

关于华宝中证 100 指数证券投资基金变更为 华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 并修订基金合同和托管协议的公告

华宝基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的华宝中证 100 指数证券投资基金经中国证监会《关于核准华宝兴业中证 100 指数证券投资基金募集的批复》（证监许可【2009】754 号）核准募集。

根据《基金合同》约定：“若将来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》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。”且《基金合同》同时约定：“2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：……

（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》；……”。

本公司旗下华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：中证 100ETF 基金，基金代码：562000）已于 2022 年 7 月 21 日成立，并于 2022 年 8 月 1 日起在上海证券交易所上市交易。为更好地满足广大投资者的投资理财需求，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》的相关规定和《基金合同》的相关约定，本公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定于 2022 年 10 月 10 日起，将华宝中证 100 指数证券投资基金转型变更为华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）并相应修订《基金合同》等法律文件相关条款。现将具体事宜公告如下：

一、转型变更为联接基金。

华宝中证 100 指数证券投资基金将转型变更为华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。根据《基金合同》约定，无须召开基金份额持有人大会。《基金合同》、《华宝中证 100 指数证券投资基金托管协议》和《华宝中证 100 指数证券投资基金招募说明书》将进行相应修订和补充。华宝中证 100 指数证券投资基金原有的 A 类基金份额（前端模

式和后端模式)调整为本基金的A类份额,基金简称“华宝中证100指数”变更为“华宝中证100ETF联接A”,基金代码不变;华宝中证100指数证券投资基金原有的C类基金份额调整为本基金的C类份额,基金简称“华宝中证100指数C”变更为“华宝中证100ETF联接C”,基金代码不变。

二、转型变更后的基金托管费率、C类基金份额销售服务费率、基金申购费率和赎回费率调整

根据《基金合同》及《关于华宝中证100指数证券投资基金基金合同修改有关事项的议案》的相关约定,本基金采取ETF联接基金模式进行运作的,相关费率调整为:

1、基金托管费率

基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。

2、销售服务费率

C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.30%的年费率计提。

3、申购费率

本基金A类基金份额提供两种申购费用的支付模式。本基金A类基金份额在申购时收取的申购费用称为前端申购费用,在赎回时收取的申购费用称为后端申购费用。基金投资者可以选择支付本基金A类基金份额前端申购费用或后端申购费用。

本基金A类基金份额前端申购费率最高不高于0.80%,后端申购费率最高不高于1.4%,如下表所示:

A类基金份额前端收费:

申购金额(单位:元)	申购费率
100万以下	0.80%
大于等于100万,小于200万	0.50%
200万(含)以上	1000元/笔

A类基金份额后端收费:

申购金额 (单位:元)	申购费率							
	1年以内	1年(含)-2年	2年(含)-3年	3年(含)-4年	4年(含)-5年	5年(含)-6年	6年(含)-7年	7年(含)以上
500万(含)以上	1000元/笔	500元/笔	0	0	0	0	0	0

大于等于 200 万, 小于 500 万	0.80%	0.60%	0.40%	0.20%	0	0	0	0
大于等于 100 万, 小于 200 万	1.00%	0.80%	0.60%	0.40%	0.20%	0	0	0
大于等于 50 万, 小于 100 万	1.20%	1.00%	0.80%	0.60%	0.40%	0.20%	0	0
50 万以下	1.40%	1.20%	1.00%	0.80%	0.60%	0.40%	0.20%	0

注：后端申购费在投资者赎回时收取，投资者按照赎回份额所对应的持有时间和申购该份额对应的单笔申购总金额所对应的费率档次缴纳后端申购费。

本基金的 C 类基金份额不收取申购费。

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

4、赎回费率

本基金 A 类基金份额赎回费率表如下：

持有 A 类基金份额期限	赎回费率 (%)
7 日以内	1.50%
7 日（含 7 日）-30 日	0.50%
30 日以上	0

本基金 A 类基金份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对于收取的持续持有期少于 7 日的投资人的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期大于等于 7 日的投资人的赎回费，基金管理人将不低于其总额的 25% 计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有 C 类基金份额期限	赎回费率 (%)
小于 7 日	1.50%
大于等于 7 日	0%

