

关于国联创业板综合指数增强型证券投资基金转型为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订法律文件的公告

国联基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的国联创业板综合指数增强型证券投资基金（基金简称：国联创业板综合指数增强，以下简称“本基金”）于 2026 年 3 月 20 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可〔2026〕569 号）。《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2026 年 6 月 15 日正式生效。

《基金合同》约定：“若将来本基金管理人推出同一标的指数的增强策略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有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标 ETF 的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序后及时公告，而无需召开持有人大会审议”。

本公司旗下国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金已于 2026 年 9 月 9 日正式成立。为更好地满足投资者需求，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《基金合同》的相关约定，本公司经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，决定于 2026

年9月18日起，将国联创业板综合指数增强型证券投资基金转型为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金简称：国联创业板综合增强策略ETF联接，A类基金份额代码：027123；C类基金份额代码：027124）。

届时，国联创业板综合指数增强型证券投资基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“国联创业板综合指数增强型证券投资基金A类基金份额”变更为“国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额”，将“国联创业板综合指数增强型证券投资基金C类基金份额”变更为“国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额”。

各类基金份额净值分开计算，前述变更不影响各类基金份额净值的计算，各类基金份额的基金代码保持不变。转型后，本基金的管理费率、托管费率以及各类基金份额的申购费率、赎回费率、销售服务费率均保持不变。

根据上述变更内容及本基金实际运作情况，本公司对《基金合同》作出相应修改并同步修改本基金托管协议、招募说明书及产品资料概要。《基金合同》的修订内容详见附件《〈国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同〉修订为〈国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同〉前后对照表》。

重要提示：

1、修订后的《国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《国联创业板综合增强策略交易型开放

式指数证券投资基金联接基金托管协议》、《国联创业板综合增强策略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 9 月 18 日起生效。

2、本公告仅对本基金转型为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金的有关事项予以说明。如有疑问，投资者可以拨打本公司客户服务电话 400-160-6000 或 010-56517299，或登录本公司网站 www.glfund.com 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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于相关基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等法律文件，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

国联基金管理有限公司

2026 年 09 月 17 日

附件：《〈国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同〉修订为
〈国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金合同〉前后对照表》

章节	修订前表述	修订后表述
全文	国联创业板综合指数增强型证券投资基金	国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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。 三、国联创业板综合指数增强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。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值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。 本基金为指数增强型股票基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控	券投资基金运作指引第 2 号——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。 三、国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）由国联创业板综合指数增强型证券投资基金转型而来，国联创业板综合指数增强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。 中国证监会对国联创业板综合指数增强型证券投资基金募集的注册，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。
--	---	---

	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，具体风险详见招募说明书“风险揭示”部分。	本基金为指数基金，通过投资于目标ETF紧密跟踪标的指数，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，具体风险详见招募说明书“风险揭示”部分。
第二部分 释义	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： 1、基金或本基金：指国联创业板综合指数增强型证券投资基金 4、基金合同或本基金合同：指《国联创业板综合指数增强型证券投资基金 基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国联创业板综合指数增强型证券投资基	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： 1、基金或本基金：指国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金 4、基金合同或本基金合同：指《国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

	金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《国联创业板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新 8、基金份额发售公告：指《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》 24、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 30、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	及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《国联创业板综合增强策略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》及其更新 23、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 29、基金合同生效日：指《国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效日，原《国联创业板综合
--	---	---

	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 32、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 33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限 40、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 44、基金份额类别：指根据认/申购费用、赎回费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别代码不同，并分别计算、公告基金份额净值和基金份额累计净值 45、A类基金份额或A类份额：指在投资人通过直销机构以外的其他销售机构认/申购时收取认/申购费用，并不再从本类别基金资产中计	指数增强型证券投资基金基金合同》自同日起失效 31、存续期：指《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》生效至本基金基金合同终止之间的不定期期限 41、基金份额类别：指根据申购费用、赎回费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别代码不同，并分别计算、公告基金份额净值和基金份额累计净值 42、A类基金份额或A类份额：指在投资人通过直销机构以外的其他销售机构申购时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售
--	--	---

