

# 永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金转型为永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告

永赢基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金于 2019 年 4 月 28 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可〔2019〕853 号）。《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2019 年 7 月 9 日正式生效。《基金合同》约定：“若本基金管理人同时管理跟踪同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改基金合同，届时无需召开基金份额持有人大会。”同时，《基金合同》约定：“2、在法律法规和基金合同规定的范围内且对现有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：……（3）若本基金管理人同时管理跟踪同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改基金合同；（4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；……”

本公司旗下永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金已于 2024 年 11 月 8 日正式成立。为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人利益，本公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定于 2024 年 11 月 11 日起，将永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金变更为永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（A 类份额基金代码：007538，C 类份额基金代码：007539），引入侧袋机制，并根据法律法规更新、基金管理人信息更新以及本基金实际运作情况对《基金合同》作出修改。根据法律法规及《基金合同》的有关规定，已对《基金合同》、《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金托管协议》、《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金招募说明书》及基金产品资料概要等法律文件进行相应的修订和补充。《基金合同》的修订内容详见附件《〈永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同〉修订前后对照表》。

届时，永赢沪深300指数型发起式证券投资基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“永赢沪深300指数型发起式证券投资基金A类基金份额”变更为“永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金A类基金份额”，将“永赢沪深300指数型发起式证券投资基金C类基金份额”变更为“永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金C类基金份额”。前述变更不影响各类基金份额净值的计算。

基金转型后，各类基金份额的申购费率、赎回费率、销售服务费率及费率优惠活动保持不变。

重要提示：

1、修改后的《永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》、《永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》自2024年11月11日起生效，原《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》、《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议》、《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书》于当日失效。

2、投资者可登陆本公司网站（[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)）查阅修改后的法律文件，或拨打客户服务电话（400-805-8888）获取相关信息。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资者在投资基金前认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。敬请投资者在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

永赢基金管理有限公司

2024年11月9日

附件：《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》修订前后对照表

章节	《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》(修订前)	《永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》(修订后)
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
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《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》”)、<u>《证券投资基金销售管理办法》</u>(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>三、永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、<u>基金合同</u>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。</p> <p>中国证监会对<b>本基金</b>募集申请的注册,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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或者保证。</p> <p>……</p> <p><del>本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜</del></p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国<b>民法典</b>》、《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》”)、<u>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</u>(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》”)、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》</u>(以下简称“《基金中基金指引》”)、《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>三、<u>永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</u>(以下简称“<b>本基金</b>”)由永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金转型而来。永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、<u>《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》</u>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。</p> <p>中国证监会对<b>永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金(转型更名前)</b>募集申请的注册,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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等做出实质性判断或</p>

	在风险，详见本基金招募说明书。	者保证。 …… 删除
	四、本基金在募集过程中(指本基金募集完成进行验资时)及成立运作后,单一投资者持有的基金份额占本基金总份额的比例不得达到或超过50%(运作过程中,因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外),基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额达到或超过基金总份额50%的,不受此限制。	删除
	五、本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险,详见本基金招募说明书。	四、本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险,详见本基金招募说明书。
	无	五、本基金主要投资于目标ETF,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书。
	八、本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于2020年9月1日起执行。	八、 <u>当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行相应程序后,可以启动侧袋机制,具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。</u>
第二部分 释义	1. 基金或本基金:指 <b>永赢沪深300指数型发起式证券投资基金</b> 4. 基金合同或本基金合同:指《 <b>永赢沪深300指数型发起式证券投资基金</b> 基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5. 托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《 <b>永赢沪深300指数型发起式证券投资基金</b> 托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6. 招募说明书:指《 <b>永赢沪深300指数型发起式证券投资基金</b> 招募说明书》及其更新	1. 基金或本基金:指 <b>永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b> ,由 <b>永赢沪深300指数型发起式证券投资基金</b> 转型而来 4. 基金合同或本基金合同:指《 <b>永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b> 基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5. 托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《 <b>永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b> 托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

