

东财基金管理有限公司关于东财上证科创板200指数型证券投资基金转型为东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告

东财基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)旗下的东财上证科创板200指数型证券投资基金(基金简称“东财上证科创200指数”或“本基金”)于2025年11月10日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可(2025)2496号)。《东财上证科创板200指数型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于2026年1月27日正式生效。为了更好地满足广大投资者的需求,本公司根据《基金合同》的约定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定于2026年6月11日起,将东财上证科创200指数转型为东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金,并相应修改《基金合同》等法律文件的相关条款。现将具体事宜公告如下:

本公司旗下的东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金于2026年4月9日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可(2026)770号),并于2026年5月21日正式成立,与本基金使用同一标的指数。根据《基金合同》第八部分“基金份额持有人大会”第一条“一、召开事由”第2款“在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额

持有人大会”中约定：“若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可决定本基金是否采取 ETF 联接基金模式运作并相应修改《基金合同》”。

本公司决定于 2026 年 6 月 11 日起，将东财上证科创 200 指数转型为东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金简称“东财上证科创 200ETF 联接”，A 类基金份额代码：026117，C 类基金份额代码：026118）。

届时，东财上证科创 200 指数的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“东财上证科创 200 指数 A 类基金份额”变更为“东财上证科创 200ETF 联接 A 类基金份额”，将“东财上证科创 200 指数 C 类基金份额”变更为“东财上证科创 200ETF 联接 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及销售服务费优惠活动保持不变。

重要提示：

1、本次修改内容为因转型为联接基金而对法律文件进行修改，同时因基金实际运作、基金托管人信息更新对法律文件进行修改。上述事项对基金份额持有人利益无实质性不利影响，可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改。《基金合同》的具体修改内容详见附件。

2、修改后的《东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《东财上证科创板 200 交易型开放式指数证

券投资基金联接基金托管协议》、《东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》自 2026 年 6 月 11 日起生效，原《东财上证科创板 200 指数型证券投资基金基金合同》、《东财上证科创板 200 指数型证券投资基金托管协议》、《东财上证科创板 200 指数型证券投资基金招募说明书》于当日失效。

3、投资者可登录本公司网站(www.dongcaijijin.com)查阅修改后的法律文件,或拨打客户服务电话(400-9210-107)获取相关信息。

风险提示：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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件和信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

特此公告。

东财基金管理有限公司

2026 年 6 月 10 日

附件：《东财上证科创板 200 指数型证券投资基金基金合同》与
《东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基
金基金合同》对照表

所在部分	东财上证科创板 200 指数型证券投资基金基金合同	东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
全文	东财上证科创板 200 指数型证券投资基金	东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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>1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”）、<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》”）和其他有关法律、法规。</p>
第一部分 前言	<p>三、东财上证科创板 200 指数型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。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并</p>	<p>三、<u>本基金由东财上证科创板 200 指数型证券投资基金转型而来。</u>东财上证科创板 200 指数型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</p>

	不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	监会”)注册。 中国证监会对 <u>东财上证科创板 200 指数型证券投资基金(转型更名前)</u> 募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
第一部分 前言	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)。	
第二部分 释义	1、基金或本基金:指东财上证科创板 200 指数型证券投资基金	1、基金或本基金:指东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金,本基金由东财上证科创板 200 指数型证券投资基金转型而来
第二部分 释义	10、基金份额发售公告:指《东财上证科创板 200 指数型证券投资基金基金份额发售公告》	
第二部分 释义		17、联接基金: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,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用契约型开放式运作方式的基金 18、目标 ETF:指另一只获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“该 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。本基金选择东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金为目标 ETF 19、标的指数:指中证指数有限公司编制并发布的上证科创板 200 指数及其未来可能发生的变更
第二部分 释义	26、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	28、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
第二部分 释义	31、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	33、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售