	提销售服务费的基金份额；投资者通过直销机构认购/申购时不收取认购/申购费用 46、C类基金份额或C类份额：指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计提销售服务费，而不收取认/申购费用的基金份额；其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的C类基金份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的C类基金份额销售服务费，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 53、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	服务费的基金份额；投资者通过直销机构申购时不收取申购费用 43、C类基金份额或C类份额：指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计提销售服务费，而不收取申购费用的基金份额；其中，对于投资者通过直销机构申购的C类基金份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的C类基金份额销售服务费，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 50、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、投资目标ETF份额所得收益、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
--	--	---

	54、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、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：指基金拥有的目标 ETF 份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和 66、目标 ETF：指国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“国联创业板综合增强策略 ETF”），本基金主要投资于该 ETF 以求达到投资目标 67、ETF 联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于目标 ETF，与目标 ETF 的投资目标相似，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，即本基金
第三部分 基金的基本情况	一、基金名称 国联创业板综合指数增强型证券投资基金 二、基金的类别 股票型证券投资基金 四、标的指数 创业板综合指数	一、基金名称 国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金 二、基金的类别 ETF 联接基金 四、标的指数

	五、基金的投资目标 本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数有效跟踪的基础上，结合量化及基本面的方法，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值 六、基金的最低募集份额总额及金额 本基金的最低募集份额总额为2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币。 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。	本基金的标的指数为创业板综合指数 未来如果目标ETF的标的指数发生变更，本基金不变更目标ETF，则本基金的标的指数将随之变更，并可相应变更业绩基准和基金名称，不需另行召开持有人大会。 五、基金的投资目标 本基金主要通过投资于目标ETF，在有效跟踪标的指数的基础上，力争获取超越指数表现的投资收益
--	--	---

	本基金 A 类基金份额的认购费率按招募说明书、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。投资者通过基金管理人直销机构认购本基金 A 类基金份额的，不收取认购费。 八、基金存续期限 不定期 九、基金份额类别设置 本基金根据认购费、申购费、赎回费和销售服务费等费率收取方式的不同，将基金份额分为 A、C 两类份额。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用、赎回时收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中收取销售服务费的，且投资者通过直销机构认/申购时不收取认/申购费用，称为 A 类基金份额。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计提销售服务费，而不收取认/申购费用的，称为 C 类基金份额（其中，对于投资	六、基金存续期限 不定期 七、基金份额类别设置 本基金根据申购费、赎回费和销售服务费等费率收取方式的不同，将基金份额分为 A、C 两类份额。在投资者申购基金时收取申购费用、赎回时收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中收取销售服务费的，且投资者通过直销机构申购时不收取申购费用，称为 A 类基金份额。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计提销售服务费，而不收取申购费用的，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
--	--	---

	者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的 C 类基金份额销售服务费，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)。相关费率的设置及费率水平在招募说明书中列示。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。 投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。 在不违反法律法规的规定、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前提下，根据基金运作情况，基金管理人经	份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的 C 类基金份额销售服务费，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)。相关费率的设置及费率水平在招募说明书中列示。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。 投资人可自行选择申购的基金份额类别。 在不违反法律法规的规定、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前提下，根据基金运作情况，基金管理人经与基金托管人协商，在履行适当程
--	---	---

与基金托管人协商，在履行适当程序后，停止现有基金份额类别的销售、或者变更收费方式、增加新的基金份额类别、调整本基金份额的分类规则、调整认/申购各类基金份额的最低金额限制及规则等，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。 十、未来条件许可情况下的模式转换 若将来本基金管理人推出同一标的指数的增强策略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有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标 ETF 的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，履行适当程序后	序后，停止现有基金份额类别的销售、或者变更收费方式、增加新的基金份额类别、调整本基金份额的分类规则、调整申购各类基金份额的最低金额限制及规则等，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。 八、本基金与目标 ETF 的联系与区别 本基金的目标 ETF 为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金。 1、本基金为目标 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别： 本基金与目标 ETF 之间的联系： （1）两只基金跟踪同一个标的指数； （2）两只基金具有相似的风险收益特征； （3）目标 ETF 是本基金的主要投资对象。
--	---