<p>7. 基金产品资料概要：指《<del>永赢沪深300指数型发起式证券投资基金</del>基金产品资料概要》及其更新（<del>本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行</del>）</p> <p>8. <del>基金份额发售公告：指《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》</del></p> <p>11. 《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《<del>证券投资基金销售管理办法</del>》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>12. 《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日实施的《<del>公开募集证券投资基金信息披露管理办法</del>》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>17. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<del>中国银行保险监督管理委员会</del></p> <p>21. 合格境外机构投资者：指符合《<del>合格境外机构投资者境内证券投资管理</del>办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以<del>投资手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</del></p> <p>22. <del>人民币合格境外机构投资者：指符合现行有效的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法人</del></p> <p>23. 投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外<del>机构投资者</del>、<del>人民币合格境外机构投资者</del>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>25. 基金销售业务：指<del>基金管理人或销售机构</del>宣传推介基金，<del>发售基金份额</del>，办理基金份额的<del>申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</del></p> <p>30. 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<del>认购</del>、<del>申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</del>而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>31. 基金合同生效日：指基金募集达到</p>	<p>6. 招募说明书：指《<u>永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</u>招募说明书》及其更新</p> <p>7. 基金产品资料概要：指《<u>永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</u>基金产品资料概要》及其更新</p> <p>10. 《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>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日实施，<u>并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》</u>及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>15. 《<u>基金中基金指引</u>》：指中国证监会2016年9月11日颁布并实施的《<u>公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引</u>》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>17. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<u>国家金融监督管理总局</u>等对<u>银行业金融机构进行监督和管理的机构</u></p> <p>21. 合格境外投资者：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>》（包括其不时修订）及相关法律法规规定使用<u>来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，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>22. 投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、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>24. 基金销售业务：指为<u>投资人开立基金交易账户</u>，宣传推介基金，办理基金份额<del>申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资</del><u>及提供基金交易账户信息查询等活动</u></p> <p>29. 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<del>申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</del>而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p>
---	---

<p>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金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> <p><del>33. 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</del></p> <p>34. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p> <p><del>41. 认购：指在基金募集期内，投资人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</del></p> <p>49. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>50. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、期货合约、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>54. 指定媒介：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</p> <p>57. A 类基金份额：指在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>58. C 类基金份额：指在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p><del>59. 对日：指某一特定日期在后续日历年度中的对应日期</del></p> <p>63. 发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金</p> <p>64. 发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p>	<p>30. 基金合同生效日：指永赢沪深 300 指数型发起式证券投资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金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> <p>32. 存续期：指《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》生效至《永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》终止之间的不定期期限</p> <p>46. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、<u>投资目标 ETF 份额所得收益</u>、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>47. 基金资产总值：指基金拥有的<u>目标 ETF 基金份额</u>、各类有价证券、期货合约、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>51. 规定媒介：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</p> <p>53. 目标 ETF：指另一经中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“ETF”），该 ETF 和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该 ETF 的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标。本基金的目标 ETF 为永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金</p> <p>54. ETF 联接基金：指将绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标 ETF，与目标 ETF 的投资目标类似，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”</p> <p>56. A 类基金份额：指在投资人申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>57. C 类基金份额：指在投资人申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收</p>
---	---

		<p>取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p><b>61. 发起资金：</b>指用于认购<b>永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金</b>且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金</p> <p><b>62. 发起资金提供方：</b>指以发起资金认购<b>永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金</b>且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p> <p><b>63. 侧袋机制：</b>指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至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><b>64. 特定资产：</b>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>
第三部分 基金的基本情况	一、基金名称	一、基金名称
	永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
	二、基金的类别	二、基金的类别
	股票型证券投资基金	指数基金、ETF 联接基金
	三、基金发起资金来源	删除
本基金发起资金来源于基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员的资金。发起资金提供方认购本基金的总金额不低于 1000 万元。本基金发起资金提供方认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于 3 年。		
无	五、目标 ETF	
	永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	
六、基金的投资目标	六、基金的投资目标	
紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟	