	机构办理 认购 、申购、赎回、转换、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	机构办理申购、赎回、转换、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
第二部分释义	32 、基金合同生效日：指 基金 募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期	34 、基金合同生效日：指 东财上证科创板 200 指数型证券投资基金 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
第二部分释义	34 、 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	
第二部分释义	35 、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限	36 、存续期：指《 东财上证科创板 200 指数型证券投资基金基金合同 》基金合同生效至《 东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同 》终止之间的不定期期限
第二部分释义	42 、 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	
第二部分释义	51、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	51、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、 目标 ETF 份额 、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
第二部分释义	55、基金份额类别：指根据 认购 /申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值 56、A 类基金份额：指在投资者通过直销机构（含基金管理人及其销售子公司，下同）以外的其他销售机构 认购 /申购时收取前端 认购 /申购费用，但不从本类别基金资产中收取销售服务费的基金份额类别；投资者通过直销机构 认购 /申购时不收取前端 认购 /申购费用 57、C 类基金份额：指在投资者 认购 /申购时不收取 认购 /申购费用，而是从直销机构以外的其他销售机构保有的本类别基金资产中收取销售服务费的基金份额类别；其中，对于投资者通过直销机构 认购 /申购的 C 类基金份额，	55、基金份额类别：指根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值 56、A 类基金份额：指在投资者通过直销机构（含基金管理人及其销售子公司，下同）以外的其他销售机构申购时收取前端申购费用，但不从本类别基金资产中收取销售服务费的基金份额类别；投资者通过直销机构申购时不收取前端申购费用 57、C 类基金份额：指在投资者申购时不收取申购费用，而是从直销机构以外的其他销售机构保有的本类别基金资产中收取销售服务费的基金份额类别；其中，对于投资者通过直销机构申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额

	<p>计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者</p>	<p>或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者</p>
第三部分基金的基本情况	<p>二、基金的类别 股票型证券投资基金</p>	<p>二、基金的类别 ETF 联接基金</p>
第三部分基金的基本情况	<p>四、基金的投资目标 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。</p>	<p>四、基金的投资目标 本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p>
第三部分基金的基本情况	<p>六、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。</p> <p>七、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金 A 类基金份额的具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。C 类基金份额不收取认购费。</p>	
第三部分基金的基本情况	<p>八、基金存续期限 不定期</p>	<p>六、基金存续期限 不定期</p>
第三部分基金的基本情况	<p>九、基金份额的类别 本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者通过直销机构以外的其他销售机构认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中收取销售服务费的，称为 A 类基金份额，投资者通过直销机构认购/申购 A 类基金份额时不收取前端认购/申购费用。在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从直销机构以外的其他销售机构保有的本类别基金资产中收取销售服务费的，称为 C 类基金份额（其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的 C</p>	<p>七、基金份额的类别 本基金根据申购费用、销售服务费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者通过直销机构以外的其他销售机构申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中收取销售服务费的，称为 A 类基金份额，投资者通过直销机构申购 A 类基金份额时不收取前端申购费用。在投资者申购时不收取申购费用，而是从直销机构以外的其他销售机构保有的本类别基金资产中收取销售服务费的，称为 C 类基金份额（其中，对于投资者通过直销机构申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费将在投资者</p>

	<p>类基金份额，计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者)。</p> <p>本基金 A 类和 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 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值=该计算日该类别基金份额的基金资产净值/该计算日该类别基金份额余额总数。</p> <p>投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。</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。根据基金销售和实际运作情况，基金管理人在不违反法律法规、《基金合同》以及不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，可以增加、减少或调整基金份额类别、调整现有基金份额类别的设置规则和分类方法、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金份额类别的申购费率、调低销售费率或变更收费方式、或者停止基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人需履行适当程序并及时公告。</p>	<p>赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者)。</p> <p>本基金 A 类和 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 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值=该计算日该类别基金份额的基金资产净值/该计算日该类别基金份额余额总数。</p> <p>投资人可自行选择申购的基金份额类别。</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。根据基金销售和实际运作情况，基金管理人在不违反法律法规、《基金合同》以及不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，可以增加、减少或调整基金份额类别、调整现有基金份额类别的设置规则和分类方法、或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金份额类别的申购费率、调低销售费率或变更收费方式、或者停止基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人需履行适当程序并及时公告。</p>
<p>第三部分 基金的基本 本情况</p>	<p>十、未来条件许可情况下的基金模式转换</p> <p><u>若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可决定本基金是否采取 ETF 联接基金模式运作并相应修改《基金合同》。</u></p>	<p>八、本基金与目标 ETF 的联系与区别</p> <p><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><u>1、在投资方法方面，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</u></p>