对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

三、修订后的《华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》和《华宝中证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》自 2022 年 10 月 10 日起生效。

四、重要提示

1、本次《基金合同》的修订系根据《基金合同》约定转型变更为 ETF 联接基金而作出，属于《基金合同》约定的不需召开基金份额持有人大会的事项，其余修改对原有基金份额持有人的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后修改，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

2、本公司于公告当日在网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要。

3、本公告仅对华宝中证 100 指数证券投资基金转型及对应费率调整等有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，可登录本公司网站（www.fsfund.com）查阅本基金基金合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件，以及相关业务公告。

4、投资者可访问本公司网站(www.fsfund.com)或拨打公司客户服务电话(400-700-5588、400-820-5050 或 021-38924558) 咨询相关情况。

特此公告。

华宝基金管理有限公司
2022 年 9 月 30 日

附件：《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》修改如下：

原基金合同涉及修改章节	原表述	修订后表述
封面	华宝中证100指数证券投资基金基金合同	华宝中证100 <u>交易型开放式</u> 指数证券投资基金 <u>联接基金基金合同</u> （由华宝中证100指数证券投资基金变更而来）
全文	华宝中证100指数证券投资基金	华宝中证100 <u>交易型开放式</u> 指数证券投资基金 <u>联接基金</u> 删除“募集”、“认购”、“发售”及类似表述
一、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》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）、《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）华宝中证100指数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</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《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性规定》”）、《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联接基金运作指引第2号——基金中基金指引》</u>和其他有关法律、法规。</p> <p>（三）<u>华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>由华宝中证100指数证券投资基金变更而来，华宝中证100指数证券投资基金由基金</p>

	<p>督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。</p> <p>中国证监会对本基金募集的核准,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。</p> <p>(五)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、成份券停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书。</p>	<p>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”)核准。</p> <p>中国证监会对华宝中证100指数证券投资基金募集的核准及其变更为本基金的备案,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。</p> <p>(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、成份券停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书。</p>
<p>二、 释义</p>	<p>1. 基金或本基金:指华宝中证100指数证券投资基金</p> <p>8. 基金份额发售公告:指《华宝兴业中证100指数证券投资基金份额发售公告》</p> <p>35. 基金合同生效日:指基金募集期限届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售时,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>37. 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</p> <p>38. 存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p> <p>45. 认购:指在基金募集期内,投资人申请购买基金份额的行为</p>	<p>1. 基金或本基金:指华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金,由华宝中证100指数证券投资基金变更而来</p> <p>37. 基金合同生效日:指《华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效日,原《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》同日起失效</p> <p>39. 存续期:指《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》生效至《华宝中证100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</p> <p>58. 基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、目标ETF基金份额、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p>

	<p>58. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>...</p>	<p>...</p> <p>新增：</p> <p>15. 目标ETF：指另一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“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。本基金以华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF</p> <p>16. ETF联接基金：指将绝大多数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</p> <p>17. 标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证100指数及其未来可能发生的变更</p>
<p>三、基金的基本情况</p>	<p>（二）基金的类别 股票型证券投资基金</p> <p>（四）基金的投资目标 本基金通过指数化投资，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%、年跟踪误差不超过4%，实现对中证100指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>（五）基金的最低募集份额总额和金额 基金募集份额总额不少手2亿份，基金募集金额不少手2亿元。</p> <p>（六）基金份额面值和认购费用 基金份额的初始面值为人民币1.00元。</p> <p>本基金的认购费率最高不超过5%，具体费率情况由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。</p>	<p>（二）基金的类别 ETF 联接基金</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> <p>新增：</p> <p>（七）标的指数 本基金的标的指数为中证100指数。</p> <p>（八）目标ETF 本基金的目标ETF为华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>（九）本基金与目标ETF的联系与区别 本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：</p>

		<p>1. 在投资方法方面，目标ETF采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；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，实现对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>2. 在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，申赎目标ETF；而本基金则与其他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，持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。</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>四、基金的历史沿革</p>	<p>四、基金份额的发售与认购</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>四、基金的历史沿革</p> <p>华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金由华宝中证100指数证券投资基金变更而来。</p> <p>华宝中证100指数证券投资基金经中国证监会《关于核准华宝兴业中证100指数证券投资基金</p>

