>.....</p> <p>（六）基金收益分配中发生的费用</p> <p>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基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>	<p>2. 本基金场外份额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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红；<u>本基金场内份额收益分配方式为现金分红，场内份额具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；</u></p> <p>3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的<u>各类</u>基金份额净值减去每单位<u>该类</u>基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>.....</p> <p>（四）收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截止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、分配方式等内容。</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，依照《信息披露办法》的有关规定在<u>规定媒介</u>公告。</p> <p>.....</p> <p>（六）基金收益分配中发生的费用</p> <p>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基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p> <p><u>（七）实施侧袋机制期间的收益分配</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规</u></p>
--	---	--

<p>十八、基金的信息披露</p>	<p>一、基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。<u>基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。</u></p> <p>二、信息披露义务人</p> <p>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<u>指定</u>的全国性报刊（以下简称“<u>指定报刊</u>”）及<u>指定</u>互联网网站（以下简称“<u>指定网站</u>”）等媒介披露，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。</p> <p>三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：</p> <p>4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者<u>基金份额发售机构</u>；</p> <p>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不同文本的内容一致。不同文本<u>之间</u>发生歧义的，以中文文本为准。</p> <p>五、公开披露的基金信息包括：</p> <p>（三）基金合同生效公告 基金管理人将在基金合同生效的次日在<u>指定媒介</u>上登载基金合同生效公告。</p> <p>（四）<u>基金份额上市交易公告书</u> <u>基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上</u></p>	<p><u>定。</u>（新增）</p> <p>一、基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。<u>相关法律对信息披露的方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。</u></p> <p>二、信息披露义务人</p> <p>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符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称<u>规定报刊</u>）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称<u>规定网站</u>）等媒介披露，并保证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。</p> <p><u>规定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。规定网站应当无偿向投资者提供基金信息披露服务。</u>（新增）</p> <p>三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：</p> <p>4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者<u>基金销售机构</u>；</p> <p>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不同文本的内容一致。不同文本发生歧义的，以中文文本为准。</p> <p>五、公开披露的基金信息包括：</p> <p>（三）基金合同生效公告 基金管理人将在基金合同生效的次日在<u>规定媒介</u>上登载基金合同生效公告。</p>

<p>市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上，并将上市交易公告书提示性公告登载在指定报刊上。（删除）</p> <p><u>（五）基金净值信息</u></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在<u>指定网站</u>披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过其<u>指定网站</u>、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当不晚于半年度和年度最后一日的次日，在<u>指定网站</u>披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p><u>（六）基金份额申购、赎回价格公告</u></p> <p>基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人能够在销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p><u>（七）基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告</u></p> <p>.....</p> <p>如报告期内出现单一投资人持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资人的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资人的类别、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。基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p><u>（八）临时报告</u></p> <p>.....</p>	<p><u>（四）基金净值信息</u></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在<u>规定网站</u>上披露一次<u>各类</u>基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过<u>规定网站</u>、基金销售机构的网站或营业网点，披露开放日的<u>各类</u>基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当不晚于半年度和年度最后一日的次日，在<u>规定网站</u>披露半年度和年度最后一日的<u>各类</u>基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p><u>（五）基金份额申购、赎回价格</u></p> <p>基金管理人应当在本基金的基金合同、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，并保证投资人能够在<u>基金销售机构网站</u>或营业网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p><u>（六）基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告</u></p> <p>.....</p> <p>如报告期内出现单一投资人持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资人的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资人的类别、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。基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p><u>（七）临时报告</u></p> <p>.....</p>
---	---

	<p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；</p> <p>2、<u>基金终止上市交易、终止《基金合同》、基金清算</u>；</p> <p>.....</p> <p>17、<u>基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五</u>；</p> <p>.....</p> <p>22、<u>本基金发生巨额赎回并延期支付</u>；</p> <p>.....</p> <p>25、<u>本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时</u>；</p> <p>26、<u>基金份额上市交易</u>；</p> <p>.....</p> <p>27、<u>基金份额停牌、复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市交易</u>；（删除）</p> <p>28、<u>调整基金份额类别</u>；</p> <p>.....</p> <p>30、<u>当基金管理人采用摆动定价机制进行估值</u>；</p> <p>.....</p> <p><u>（九）澄清公告</u></p> <p>在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、<u>基金上市交易的证券交易所</u>。</p> <p>.....</p>	<p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；</p> <p>2、<u>终止《基金合同》、基金清算</u>；</p> <p>.....</p> <p>17、<u>任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五</u>；</p> <p>.....</p> <p>22、<u>本基金发生巨额赎回并延期办理</u>；</p> <p>.....</p> <p>25、<u>本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时</u>；</p> <p>26、<u>基金合同生效后，连续三十个工作日、四十个工作日、四十五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5,000万元人民币的情形</u>；</p> <p>.....</p> <p>27、<u>调整基金份额类别设置</u>；</p> <p>.....</p> <p>29、<u>当基金管理人采用摆动定价机制进行估值</u>；</p> <p>30、<u>本基金变更目标ETF</u>；</p> <p>31、<u>本基金变更标的指数或标的指数调整指数编制方法</u>；（新增，以下次序依次更新）</p> <p>.....</p> <p><u>（八）澄清公告</u></p> <p>在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>.....</p>
--	---	--