	跟踪误差的最小化， <del>实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。</del>	跟踪的指数 <b>表现</b> ，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
	<b>七、基金的最低募集份额总额</b> <del>本基金为发起式基金，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元人民币，且持有期限自基金合同生效日起不少于3年，法律法规和监管机构另有规定的除外。</del>	删除
	<b>八、基金份额面值和认购费用</b> <del>本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金认购费率按招募说明书的规定执行。</del>	删除
	<b>九、基金存续期限</b> 不定期 <del>基金合同生效之日起三年后的对日（自然日），若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</del>	<b>七、基金存续期限</b> 不定期
	<b>十、基金份额的类别</b> 本基金根据 <del>认购费</del> 、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者 <del>认购</del> 申购时收取 <del>认购</del> 申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为A类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取 <del>认购</del> 申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，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。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和基金份额累计净值。基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日 <del>发售在外的</del> 该类别基金份额总数。 投资者可自行选择 <del>认购</del> 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。 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	<b>八、基金份额的类别</b> 本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为A类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，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。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和基金份额累计净值。基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。 投资者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。 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，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持



<p>书中公告。根据基金销售情况，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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、对基金份额分类办法及规则进行调整、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、调低销售服务费率或变更收费方式、或者停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告<b>并报中国证监会备案</b>，不需召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p>有人利益无实质性不利影响的情况下，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、对基金份额分类办法及规则进行调整、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、调低销售服务费率或变更收费方式、或者停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告，不需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p><b>十一、条件许可情况下的基金模式转换</b> 若本基金管理人同时管理跟踪同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可使本基金采取ETF联接基金模式并相应修改基金合同，届时无需召开基金份额持有人大会。</p>	<p>删除</p>
<p>无</p>	<p><b>九、本基金与目标ETF的联系与区别</b> <u>本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别。</u></p> <p><b>1、本基金与目标ETF之间的联系：</b></p> <p><u>（1）两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数表现；</u></p> <p><u>（2）两只基金具有相似的风险收益特征；</u></p> <p><u>（3）目标ETF是本基金的主要投资对象。</u></p> <p><b>2、本基金与目标ETF之间的区别：</b></p> <p><u>（1）在基金的投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股、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，实现对标的指数表现的紧密跟踪。</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买卖目标ETF的基金份额，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，投资者可以通过基金管理人及非直销销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。</u></p> <p><u>（3）价格揭示机制不同。目标ETF有实</u></p>

		<p>时市场交易价格和每日基金净值；本基金只揭示每日基金净值。</p> <p><u>(4) 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或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF；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。</u></p> <p><u>3、本基金与目标 ETF 业绩表现仍可能出现差异。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，用于跟踪标的指数的表现；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需缴纳的交易保证金后，仍需将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。</u></p> <p><u>(2) 申购赎回的影响。目标 ETF 采取实物申赎的方式或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF，采取实物申赎的方式对基金净值影响较小；而本基金采用现金申赎的方式，大额申赎可能会对基金资产净值产生一定冲击。</u></p>
<p>第四部分 基金的历史沿革与存续</p>	<p>第四部分 基金份额的发售</p> <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</p> <p>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</p> <p>通过各销售机构公开发售，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</p> <p>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、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者、发起资金提供方以及法律法规或</p>	<p>一、基金的历史沿革</p> <p>永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金转型而来。永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金经中国证监会《关于准予永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2019〕853 号）准予募集注册，基金管理人为永赢基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金自 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 7 月 5 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 9 日生效。</p>