2. 发售方式

通过基金销售网点和基金网上交易系统公开发售。

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和机构投资者以及合格境外机构投资者。

(二) 基金份额的认购

1. 认购费用

本基金提供两种认购费用的支付模式。本基金在认购时收取的认购费用称为前端认购费用，在赎回时收取的认购费用称为后端认购费用。基金投资者可以选择支付前端认购费用或后端认购费用。本基金以认购金额为基数采用比例费率计算前端认购费用。本基金以认购金额为基数，并根据基金持有时间采用比例费率计算后端认购费用。认购费率不得超过认购金额的5%。本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

2. 募集期利息的处理方式

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，其中利息以注册登记机构的记录为准。

3. 基金认购份额的计算

基金认购采用金额认购的方式。计算公式为：

(1) 若投资者选择缴纳前端认购费用，基金的认购金额包括认购费用和净认购

募集的批复》（证监许可【2009】754号）核准募集。

华宝中证100指数证券投资基金基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》于2009年9月29日正式生效。

2022年7月21日，基金管理人管理的华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金成立。根据《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》的约定，“若将来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》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。”

基金管理人经与基金托管人协商一致并向中国证监会备案后，决定将华宝中证100指数证券投资基金变更为华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》。自2022年10月10日起，《华宝中证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

金额。则认购份额的计算公式为：

$$\text{净认购金额} = \frac{\text{认购金额}}{1 + \text{前端认购费率}}$$
$$\text{前端认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$
$$\text{认购份额} = \frac{(\text{净认购金额} + \text{认购利息})}{\text{基金初始份额面值}}$$

(2) 若投资者选择缴纳后端认购费用，则认购份额的计算公式为：

$$\text{认购份额} = \frac{(\text{认购金额} + \text{认购利息})}{\text{基金初始份额面值}}$$

当投资者提出赎回时，后端认购费用的计算方法为：

$$\text{后端认购费用} = \text{赎回份额} \times \text{基金初始份额面值} \times \text{后端认购费率}$$

4. 认购份额余额的处理方式

认购费用、净认购金额、认购金额产生的利息按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。认购份额的计算结果保留小数点后两位，两位以后舍去，舍去部分所代表的资产归基金财产所有。

(三) 基金份额认购原则

1. 投资人认购前，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2. 投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

3. 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。

4. 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

	<p>制和处理方法请参看招募说明书。</p> <p>5、投资人认购前，应认真阅读相应基金公司及销售机构的业务规则，一旦选择在某销售机构提出认购申请，即视为投资人已完全阅读、理解并认可该基金公司及其销售机构的业务规则，并接受该规则的约束。</p>	
<p>五、基金的存续</p>	<p><u>五、基金备案</u></p> <p><u>(一)基金备案和基金合同生效</u></p> <p>1. 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，并且基金份额持有人的人数不少于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决定停止基金发售，且基金募集达到基金备案条件，基金管理人应当自基金募集结束之日起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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。</p> <p>2. 基金管理人应当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。</p> <p>3. 本基金合同生效前，投资人的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在募集期形成的利息在本基金合同生效后折成投资人认购的基金份额，归投资人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。</p> <p><u>(二)基金募集失败</u></p> <p>1. 基金募集期届满，未达到基金备</p>	<p><u>五、基金的存续</u></p> <p><u>(一)基金份额的变更登记</u></p> <p>基金合同生效后，本基金注册登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要信息的变更。</p> <p><u>(二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</u></p> <p>《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应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。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>

	<p>案条件，则基金募集失败。</p> <p>2. 如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期届满后30日内返还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。</p> <p>3. 如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销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金数额</p> <p>基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。</p>	
<p>六、基金份额的申购与赎回、转换、非交易过户与转托管</p>	<p>(七)拒绝或暂停申购的情形</p> <p>6. 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%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>除第4、6、7项外，发生上述暂停申</p>	<p>(七)拒绝或暂停申购的情形</p> <p>6. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>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。</p> <p>8. 目标ETF暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。</p> <p>除第4、9项外，发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊</p>