	及时公告，而无需召开持有人大会审议。	本基金与目标 ETF 之间的区别： （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，间接跟踪标的指数的表现。 （2）在交易方式方面，投资人既可以在二级市场买卖目标 ETF 的基金份额，也可以按照申购赎回清单的要求，按照目标 ETF 法律文件的约定申赎目标 ETF；而本基金的申购与赎回则与普通的开放式基金类似，通过基金管理人及销售机构按未知价法、采用金额申购、份额赎回的方式进行。 （3）价格揭示机制不同。目标 ETF 有实时市场交易价格和每日基金份额净值；本基金只揭示每日基金份额净值。 （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。 2、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： （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标的指数成份股及备选成份股，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、国债期货和股票期权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%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券（现
--	---

		金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。 (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，对基金净值影响较小；而本基金申购赎回采用按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金份额净值产生一定冲击。 (3) 投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同。
第四部分 基金份额的发售基金的历史沿革	一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式	国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金由国联创业板综合指数增强型证券投资基金变更而来。国联创业板综合指数增强型证券投资基金的募集申请经中国证监会 2026 年 3 月 20 日证监许可〔2026〕569 号文注册，基金管理人为国联基金管理有限公司

	通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站的相关公示。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、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。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。投资人在直销机构以外的其他销售机构认购 A 类基金份额时支付认购费用，投资者通过直销机构认购 A 类基金份额时不收取前端认购费用；认购 C 类基金份额不支付认购费用，而是从直销机构以外的其他销售机构保有的该类别基金资产中计提销售服务费。	司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。国联创业板综合指数增强型证券投资基金自 2026 年 5 月 29 日至 2026 年 6 月 11 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，《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于 2026 年 6 月 15 日生效。根据《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》的约定： “若将来本基金管理人推出同一标的指数的增强策略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有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。在遵守法律法规有关联接基金规定的前提下，基金投资目标、投资范围和投资策略等条款中将增加投资目标 ETF 的相关内容，同时相应变更基金名称、类别。此项调整经基金管理人与基金
--	--	---

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。 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。 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。 4、认购份额余额的处理方式 认购份额（含利息折算的份额）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。 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生效，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认	托管人协商一致，履行适当程序后及时公告，而无需召开持有人大会审议。” 基金管理人经与基金托管人协商一致后，决定将国联创业板综合指数增强型证券投资基金变更为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》。 自 2026 年 9 月 18 日起，国联创业板综合指数增强型证券投资基金正式变更为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》自同日起失效。
---	--

	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，由此产生的任何损失由投资者自行承担。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。投资人在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请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。 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。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、基金管理人可以对本基金的募集规模上限进行限制，具体限制和	
--	---	--

	处理方法请参看招募说明书或相关公告。 5、按照本基金各类基金份额合并计算，如本基金单一投资者累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。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。法律法规另有规定的，从其规定。	
第五部分 基金备案基金的存续	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	原《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》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

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：—	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。
---	---

	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 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息； 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 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。	
第六部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、登记公司系统故障、港股通交易系统、港股通资金交收规则限制或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。	四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇目标ETF暂停交易或赎回、证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、登记公司系统故障、港股通交易系统、港股通资金交收规则限制或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式： 本基金赎回金额的计算及余额的处理方式详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。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。 其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的C类基金份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的C类基金份额销售服务费，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。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 3、赎回金额的计算及处理方式： 本基金赎回金额的计算及余额的处理方式详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。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。 其中，对于投资者通过直销机构申购的C类基金份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的C类基金份额销售服务费，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。
--	--	--

七、拒绝或暂停申购的情形 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： 8、按照本基金各类基金份额合并计算，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数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形。 12、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、7、10、11、12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规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并公告。	七、拒绝或暂停申购的情形 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： 11、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。 12、目标ETF暂停申购或二级市场交易停牌、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情形； 13、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、7、9、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规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并公告。
--	---