	<p><u>(十一) 清算报告</u> 基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在<u>指定网站上</u>,并将清算报告提示性公告登载在<u>指定报刊上</u>。</p> <p><u>(十二) 投资资产支持证券信息披露</u> 基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。</p> <p><u>(十三) 投资股指期货相关公告</u> 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>(删除)</p> <p><u>(十四) 中国证监会规定的其他信息</u></p> <p>六、信息披露事务管理</p>	<p><u>(十) 清算报告</u> 基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在<u>规定网站上</u>,并将清算报告提示性公告登载在<u>规定报刊上</u>。</p> <p><u>(十一) 实施侧袋机制期间的信息披露</u> 本基金实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露,详见招募说明书的规定。(新增,以下次序依次更新)</p> <p><u>(十二) 中国证监会规定的其他信息</u> 若本基金投资资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货、参与转融通证券出借、融资、融券业务,基金管理人将按相关法律法规要求进行披露。(新增)</p> <p>六、信息披露事务管理</p>
--	---	---

	<p>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、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。</p> <p>.....</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在<u>指定媒介</u>上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于<u>指定媒介和基金上市交易的证券交易所</u>网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p> <p>.....</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅 依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所和<u>基金上市交易的证券交易所</u>，供社会公众查阅、复制。</p>	<p>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、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。</p> <p>.....</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在<u>规定媒介</u>上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于<u>规定媒介网站</u>披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p> <p>.....</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅 依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。</p>
<p>十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>(一) 基金合同的变更</p> <p>1. 变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，<u>并报中国证监会备案。</u></p> <p>.....</p> <p>(二) 本基金合同的终止</p> <p>有下列情形之一的，<u>本基金合同经中国证监会核准后将终止：</u></p> <p>1. 基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>.....</p> <p>(三) 基金财产的清算</p>	<p>(一) 基金合同的变更</p> <p>1. 变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。</p> <p>.....</p> <p>(二) 本基金合同的终止</p> <p>有下列情形之一的，<u>经履行适当程序后，基金合同应当终止：</u></p> <p>1. 基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2. <u>基金合同生效后，连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的；</u>（新增，以下次序依次更新）</p> <p>.....</p> <p>(三) 基金财产的清算</p>

	<p>.....</p> <p>3. 基金财产清算的期限为6个月，<u>基金财产清算小组可根据流通受限证券的处理情况适当延长清算期限，并提前公告。</u></p> <p>.....</p> <p>8. 基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 <u>15年以上</u>。</p>	<p>.....</p> <p>3. 基金财产清算的期限为6个月，<u>但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。</u></p> <p>.....</p> <p>8. 基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，<u>保存期限不得低于法律法规规定的最低期限。</u></p>
<p>二十、违约责任</p>	<p>(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》规定或者本基金合同约定，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。但是发生下列情况的，当事人<u>可以</u>免责：</p> <p>.....</p> <p>(五) 由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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投资人损失，基金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由此造成的影响。</p>	<p>(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》规定或者本基金合同约定，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。但是发生下列情况的，当事人<u>免</u>责：</p> <p>.....</p> <p>(五) 由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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投资人损失，基金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<u>或减轻</u>由此造成的影响。</p>
<p>二十二、基金合同的效力</p>	<p>基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>(一) 本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章。2020年4月20日，经广发深证100指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。自2020年5月26日起，本基金基金合同生效，原《广发深证100指数分级证券投资基金基金合同》失效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>	<p>基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>(一) 本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章。2020年4月20日，经广发深证100指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。自2020年5月26日起，本基金基金合同生效，原《广发深证100指数分级证券投资基金基金合同》失效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>

	<p>.....</p> <p>(三) 本基金合同正本一式<u>八份</u>，除<u>中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外</u>，基金管理人<u>和基金托管人各持有两份</u>。每份均具有同等的法律效力。</p> <p>(四) 本基金合同可印制册，供投资人在基金管理人、基金托管人、<u>代</u><u>销机构</u>和<u>注册</u><u>登记机构</u>办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。</p>	<p><u>XX年XX月XX日</u>，经<u>广发深证100指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议通过</u>，并<u>报中国证监会备案</u>。自<u>XX年XX月XX日</u>起，<u>本基金基金合同生效</u>，原<u>《广发深证100指数证券投资基金（LOF）基金合同》</u>同日起失效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报<u>中国证监会备案并公告之日</u>止。<i>（新增）</i></p> <p>.....</p> <p>(三) 本基金合同正本一式<u>三份</u>，除<u>上报有关监管机构一式一份外</u>，基金管理人<u>和基金托管人各持有一份</u>。每份均具有同等的法律效力。</p> <p>(四) 本基金合同可印制册，供投资人在基金管理人、基金托管人、<u>销</u><u>售机构</u>和<u>注册</u><u>登记机构</u>办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。</p>
<p>第二十四部分 基金合同内容摘要</p>	<p>略</p>	<p>略</p>