<p>中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p><b>二、基金份额的认购</b></p> <p><b>1、认购费用</b></p> <p>本基金 A 类基金份额收取基金认购费用，C 类基金份额不收取认购费用。本基金 A 类基金份额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。</p> <p><b>2、募集期利息的处理方式</b></p> <p>有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。</p> <p><b>3、基金认购份额的计算</b></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><b>4、认购份额余额的处理方式</b></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><b>5、认购申请的确认</b></p> <p>基金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。认购申请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，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。</p> <p><b>三、基金份额认购金额及比例的限制</b></p> <p><b>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</b></p> <p><b>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，具体限制请参见招募说明书或相关公告。</b></p> <p><b>3、基金管理人可以对募集期间（指本基金募集完成进行验资时）的单个投资人的累计认购金额及所持基金份额比例进行限制，具体限制和处理方法请参见招募说明书或相关公告。</b></p> <p><b>4、基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购费用按每笔认购申</b></p>	<p>2024 年 11 月 8 日，基金管理人管理的永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金正式成立。基金管理人根据《永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定，决定将永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金转换为永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，即本基金。</p> <p>转型相关事宜详见《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 指数型发起式证券投资基金转型为永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》。</p>
--	--

<p>请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。</p> <p><b>四、发起资金认购</b></p> <p>发起资金提供方运用发起资金认购本基金的金额不少于1000万元人民币，且认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年。</p> <p>发起资金提供方认购本基金的情况见基金管理人届时发布的公告。</p>	
<p><b>第五部分 基金备案</b></p> <p><b>一、基金备案的条件</b></p> <p>本基金自基金份额发售之日起3个月内，发起资金认购本基金的金额不少于1000万元人民币，且发起资金的提供方承诺其认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年的条件下，基金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><b>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</b></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"> <li>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</li> <li>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；</li> <li>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。</li> </ol>	<p><b>二、基金的存续</b></p> <p>本基金在基金合同生效后，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>法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>

	<p><b>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</b></p> <p>基金合同生效之日起三年后的对日（自然日），若基金资产净值低于2亿元，无需召开基金份额持有人大会审议，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。</p> <p>本基金在基金合同生效三年后，继续存续的，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>法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p>	
<p><b>第五部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	<p><b>五、申购和赎回的数量限制</b></p> <p>6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等的数量限制。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。</p>	<p><b>五、申购和赎回的数量限制</b></p> <p>6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等的数量限制。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<u>规定</u>媒介上公告。</p>
	<p><b>七、拒绝或暂停申购的情形</b></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><del>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者的持有基金份额占本基金总份额的比例达到或者超过50%，或者通过一致行动人等方式变相使单一投资者持有本基金份额占本基金总份额的比例达到或超过50%的情形时。</del></p> <p>……</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、8、9、<del>11</del>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在<u>指定</u>媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第<del>7</del>项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管</p>	<p><b>七、拒绝或暂停申购的情形</b></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><b>9、目标ETF暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</b></p> <p><b>10、目标ETF暂停申购、暂停上市或目标ETF停牌、达到或接近申购上限，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的。</b></p> <p>……</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、<u>7</u>、8、9、<b>10</b>、<b>12</b>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在<u>规定</u>媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第<b>11</b>项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，</p>

<p>理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项本金将退还给投资人。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>被拒绝部分的申购款项本金将退还给投资人。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>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>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人<b>应在当日</b>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。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。</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><b><u>7、目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u></b></p> <p><b><u>8、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或目标 ETF 停牌、延缓支付赎回对价，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。</u></b></p> <p>……</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人<b>按照规定</b>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。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。</p>
<p>十四、基金的转托管</p> <p>基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。</p>	<p>十四、基金的转托管</p> <p>基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。<b><u>尽管有前述约定，基金销售机构仍有权决定是否办理基金份额的转托管业务。</u></b></p>
<p>无</p>	<p><b><u>十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</u></b></p> <p><b><u>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</u></b></p>
<p>无</p>	<p><b><u>十八、其他业务</u></b></p> <p><b><u>如相关法律法规允许，在履行相关程序后，基金管理人办理其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。</u></b></p>
<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p>