	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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：	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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： 8、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。 9、目标 ETF 暂停赎回或二级市场交易停牌或延缓支付赎回对价，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形；
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：	一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （17）代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标 ETF 所产生的权利，基金合同另有约定的除外；

	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜； （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； （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； 二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜； （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； 二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务
--	--	---

	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施； 三、基金份额持有人 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： （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；	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： （10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；对定期报告有关业绩比较基准的披露内容进行复核；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施； 三、基金份额持有人 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： （5）出席或者委派代表出席本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会，对本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
--	---	--

	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： （4）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；	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： （4）交纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
第八部分 基金份额持有人大会		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。 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。 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。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规、中国证监会另有规定外，应当召开基金份额持有人大会：	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。 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。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规、中国证监会另有规定外，应当召开基金份额持有人大会：
--	--	--

	2、在不违反法律法规规定和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，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： （5）经中国证监会允许，基金管理人、基金销售机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；	（13）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； 2、在不违反法律法规规定和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，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： （5）经中国证监会允许，基金管理人、基金销售机构、登记机构调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
第十二部分 基金的投资	一、投资目标 本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数有效跟踪的基础上，结合量化及基本面的方法，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。 二、投资范围	一、投资目标 本基金主要通过投资于目标ETF，在有效跟踪标的指数的基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。 二、投资范围

	本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括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、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品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）。	本基金的投资范围主要为目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）。 为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于非成份股（包括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、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品及法律法规或中国证监会
--	--	--

	基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除股指期货期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于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%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 三、投资策略 本基金采用指数增强型投资策略，以创业板综合指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整	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）。 基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的资产不低于基金资产的90%，其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于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%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 三、投资策略 本基金以目标ETF为主要投资标的，方便投资者通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。在正常市场情况下，力争控制本基金净值增长率与业绩比较
--	--	--

	投资组合，力争控制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不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 股票投资策略为本基金的核心策略。本基金股票投资以个股精选策略为主。在本基金的投资过程中，将控制股票投资组合与标的指数的结构性偏离，以期在长期实现持续超越标的指数收益率的投资目标。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，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的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 1. 资产配置策略 本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市	基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.0%。 如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，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的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 1. 资产配置策略 本基金主要投资于目标 ETF 基金份额，投资于目标 ETF 的比例不低于
--	---	---

	场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，谋求在偏离风险和超额收益间的最佳配置。 2. 股票投资策略 本基金主要通过量化及基本面主动精选个股，选取并持有基本面良好的股票构成投资组合，在控制组合	基金资产净值的 90%。除此以外为更好地实现投资目标，本基金可投资于标的指数成份股及其备选成份股或法律法规、基金合同允许投资的其他投资工具。 2、目标 ETF 投资策略 本基金投资目标 ETF 的方式如下： （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。 （2）二级市场方式：目标 ETF 上市交易后，在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，待履行适当程序后本基金也将作相应的变更或调整。 3. 股票投资策略 本基金可通过买入标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数，也可以通过买入标的指数成份股、
--	---	---

	跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金所跟踪的标的指数为创业板综合指数，在满足投资比例要求基础上，本基金将在允许的投资板块范围内，进行成份股优化增强、非成份股优选增强对组合进行优化。具体来说，股票投资采用定量和定性分析相结合的策略选取基本面良好的股票，在保持对基准指数有效跟踪的同时，力争实现对基准指数的长期超越。 1) 定性分析 在定性分析方面，本基金将精选公司治理优良、竞争优势突出、行业前景光明、盈利稳定增长的优质上市公司。具体而言，主要考虑以下几方面因素：— ①治理结构、公司管理层和财务状况评价 本基金主要从股东结构和激励约束机制两方面对公司治理进行分析。—	备选成份股的方式申购目标 ETF。 对于出现市场流动性不足等情况，导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人有权通过投资非成份股等进行适当的替代。此外，本基金将综合考虑收益预测、风险水平、交易成本、流动性等因素进行股票投资，构建与优化投资组合，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越业绩比较基准的投资收益。
--	--	--