		<p>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，通过基金管理人及销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。</p> <p>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：</p> <p>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，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、存出保证金和应收申购款等。</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。</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>通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。</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。</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革与存续</p> <p>一、基金的历史沿革</p> <p>东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由东财上证科创板 200 指数型证券投资基金转型而来。东财上证科创板 200 指数型证券投资基金经中国证监会《关于准予东财上证科创板 200 指数型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2025〕2496 号）准予募集注册，基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。东财上证科创板 200 指数型证券投资基金自 2026 年 1 月 14 日至 2026 年 1 月 23 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</p>

<p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用 投资者通过直销机构认购本基金 A 类基金份额不收取认购费，通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额收取认购费用；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，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。</p> <p>2、募集期利息的处理方式 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，其中利息转份额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式 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>5、认购申请的确认 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>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额及所持基金份额比例进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>4、投资人在基金募集期内可以多次认</p>	<p>认，《东财上证科创板 200 指数型证券投资基金基金合同》于 2026 年 1 月 27 日生效。</p> <p>2026 年 5 月 21 日，基金管理人管理的东财上证科创板 200 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《东财上证科创板 200 指数型证券投资基金基金合同》的约定，决定将东财上证科创板 200 指数型证券投资基金转换为东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，即本基金。</p> <p>自 2026 年 6 月 11 日起，东财上证科创板 200 指数型证券投资基金正式转型为东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。</p>
---	--

购基金份额,A类基金份额的认购费用按照单笔认购金额分别计算。认购申请一经受理不得撤销。

5、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人有权拒绝该投资人的全部或部分认购申请。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

第五部分 基金备案

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或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。

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。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

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：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基

二、基金的存续

基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

	<p>金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。</p> <p>三、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 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	
<p>第五部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>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起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在相关公告中规定。 基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。</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日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在相关公告中规定。 基金管理人自基金合同生效日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。</p>
<p>第五部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书、基金产品资料概要或相关公告中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费（如有）将在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年计提的销售服务费（如有）将</p>	<p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书、基金产品资料概要或相关公告中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>其中，对于投资者通过直销机构申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费（如有）将在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年计提的销售服务费（如有）将在投资</p>

	在投资者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者。	者赎回相应基金份额时随赎回款一并返还给投资者。
第五部分 基金份额 的申购与 赎回	<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全部或部分申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。 <p>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。</p> <p>8、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。</p> <p>9、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限、单一投资人累计持有份额上限的情形。</p> <p>10、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系</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全部或部分申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或者因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。 6、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确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。 <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时。</u></p> <p><u>8、目标 ETF 暂停申购、暂停上市或目标 ETF 二级市场停牌等基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。</u></p> <p>9、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。</p> <p>10、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限、单一投资人累计持有份额上限的情形。</p> <p>11、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系</p>

	<p>统、基金注册登记系统、基金销售支付结算系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>11、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。</p> <p>12、基金管理人基于投资运作与风险控制的需要认为应当拒绝大额申购或暂停申购时。</p> <p>13、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、10、11、12、13 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 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>统、基金注册登记系统、基金销售支付结算系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>12、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。</p> <p>13、基金管理人基于投资运作与风险控制的需要认为应当拒绝大额申购或暂停申购时。</p> <p>14、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、<u>7</u>、<u>8</u>、<u>9</u>、10、11、12、13、<u>14</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>第五部分 基金份额 的申购与 赎回</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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。 5、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。 6、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 	<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> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或休市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。 5、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。 6、<u>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</u>