<p>办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪中心大厦 <del>27 楼</del></p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(12) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金<b>认购、</b>申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等的业务规则；</p> <p>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：</p> <p>(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<b>发售、</b>申购、赎回和登记事宜；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额<b>认购、</b>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，按有关规定计算并公告各类基金份额的基金净值信息，确定各类基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 <b>15 年以上；</b></p> <p><del>(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；</del></p>	<p>办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 <b>21、22、23、27 层</b></p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(12) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于<b>目标 ETF 及其他</b>证券所产生的权利，<b>包括但不限于参加本基金持有基金份额持有人大会并行使相关投票权利；</b></p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金<b>申购、</b>赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等的业务规则；</p> <p>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：</p> <p>(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<b>申购、</b>赎回和登记事宜；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额<b>申购、</b>赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告各类基金份额的基金净值信息，确定各类基金份额<b>申购、</b>赎回的价格；</p> <p>(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，<b>保存时间不低于法律法规规定的最低期限；</b></p>
<p>二、基金托管人</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 <b>15 年以上；</b></p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，<b>保存期限不低于法律法规规定的最低期限；</b></p>
<p>三、基金份额持有人</p> <p>.....</p> <p>同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>.....</p> <p><b>除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，</b>同一类别每份基金份额具有同等的</p>

	<p>份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。</p> <p>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：</p> <p>无</p> <p>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：</p> <p>（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；</p> <p>（4）<del>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；</del></p>	<p>合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。</p> <p>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：</p> <p><b><u>（6）按照本基金合同的约定出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会，对目标 ETF 的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</u></b></p> <p>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：</p> <p>（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书、<b><u>基金产品资料概要</u></b>等信息披露文件；</p> <p>（4）<del>交</del>纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；</p>
<p><b>第七部分 基金份额持有人大会</b></p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>……</p> <p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外：</p> <p>（8）变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>2、在法律法规和基金合同规定的范围内且对现有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><del>（3）若本基金管理人同时管理跟踪同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式进行运作并相应修改基金合同；</del></p> <p>（6）基金管理人、基金登记机构、基金销售机构，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整有</p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。<b><u>除法律法规另有规定或基金合同另有约定外</u></b>，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p><b><u>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会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 基金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。本基金份额折算为目标 ETF 后的每一参会份额和目标 ETF 的每一参会份额拥有平等的投票权。</u></b></p> <p><b><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</u></b></p>



<p>关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；</p>	<p><u>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。</u></p> <p>.....</p> <p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外：</p> <p><u>（8）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外），但由于目标 ETF 交易方式变更、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；</u></p> <p><u>（9）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；</u></p> <p>2、在法律法规和基金合同规定的范围内且对现有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><u>（5）基金管理人、基金登记机构、基金销售机构，在法律法规规定或中国证监会许可的范围内并且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；</u></p> <p><u>（7）由于目标 ETF 变更标的指数、变更交易方式、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略；</u></p>
<p>无</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><u>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧</u></p>

	<p>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，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、当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>侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。</p> <p>侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人</p>
--	---

		大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关约定。
第十一部分 基金的投资	一、投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化， <del>实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。</del>	一、投资目标 <u>本基金主要通过投资于目标 ETF</u> ，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
	二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具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）。 ..... 基金的投资组合比例为：本基金投资于 <del>沪深 300 指数成份股和备选成份股</del> 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；本基金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，应当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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。 .....	二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以 <u>目标 ETF 基金份额</u> 、沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具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）。 ..... 基金的投资组合比例为：本基金投资于 <u>目标 ETF</u> 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；本基金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，应当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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。 .....
	三、投资策略 正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内。 <b>1、股票投资策略</b> <del>通常情形下，本基金主要采取完全复制法进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重分配投资于每只股票的具体金额，进而形成股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票发生增发或配股、成份股停牌或因法律法规原因被限制投资、市场流动性不足</del>	三、投资策略 <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。</u> 正常情况下，本基金主要采用完全复制法进行投资，力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内。 <b>1、目标 ETF 投资策略</b> <u>本基金通过以下两种方式投资目标 ETF：</u> <u>（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或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF。</u> <u>（2）二级市场方式：目标 ETF 上市交易</u>