	股东结构主要从股东背景、股权变更情况、关联交易、独立性等方面予以考察，激励约束机制则从股权激励、管理层与股东利益的一致性等方面考察。 本基金将致力于寻找中国优秀的企业家以及其管理的企业。优秀的企业具备出色的经营才能，而且怀着清晰、长期的愿景，充满激情，不懈努力，执行力强。 本基金投资标的的财务状况应当健康和稳健。通过对目标企业的资产负债、损益、现金流量的分析，评估企业盈利能力、营运能力、偿债能力及增长能力等财务状况。 ②企业竞争优势评估 企业竞争优势评估主要从生产、市场、技术和政策环境等四方面进行分析。生产优势集中体现在能以相对更低的成本为顾客提供更好的产品或服务。市场优势主要表现在产品线、营销渠道及品牌竞争力三方	
--	--	--

	面。技术优势从专利权及知识产权保护、研究开发两方面考察。政策环境主要关注所在行业是否符合国家产业政策的方向。 ③行业背景和商业模式分析 本基金主要从行业集中度和行业地位两方面对行业背景进行分析，优选具有较好的行业集中度及行业地位，并具备独特核心竞争优势的企业。企业所在行业有一定的集中度，其主导产品的市场份额高于市场平均水准，而且在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力等一个或数个方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的优势。 优秀的商业模式通常有以下两种：第一，较强的定价能力，在行业地位领先且稳固，对上下游具有较强的议价能力，能够通过不断提升产品价格或降低成本以提高盈利能力，即使在宏观经济向下的阶段，能够通过控制产量等方式延缓甚至	
--	---	--

避免价格的下跌；第二，扩张成本低，即利润增长对资本的需求和依赖较低，表现在财务数据上就是净资产收益率高，很少或者几乎不需要股权融资就可以实现较高增长，最好商业模式能够较快复制，能够以较快的速度形成规模效益。

2) 定量分析

在定量分析方面，本基金使用多因子量化选股模型挖掘影响个股超额收益的因素；通过风险模型衡量和控制组合相对基准的跟踪误差，降低个股投资风险；通过交易成本控制模型减少交易成本；通过组合构建模型结合定性分析和量化模型的结论，综合获利机会、风险、交易成本等各方面因素，动态构造组合。

①使用多因子模型发掘定价偏离
本基金基金管理人的指数与量化投资团队开发的多因子量化选股模型，通过数量技术对历史数据进行

	深入研究，发掘影响证券价格的各类因子，在投资中利用这些因子对股票进行综合评分，选入预期收益较高的股票，剔除可能存在下行风险的股票。 本基金使用的因子主要包括公司基本面信息、市场一致预期和微观价格数据等，主要集中在质量、成长、预期、价值、市场面这几个大类，每一类因子由多个选股指标组成，各选股指标以投资逻辑为基础，经过反复提炼和验证，具备一定的选股能力。 ②通过风险控制模型衡量和控制风险 本基金通过风险控制模型衡量和控制组合相对业绩比较基准在子行业、风格、个股方面的风险暴露，努力控制相对业绩比较基准的跟踪误差，力争避免在某些市场环境下较大幅落后于标的指数，通过使用	
--	---	--

	个股风险筛查模型降低个股投资风险。 ③使用定量技术减少交易成本 本基金在组合构建时将分析个股的流动性，在此基础上限制个股的权重；本基金在组合调整时将综合比较组合调整带来的潜在收益和组合调整的成本，避免不必要的交易；本基金在交易时将利用交易技术尽可能减少市场冲击，降低交易成本。 ④综合衡量获利机会、风险因素、交易成本，动态构造组合 除了在价格发现、风险控制、交易技术等方面进行深入挖掘外，本基金将综合这些因素之间的相互联系，进行整体考虑后动态构造组合。 3) 港股通标的股票的投资策略 对于港股通标的股票，本基金除按照上述“自下而上”的个股精选策略，还将结合公司基本面、国内经	
--	--	--