	<p>确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>	<p>净值时。</p> <p>7、目标ETF暂停赎回、暂停上市或目标ETF二级市场停牌等基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形。</p> <p>8、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确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>
第六部分 基金合同 当事人及 权利义务	<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>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；</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发售、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认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(24) 基金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；</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>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；</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销售、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基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p>
第六部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：贰仟陆佰壹拾陆亿零叁拾捌万壹仟肆佰伍拾玖元整</p>
第六部分 基金合同 当事人及	<p>三、基金份额持有人</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</p>	<p>三、基金份额持有人</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</p>

权利义务	<p>包括但不限于： (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p>	<p>包括但不限于： (4) 交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p>
第七部分 基金份额持有人大会		<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。若本基金启动侧袋机制且特定资产不包括目标 ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户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。</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《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>
第七部分 基金份额持有人大会	<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，但法律法规、中国证监会或《基金合同》</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，但法律法规、中国证监会或《基金合</p>

	<p>另有规定的除外：</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(3)若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后可决定本基金是否采取ETF联接基金模式运作并相应修改《基金合同》；</p> <p>(7)基金管理人、销售机构、基金登记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，调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；</p>	<p>同》另有规定的除外：</p> <p><u>(11)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、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p><u>(6)基金管理人、销售机构、基金登记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，调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。</p>	<p>一、投资目标</p> <p><u>本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还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，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、</p>	<p>二、投资范围</p> <p><u>本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及其备选成份股。</u>为更好地实现投资目标，基金还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，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期</p>

	<p>股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低手基金资产净值的 90%且不低手非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。</p>	<p>存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</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。</p> <p>基金的投资组合比例为：<u>本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%</u>，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。</p>
<p>第十一部分 基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。</p> <p>由于标的指数编制方法调整，或预期成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数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，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。</p>	<p>三、投资策略</p> <p>本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股及其备选成份股、债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>2、目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金投资目标 ETF 的两种方式如下：</p> <p>（1）申购和赎回：以申购/赎回对价</p>

<p>1、大类资产配置 本基金主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合构建 本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。若出现特殊情况(例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素)，本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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、市场流动性不足等情况，对股票投资组合进行实时调整，力争使得基金净值增长率与基准指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>A. 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况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>B. 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；</p> <p>C. 根据法律法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以</p>	<p>进行申购赎回目标ETF或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购赎回目标ETF。</p> <p>(2) 二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 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购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标ETF。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。</p> <p>3、股票投资策略 基金可投资于标的指数成份股及其备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股及其备选成份股来构建组合以申购目标ETF。因此对标的指数成份股及其备选成份股的投资，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。</p>
---	---

	对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。	
第十一部分 基金的投资	<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) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>除上述 (2)、(7)、(10)、(11)、(15) 情形之外，因证券或期货市场波动、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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>2、禁止行为</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>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><u>(1) 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；</u></p> <p>除上述 <u>(1)、(2)、(7)、(10)、(11)、(15)</u> 情形之外，因证券或期货市场波动、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、<u>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的投资比例的，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。<u>因证券或期货市场波动、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、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述 (1) 项规定的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。</u>法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自<u>转换为联接基金</u>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>2、禁止行为</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是<u>投资目标 ETF</u>、中国证监会另有规定的除外；</p>
第十一部分 基金的投资	<p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>本基金标的指数为上证科创板 200 指数。</p> <p>本基金业绩比较基准：上证科创板 200</p>	<p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>本基金标的指数为上证科创板 200 指数。</p> <p><u>上证科创板 200 指数从上海证券交易所</u></p>