<p>等情况，对股票投资组合进行实时调整，力争基金净值增长率与标的指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p><del>（1）定期调整：根据标的指数的调整规则和各选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</del></p> <p><del>（2）不定期调整</del></p> <p>①当标的指数成份股发生增发、配股等股权变动而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；</p> <p>②根据基金申购赎回情况，调整股票投资组合，以有效跟踪标的指数；</p> <p>③根据法律法规规定，成份股在标的指数中的权重因其他原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当的调整，力争降低跟踪误差。</p> <p>.....</p>	<p>后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。</p> <p><u>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，无需召开基金份额持有人大会。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>2、股票投资策略</p> <p><u>本基金对成份股、备选成份股（均含存托凭证）的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此可对投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采用完全复制策略。但在因特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。</u></p> <p>.....</p>
<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金投资于<b>沪深 300 指数成份股和备选成份股</b>的资产比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>（14）<b>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%；</b>—本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>（15）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列投资比例限制：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）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金投资于<b>目标 ETF</b>的资产比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>（14）本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>（15）本基金参与股指期货交易，应当遵守下列投资比例限制：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<b>目标 ETF</b>、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；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%；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）<b>应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约</b></p>

<p>易日基金资产净值的 20%；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）<b>占基金资产的比例不高于 90%；</b></p> <p>除第（2）、（12）、（17）、（18）项以外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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<b>基金合同生效</b>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>……</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>（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>……</p>	<p><b>定；</b></p> <p>除第（1）、（2）、（12）、（17）、（18）项以外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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、<b>目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌或交收延迟</b>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。<b>因证券及期货市场波动、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 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（1）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。</b></p> <p>基金管理人应当自<b>转换为联接基金</b>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>……</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>（4）买卖<b>除目标 ETF 外的</b>其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>……</p>
<p>六、风险收益特征</p> <p><del>本基金是股票型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型证券投资基金、货币市场基金和混合型证券投资基金。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。</del></p>	<p>六、风险收益特征</p> <p><b>本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期收益水平理论上高于债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF，实现对标的指数表现的紧密跟踪，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。</b></p>
<p>无</p>	<p>七、目标 ETF 发生相关变更情形的处理方式</p> <p><b>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</b></p>

	<p>接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有跟踪该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，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中删除关于目标 ETF 的表述部分，或变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <p>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；</p> <p>2、目标 ETF 终止上市；</p> <p>3、目标 ETF 基金合同终止；</p> <p>4、目标 ETF 与其他基金进行合并；</p> <p>5、目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）；</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p> <p>若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。但目标 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，本基金在履行适当程序后，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。</p>
无	<p>九、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>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，无需召开基金份额持有人大会审议。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

		见招募说明书的规定。
第十二部分 基金的财产	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、期货合约、票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的 <u>目标 ETF 基金份额</u> 、各类有价证券、期货合约、票据价值、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。
第十三部分 基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、股指期货合约、其它投资等资产及负债。	二、估值对象 基金所拥有的 <u>目标 ETF 基金份额</u> 、股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、股指期货合约、其它投资等资产及负债。
	三、估值方法 <b>1、证券交易所上市的权益类证券的估值</b> 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。 <b>2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理</b> …… <b>3、交易所市场交易的固定收益品种的估值</b> <b>（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；</b> <b>（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；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；</b> <b>（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支</b>	三、估值方法 <b>1、目标 ETF 基金份额的估值</b> <u>本基金持有的目标 ETF 基金份额按估值日目标 ETF 的基金份额净值估值。如该日目标 ETF 未公布净值，则按该日目标 ETF 最近公布的净值估值。</u> <b>2、上市有价证券的估值</b> <b>（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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且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；</b> <b>（2）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值；</b> <b>（3）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务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进行估值。</b> <u>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，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日</u>