	济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为，以及世界主要经济体经济发展和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。 四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%； （11）本基金参与股指期货、国债期货交易，需遵守下列投资比例限制： 2）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券	四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于目标 ETF 的资产不低于基金资产的 90%； （11）本基金参与股指期货、国债期货交易，需遵守下列投资比例限制： 2）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等； 除第（2）、（9）、（16）、（17）、（19）、（20）项外，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。 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基金合同生效之日起开始。	指股票、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）等； 除第（2）、（9）、（16）、（17）、（19）、（20）项外，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、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。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成分股调整、标的指数成分股流动性限制、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。 基金管理人应当自《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》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基金合同生效之日起开始。 2、禁止行为 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： （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； 五、标的指数和业绩比较基准 （一）业绩比较基准的设定及原因	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。 基金管理人应当自《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》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基金合同生效之日起开始。 2、禁止行为 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： （4）买卖除目标 ETF 以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； 五、标的指数和业绩比较基准 （一）业绩比较基准的设定及原因
--	---	--

	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数有效跟踪的基础上，结合量化及基本面的方法，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。 本基金的标的指数为创业板综合指数，选取在深圳证券交易所创业板上市的符合条件的股票构成样本，反映创业板市场的总体走势。选取活期存款基准利率作为现金类资产的基准要素，并按照预期大类资产配置的情况，将权益资产与现金类资产所对应的基准要素权重分别设置为 95%与 5%。该业绩比较基准与本基金的投资目标、投资范围、投	本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF，在有效跟踪标的指数的基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。目标 ETF 为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金，标的指数为创业板综合指数。本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象，投资于目标 ETF 的资产不低于基金资产的 90%，同时本基金保留的现金或投资于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%。相应选取创业板综合指数、活期存款基准利率作为基准要素，同时将创业板综合指数、活期存款基准利率对应的基准要素权重分别设置为 95%和 5%。 综上，该业绩比较基准与本基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制能够较好匹配。
--	--	---

	资策略、投资比例限制能够较好匹配。 （二）业绩比较基准要素所涉及的发布机构、代码、查询途径 创业板综合指数的发布机构为深圳证券交易所信息有限公司，对应代码为399102，有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券交易所信息有限公司网站，网址：http://www.cnindex.com.cn。 （三）业绩比较基准的计算方法 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绩比较基准中创业板综合指数、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，最后通	（二）业绩比较基准要素所涉及的发布机构、代码、查询途径 创业板综合指数的发布机构为深圳证券交易所信息有限公司，对应代码为399102，有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见深圳证券交易所信息有限公司网站，网址：http://www.cnindex.com.cn。 活期存款基准利率由中国人民银行制定并发布，具体信息详见中国人民银行官网，网址： www.pbc.gov.cn。 （三）业绩比较基准的计算方法 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绩比较基准中创业板综合指数、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
--	---	--

	过每日连乘的方式计算业绩比较基准收益率。 （四）管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法 本基金为指数增强型基金，以创业板综合指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并根据标的指数成份股、备选成分股及其权重的变动，结合增强投资策略对股票投资组合进行相应地调整，力争控制本基金的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过8.0%。 本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离或跟踪误差过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪偏离度和跟踪误差控制在目标范围内。	组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。 （四）管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法 本基金以目标ETF为主要投资标的，在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过8.0%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
--	--	--

	（五）变更业绩比较基准的情形和程序 如果上述业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响： （1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准不再符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》第五条第三款、第四款规定的； （2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》第五条第三款、第四款规定的； （3）中国证监会认可的其他情形。	（五）变更业绩比较基准的情形和程序 业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会： （1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性； （2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素
--	---	--

	如果业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外： （1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的； （2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。 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。	等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的； （3）中国证监会认可的其他情形。 业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外： （1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的； （2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。 如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者市场变化导致本业绩比较基准不再适用，又或者市场出现更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准，则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意，在按照监管部门要
--	---	---