	<p>指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p> <p>上证科创板 200 指数从上海证券交易所科创板中选取市值偏小且流动性较好的 200 只证券作为指数样本。上证科创 200 指数与上证科创板 50 成份指数等共同构成上证科创板规模指数系列，反映科创板市场不同市值规模上市公司证券的整体表现。</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。</p> <p>如果标的指数的成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p>	<p>所科创板中选取市值较小且流动性较好的 200 只证券作为样本。上证科创 200 指数与上证科创板 50 成份指数、上证科创板 100 指数共同构成上证科创板规模指数系列，反映科创板市场不同市值规模上市公司证券的整体表现</p> <p>本基金业绩比较基准：上证科创板 200 指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%</p> <p><u>1、业绩比较基准设定的原因</u></p> <p>本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的标的指数为上证科创板 200 指数，相应选取上证科创板 200 指数作为股票部分的基准要素，选取活期存款基准利率作为现金管理部分的基准要素，同时将上证科创板 200 指数的基准要素权重设置为 95%，活期存款基准利率的基准要素权重设置为 5%。</p> <p>综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。</p> <p><u>2、业绩比较基准要素的基本信息</u></p> <p>上证科创板 200 指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 000699，具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：https://www.csindex.com.cn。</p> <p>活期存款基准利率由中国人民银行发布，具体信息详见中国人民银行网站，网址：www.pbc.gov.cn。</p> <p><u>3、业绩比较基准的计算方法</u></p> <p>本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算业</p>
--	---	---

		<p><u>绩比较基准中上证科创板 200 指数、活期存款基准利率的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。</u></p> <p><u>4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法</u></p> <p><u>本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。</u></p> <p><u>5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序</u></p> <p><u>本基金股票部分的业绩比较基准与标的指数一致，若本基金变更标的指数，本基金将根据法律法规、中国证监会的规定和基金合同约定履行相关程序。</u></p> <p><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。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。</u></p>
<p>第十一部分 基金的投资</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p><u>本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币</u></p>	<p>六、风险收益特征</p> <p><u>本基金为 ETF 联接基金，且目标 ETF 为采用指数化操作的股票型基金，因</u></p>

	<p>市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>	<p>此本基金的预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，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>第十一部分 基金的投资</p>		<p><u>八、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，本基金将在履行适当程序后由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，履行适当的程序后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》中将去掉关于目标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（但变更后的本基金与目标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>第十二部分 基金的财产</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金持有的各类有价证券、期货合约、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产所形成的价值总和。</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金持有的各类有价证券、<u>目标ETF份额</u>、期货合约、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产所形成的价值总和。</p>

第十三部分 基金 资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、股指期货合约、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的<u>目标ETF份额</u>、股票、股指期货合约、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>
第十三部分 基金 资产估值	<p>四、估值方法</p> <p>8、本基金参与融资及转融通证券出借业务的，应参照相关法律法规及行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。</p> <p>9、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。</p> <p>10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>11、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。</p> <p>12、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>	<p>四、估值方法</p> <p>8、<u>本基金投资的目标ETF份额以目标ETF估值日的基金份额净值估值，若估值日为非证券交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。</u></p> <p>9、本基金参与融资及转融通证券出借业务的，应参照相关法律法规及行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。</p> <p>10、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。</p> <p>11、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>12、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。</p> <p>13、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>
第十三部分 基金 资产估值	七、暂停估值的情形	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>4、<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>
第十三部分 基金 资产估值	<p>九、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>九、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第11项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十四部分 基金 费用与 税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>9、基金的相关账户开户及维护费用；10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>9、基金的相关账户开户及维护费用；10、<u>基金投资目标ETF的相关费用；</u>11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。</p>

<p>第十四部分 基金费用与税收</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>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> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</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> $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</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><u>本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标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%年费率计提。</u>管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p><u>E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额，若为负数，则E取0</u></p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</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。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标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0.05%的年费率计提。</u>托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p><u>E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额，若为负数，则E取0</u></p> <p>基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数</p>
----------------------	--	--