<p>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前提下，按成本估值；</p> <p><del>(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定其公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的前提下，按成本估值。</del></p> <p><del>4、对全国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估值。银行间市场发行未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。</del></p> <p>6、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。</p> <p>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。<del>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。</del></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<b>对基金资产净值</b>的计算结果对外予以公布。</p>	<p>(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；</p> <p><u>(4) 对于在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权的债券，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。</u></p> <p>3、处于未上市期间的<b>有价</b>证券应区分如下情况处理</p> <p>.....</p> <p><u>(3) 对于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>5、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。<u>如法律法规今后另有规定的，从其规定。</u></p> <p>7、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。</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<b>对基金净值信息</b>的计算结果对外予以公布。</p>
<p>五、估值错误的处理</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。当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</p>	<p>五、估值错误的处理</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。当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为<b>该类</b>基金份额净值错误。</p>
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>无</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p><u>4、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>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按基金合同</p>	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按基金合同约</p>



	<p>约定估值方法的第 <del>9</del> 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。</p> <p>无</p>	<p>定估值方法的第 <u>8</u> 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。</p> <p><b>九、实施侧袋机制期间的基金资产估值</b> <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份额净值和基金份额累计净值，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。</u></p>
第十四部分 基金费用与税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p><del>4、基金标的指数许可使用费；</del></p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p><b>10、基金投资目标 ETF 的相关费用（包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申赎费用等）；</b></p>
	<p>二、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>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> <p>.....</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>.....</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的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> <p>.....</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>.....</p> <p><b>4、基金的指数许可使用费</b> <b>本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议的约定计提标的指数使用相关费用，基金合同生效后的指数使用相关费用从基金财产中列支。标的指数使用相关费用的费率、具体计算方法及支付方式见招募说明书。如果指数使用许可协议约定的标的指数使用相关费用的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数使用相关费用，此项调整无需召开基金份额持有人大会。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的方法。</b></p>	<p>二、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><b>本基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。</b>本基金的管理费按前一日基金资产净值 <u>扣除基金财产中所持有目标 ETF 基金份额部分的资产净值后余额（若为负数，则取 0）</u> 的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> <p>.....</p> <p>E 为前一日的基金资产净值 <u>扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的资产净值后余额，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><b>本基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。</b>本基金的托管费按前一日基金资产净值 <u>扣除基金财产中所持有目标 ETF 基金份额部分的资产净值后余额（若为负数，则取 0）</u> 的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> <p>.....</p> <p>E 为前一日的基金资产净值 <u>扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的资产净值余额，若为负数，则 E 取 0。</u></p> <p>.....</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第 <del>4</del>-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。</p>

	上述“一、基金费用的种类”中第5—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。	
	三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、基金合同生效前的相关费用；	三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、基金合同生效前的相关费用 <u>根据《永赢沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行；</u> <u>4、基金的标的指数许可使用费，本基金的标的指数许可使用费由基金管理人承担；</u>
	无	<u>五、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，但不得收取管理费，其他费用详见招募说明书的规定或相关公告。</u>
第十五部分 基金的收益与分配	无	<u>七、实施侧袋机制期间的收益分配</u> <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定。</u>
第十六部分 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； <del>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；</del>	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；
	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的 <u>具有证券、期货相关业务资格</u> 的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的、 <u>符合《中华人民共和国证券法》规定</u> 的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
第十七部分 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 <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，	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 <u>符合</u> 中国证监会 <u>规定条件</u> 的全国性报刊（以下简称“ <u>规定报刊</u> ”）及 <u>《信息披露办法》规定</u> 的互联网网站（以下简称“ <u>规定</u> ”