	<p>购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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>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>增加：</p> <p><u>(八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</u></p> <p><u>5. 目标ETF暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u></p> <p><u>6. 目标ETF暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回或延缓支付赎回款项的情形。</u></p>
<p>七、基金合同当事人及权利义务</p>	<p>(五) 基金管理人的义务</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：</p> <p>1. 依法募集基金，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>(五) 基金管理人的义务</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：</p> <p>1. 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；</p> <p>新增：</p> <p>(八) 基金份额持有人的权利</p> <p>根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：</p> <p><u>9. 按照本基金合同的约定出席或者委派代表出席目标ETF基金份额持有人大会并对目标ETF基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</u></p>
<p>八、基金份额持有人大会</p>	<p>(二) 召开事由</p> <p>2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，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</p>	<p>(二) 召开事由</p> <p>2. 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p><u>(3) 由于目标ETF变更标的指数、变更交易方式、终止上市或基金合同终止而变更基金投资</u></p>

	<p>(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》；</p>	<p><u>目标、范围或策略：</u></p> <p><u>新增：</u></p> <p><u>鉴于本基金和目标ETF的相关性，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金的基金份额直接出席目标ETF的基金份额持有人大会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。在计算参会基金份额和表决票数时，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></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，但可接受本基金的基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会。</u></p>
十二、基金的投资	<p>(一) 投资目标</p> <p>本基金通过指数化投资，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之</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</u></p>

间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%、年跟踪误差不超过4%，实现对中证100指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。

（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，包括中证100指数的成份股及其备选成份股、新股（首次公开发行或增发）、存托凭证、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。

...

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为90%—95%，投资于中证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%—10%（其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%）。

（三）投资策略

本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

1. 标的指数

——本基金股票资产跟踪的标的指

化。

（二）投资范围

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股、新股（首次公开发行或增发）、存托凭证、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。

...

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%；本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（三）投资策略

本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

1. 资产配置策略

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%；本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。为更好地实现投资目标，基金还

数为中证100指数。中证100指数是由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本股是由沪深300指数样本股中挑选总市值最大的100只股票组成，具有良好的市场代表性和可投资性，综合的反映了沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。

2. 股票资产指数化投资策略

本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选同行业的股票进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

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。

3. 股票指数化投资日常投资组合管理

（1）标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带

可投资于非成份股、债券、存托凭证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。

本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

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。

2. 目标ETF投资策略

（1）投资组合的投资方式

本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标ETF基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标ETF基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标ETF的投资方式。通常情况下，本基金以申购和赎回为主：当收到净申购时，本基金构建股票组合、申购目标ETF；当收到净赎回时，本基金赎回目标ETF、卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续实物申购目标ETF的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

（2）投资组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3. 股票投资策略

来的跟踪偏离度和跟踪误差。

——(2) 成份股公司信息的日常跟踪与分析

——跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

——(3) 标的指数成份股票临时调整

——在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

——(4) 申购赎回情况的跟踪与分析

——跟踪本基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

——(5) 跟踪偏离度的监控与管理

——每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

(四) 业绩比较基准

本基金的标的指数为中证100指数，同时考虑股票资产占基金资产的比例为90%-95%，现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理，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。基金管理人也可适度投资其他非成份股以增强基金收益。

(四) 业绩比较基准

本基金为目标ETF的联接基金，与目标ETF

~~资产的比例为5%—10%，因此本基金设定上述业绩比较基准。~~

~~(五) 风险收益特征~~

~~本基金为股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。~~

~~(六) 投资限制~~

~~1. 组合限制~~

~~本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：~~

~~(3) 本基金股票、债券的投资比例范围为：股票资产占基金资产的比例为90%—95%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%—10%；~~

~~(4) 本基金投资于中证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；~~

~~...~~

~~除第(7)、(9)、(10)、(11)项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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。~~

具有相似的投资目标，标的指数为中证100指数，同时考虑投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，因此本基金设定上述业绩比较基准。

(五) 风险收益特征

本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型指数基金，本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，并且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。

(六) 投资限制

1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(3) 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%；

...

...

因证券市场波动、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第(3)项规定投资比例的，基金管理人应当

...

2. 禁止行为

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

...

（九）未来条件许可情况下的基金模式转换

若将来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》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。

在20个交易日内进行调整。除第（3）、（6）、（8）、（9）、（10）项外，因证券市场波动、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。

...