		据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。
第十四部分 基金费用与税收	<p>上述“一、基金费用的种类”中第4-10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> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>下列费用不列入基金费用：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失； 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用； 3、《基金合同》生效前的相关费用； 4、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支； 5、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。 	<p>上述“一、基金费用的种类”中第4-<u>11</u>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> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>下列费用不列入基金费用：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失； 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用； 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《东财上证科创板200指数型证券投资基金基金合同》的约定执行； 4、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支； 5、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。
第十五部分 基金的收益与分配	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，并于变更实施日前在规定媒介公告。</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，并于变更实施日前在规定媒介公告。</p>
第十六部分 基金的会计与审计	<p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；</p>

	<p>个会计年度披露；</p>	
<p>第十七部分 基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>(一)基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议、基金份额发售公告</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，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。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规定网站上。</p> <p>前款规定的重大变更主要包括：</p> <p>(1)基金合同、基金托管协议相关内容发生变更；</p> <p>(2)变更基金简称(含场内简称)、基金代码(含场内代码)；</p> <p>(3)变更基金管理人、基金托管人的法定名称；</p> <p>(4)变更基金经理；</p> <p>(5)变更认购费、申购费、赎回费等费率；</p> <p>(6)其他对投资者有重大影响的事项。</p> <p>除上述事项之外，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。</p> <p>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>5、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。基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在规定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>(一)基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议</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。</p> <p>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规定网站上。</p> <p>前款规定的重大变更主要包括：</p> <p>(1)基金合同、基金托管协议相关内容发生变更；</p> <p>(2)变更基金简称(含场内简称)、基金代码(含场内代码)；</p> <p>(3)变更基金管理人、基金托管人的法定名称；</p> <p>(4)变更基金经理；</p> <p>(5)变更申购费、赎回费等费率；</p> <p>(6)其他对投资者有重大影响的事项。</p> <p>除上述事项之外，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。</p> <p>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>《基金合同》、托管协议登载在规定的网站上。</p> <p>(二)《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定的报刊和规定的网站上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集； 25、本基金变更目标ETF； 26、本基金变更标的指数；</p>	<p>(五) 临时报告</p> <p>25、本基金变更目标ETF；</p>
<p>第十七部分 基金的信息披露</p>		<p>(十四) 投资目标ETF的信息披露 基金管理人应在定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露所持基金的以下相关情况,包括:</p> <p>1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等;</p> <p>2、交易及持有基金产生的费用,招募说明书中应当列明计算方法并举例说明;</p> <p>3、本基金持有的基金发生的重大影响事件,如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等。</p>
<p>第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>其中,对于投资者通过直销机构认购/申购的C类基金份额,计提的销售服务费(如有)将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者;对于投资者通过其他销售机构认购/申购的C类基金份额,持续持有期限超过一年计提的销售服务费(如有)将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者。</p>	<p>其中,对于投资者通过直销机构申购的C类基金份额,计提的销售服务费(如有)将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者;对于投资者通过其他销售机构申购的C类基金份额,持续持有期限超过一年计提的销售服务费(如有)将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者。</p>
<p>第十九部分 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》等法律法规的规定或者《基金合同》约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿,仅限于直接损失。但是发生下列情况,当事人免责:</p> <p>3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。</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》等法律法规的规定或者《基金合同》约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿,仅限于直接损失。但是发生下列情况,当事人免责:</p> <p>3、在没有过错的情况下,基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失</p>

	<p>三、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或减轻由此造成的影响。</p>	<p>等。</p> <p>三、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<u>或因前述原因无法避免错误发生的</u>，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或减轻由此造成的影响。</p>
<p>第二十一部分 基金合同的效力</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盖章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。</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盖章，<u>修改后的内容自2026年6月11日生效。</u></p>

注：“第二十三部分 基金合同内容摘要”章节涉及上述内容的一并修改。