<p>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>网站”)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>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括:</p> <p>(一)基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金<b>认购</b>、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。基金合同生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在<b>指定</b>网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>4、……</p> <p><del>基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人应当在基金份额发售的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各自网站上。</del></p> <p><del>(二)基金份额发售公告</del> 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> <p><del>(三)基金合同生效公告</del> 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> <p><del>基金管理人应当在基金合同生效公告说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。</del></p> <p>(四) 各类基金份额的基金净值信息 …… 遇特殊情况,经<b>中国证监会</b>同意,可以适当延迟计算或公告。</p> <p>(六) 基金定期报告,包括基金年度报</p>	<p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括:</p> <p>(一)基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投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。基金合同生效后,基金招募说明书的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书并登载在<b>规定</b>网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>4、……</p> <p>删除</p> <p>(二) 各类基金份额的基金净值信息 …… 遇特殊情况,经<b>履行适当程序</b>,可以适当延迟计算或公告。</p> <p>(四)基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在<b>规定</b>网站上,并将年度报告提示性公告登载在<b>规定</b>报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过<b>符合《中华人民共和国证券法》</b>规定的会计师事务所审计。 ……</p> <p>(五) 临时报告 …… 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><b>25、本基金变更目标ETF;</b></p> <p>(六) 澄清公告 在基金合同存续期限内,任何公共媒介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,以及可能损害基金份额持有人权益</p>

	<p>告、基金中期报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在<b>指定</b>网站上，并将年度报告提示性公告登载在<b>指定</b>报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过<b>具有证券、期货相关业务资格</b>的会计师事务所审计。</p> <p>……</p> <p><del>基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</del></p> <p>……</p> <p>(七) 临时报告</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><del>8、基金募集期延长或提前结束募集；</del></p> <p>(八) 澄清公告</p> <p>在基金合同存续期限内，任何公共媒介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，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，<del>并将有关情况立即报告中国证监会。</del></p> <p>(十三) 参与融资及转融通证券出借交易信息披露</p> <p>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。</p>	<p>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。</p> <p>(十一) 参与融资及转融通证券出借交易信息披露</p> <p>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，<u>并应就报告期内发生的转融通证券出借交易的重大关联交易事项做详细说明。</u></p> <p><u>(十二) 实施侧袋机制期间的信息披露</u> <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。</u></p>
<p><b>第十八部分 基金合同的变更、终止与基</b></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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，<del>并报中国证监会备案。</del></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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。</p>

金财产的清算	<p>三、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：  <del>3、基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产净值低于2亿元，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限；</del></p>	<p>三、基金合同的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，基金合同应当终止：          删除</p>
	<p>四、基金财产的清算</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、<b>具有从事证券相关业务资格</b>的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p>	<p>四、基金财产的清算</p> <p>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、<b>符合《中华人民共和国证券法》规定的</b>注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p>
	<p>七、基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p>	<p>七、基金财产清算的公告</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经<b>符合《中华人民共和国证券法》规定的</b>会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p>
	<p>八、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<b>15年以上</b>。</p>	<p>八、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，<b>保存时间不低于法律法规规定的最低期限</b>。</p>
第二十一部分 基金合同的效力	<p>……</p> <p>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或签章，<b>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</b>。</p> <p>4、基金合同正本一式<b>六</b>份，除上报有关监管机构一式<b>二</b>份外，基金管理人、基金托管人各持有<b>二</b>份，每份具有同等的法律效力。</p>	<p>……</p> <p>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或签章，<b>修改后的内容自《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深300指数型发起式证券投资基金转型为永赢沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》中载明的生效之日起生效</b>。</p> <p>4、基金合同正本一式<b>三</b>份，除上报有关监管机构一式<b>一</b>份外，基金管理人、基金托管人各持有<b>一</b>份，每份具有同等的法律效力。</p>