	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。 若出现指数更名等对基金投资无实质性影响的标的指数变更情形，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致并履行适当程序后，相应更换基金名称和业绩比较基准。 六、风险收益特征 本基金为股票指数增强型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	求履行适当程序后调整本基金的业绩比较基准并及时在规定媒介上公告。 法律、行政法规或监管部门调整相关规定，从其规定。 六、风险收益特征 本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。同时，本基金为被动式投资的股票指数基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	---	--

		八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理 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，以上事项无须基金份额持有人大会审议；相应地，本基金基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分，届时将由基金管理人另行公告。 1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现； 2、目标 ETF 终止上市； 3、目标 ETF 基金合同终止； 4、目标 ETF 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）； 5、目标 ETF 与其他基金进行合并； 6、中国证监会规定的其他情形。
--	--	--

第十三部分 基金的财产	一、基金资产总值 基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的目标 ETF 份额、购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。
第十四部分 基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、信用衍生品、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。 四、估值方法 七、暂停估值的情形 九、特殊情况的处理	二、估值对象 基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、存托凭证、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、信用衍生品、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。 四、估值方法 1、目标 ETF 份额的估值 本基金投资的目标 ETF 份额以其估值日基金份额净值估值。 七、暂停估值的情形 3、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； 九、特殊情况的处理

	1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 14、15 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。	1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 15、16 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。
第十五部分 基金费用与税收	一、基金费用的种类 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值	一、基金费用的种类 12、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） 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金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 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金

	2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 上述“一、基金费用的种类”中第 4—12 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	资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0 2、基金托管人的托管费 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 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0 上述“一、基金费用的种类”中第 4—13 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
--	--	---

	3、基金合同生效前的相关费用；	3、基金合同生效前的相关费用根据《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》的约定执行；
第十七部分 基金的 会计与 审计	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；	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；
第十八部分 基金的 信息披 露	五、公开披露的基金信息 （一）基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要 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	五、公开披露的基金信息 （一）基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要 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

	登载在规定网站上；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。 5、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三日前，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，并将基金产品资料概要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基金合同、基金托管协议登载在规定网站上。 （二）基金份额发售公告 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，	规定网站上；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。
--	--	---

	并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。 （三）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（若遇法定节假日规定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在规定的媒介上登载基金合同生效公告。 （四）基金净值信息 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规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。 （六）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。	（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 基金定期报告应当披露基金实际投资与同期业绩比较基准在收益率、波动率、资产配置比例（如有）、持仓股票行业分布（如有）等方面的对比情况，并通过定性和定量方
--	--	--

	(七) 临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。 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： 8、基金募集期延长或提前结束募集；	法对基金业绩表现与业绩比较基准的差异进行说明。 (五) 临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。 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： 23、目标 ETF 变更； (十八) 投资目标 ETF 的信息披露 本基金在招募说明书（更新）及定期报告等文件中应当设立专门章节披露所持目标 ETF 以下情况，并揭示相关风险： 1、投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等； 2、交易及持有目标 ETF 产生的费用，包括申购费、赎回费、管理
--	---	---

		费、托管费等，招募说明书（更新）中应当列明计算方法并举例说明； 3、持有的目标 ETF 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； 4、本基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	五、基金财产清算剩余资产的分配 其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的 C 类基金份额销售服务费（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。	五、基金财产清算剩余资产的分配 其中，对于投资者通过直销机构申购的 C 类基金份额所计提的销售服务费，或者通过其他销售机构申购且持续持有期限超过一年以后继续计提的 C 类基金份额销售服务费（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。
第二十二部分 基金合	基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。	基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

同的效力	1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字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。 2、基金合同的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。	1、自 2026 年 9 月 18 日起，国联创业板综合指数增强型证券投资基金正式变更为国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《国联创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于同日起失效。 2、基金合同的有效期限自《国联创业板综合指数增强型证券投资基金基金合同》生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。
第二十四部分 基金合同内容摘要		基金合同摘要修改同基金合同正文部分内容