2. 禁止行为

(4) 买卖除目标ETF以外的其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

...

（九）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，则基金管理人将本着维护投资者合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中删除关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。

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与其他基金合并；

		<p>6. <u>中国证监会规定的其他情形。</u></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>
<p>十三、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拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。</p>	<p>(一) 基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、<u>目标ETF基金份额</u>、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。</p>
<p>十四、基金资产估值</p>	<p>(三) 估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。</p> <p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>3. <u>占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；</u></p> <p>(八) 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7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>(三) 估值对象</p> <p>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、其它投资等资产。</p> <p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>3. <u>基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</u></p> <p>(八) 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8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>新增：</p> <p>(二) 估值方法</p> <p>1、<u>目标ETF份额的估值</u></p> <p><u>本基金投资的目标ETF份额以目标ETF估值日基金份额净值估值，若当日无目标ETF基金份额净值的，以目标ETF最近公布的基金份额净值估值。</u></p>

(一) 基金费用的种类

4. 基金合同生效后的指数许可使用费；—

(三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：—

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。—

若将来基金管理人根据本基金合同“十二、基金的投资”之“(九)未来条件许可情况下的基金模式转换”使本基金采取ETF联接基金模式进行运作的，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。—

计算方法如下：—

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

3. C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，—

C类基金份额的销售服务费年费率为

(一) 基金费用的种类

9. 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、申购赎回费用等）；

(三) 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的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX}(E \times 0.5\% \div \text{当年天数}, 0)$$

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前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值

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的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX}(E \times 0.1\% \div \text{当年天数}, 0)$$

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前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值

3. C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类

0.40%。

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.40%的年费率计提。若将来基金管理人根据本基金合同“十二、基金的投资”之“(九)未来条件许可情况下的基金模式转换”使本基金采取ETF联接基金模式进行运作的，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.30%的年费率计提。

4. 基金合同生效后的指数许可使用费
指数许可使用费是指数许可使用基点费，指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算；基金合同生效当年，不足3个月的，按照3个月收费。指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的0.02%/年，许可使用基点费的收取下限为每季人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取）。
在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% / \text{当年天数}$$

H为每日应付的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，基金管理人应于每年1月，4月，7月，10月的最后一个工作日前，按照双方确认的金额向中证指数有限公司支付上一季度的指数许可使用基点费。

基金份额基金资产净值的0.30%的年费率计提。

4. 除管理费、托管费和C类基金份额的销售服务

	<p>5. 除管理费、托管费—C类基金份额的销售服务费和指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</p> <p>(四) 不列入基金费用的项目</p> <p>...基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。</p>	<p>费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</p> <p>(四) 不列入基金费用的项目</p> <p>...基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用按当时有效的《华宝中证100指数证券投资基金基金合同》的约定执行。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不从基金财产中列支。</p>
<p>十八、基金的信息披露</p>	<p>(一) 招募说明书</p> <p>招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。</p> <p>基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。</p> <p>(二) 基金合同、托管协议</p> <p>基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上。</p> <p>(四) 基金份额发售公告</p> <p>基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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报刊和网站上。</p> <p>(五) 基金合同生效公告</p> <p>基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。</p>	

	<p>(八)基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告</p> <p>4. 基金合同生效不足2个月的，本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。</p> <p>(九)临时报告与公告</p> <p>8. 基金募集期延长或提前结束募集；</p>	<p>(七)临时报告与公告</p> <p>21. 本基金变更目标ETF；</p> <p>(十三)基金投资目标ETF的信息披露</p> <p>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：</p> <p>1. 投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；</p> <p>2. 交易及持有目标ETF产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、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；</p> <p>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。</p>
<p>十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>(一) 基金合同的变更</p> <p>但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：</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》；</p>	<p>(一)基金合同的变更</p> <p>但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：</p> <p>(3) 由于目标ETF变更标的指数、变更交易方式、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略；</p>

<p>二十二、 基金 合同 的效 力</p>	<p>(一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>	<p>(一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，于2022年10月10日生效。原《<u>华宝中证100指数证券投资基金基金合同</u>》自同日起失效。基金合同的有效期限自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>
--	---	--