

附件四：《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》的说明

华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)于 2017 年 4 月 11 日成立，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》。本次华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更事宜属于实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

本次华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更方案需经参加会议的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过，因此变更方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人，本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额须占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。中国证监会对本次华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次修改方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

具体方案如下：

一、方案要点

（一）更名

基金名称由“华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）”更名为“华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

（二）变更后基金的基本情况

- 1、基金的名称：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。
- 2、基金的类别：股票型证券投资基金、ETF 联接基金。
- 3、目标 ETF：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金，已于 2016 年 6 月 30 日成立，2016 年 7 月 22 日于深圳证券交易所上市交易。
- 4、标的指数：创业板 50 指数。
- 5、基金的运作方式：契约型开放式。
- 6、基金的投资目标：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。
- 7、基金存续期限：不定期。

（三）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等投资相关

1、投资目标

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。

2、投资范围

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及其备选成份股，把接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、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、银行存款、股指期货、权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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当

程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

3、投资策略

本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。

本基金通过把接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和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。正常情况下，本基金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%。如因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上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(1) 资产配置策略

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。投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、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、银行存款、股指期货、权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（但须符合中国证监会相关规定），其目的是为了更使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

(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购、赎回目标 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。

（3）股票投资策略

根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。

（4）债券投资策略

本基金将通过自上而下的宏观分析，结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。

（5）股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。

（6）权证投资策略

本基金在实现权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，谨慎地进行投资，以追求较为稳定的收益。

（7）资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

(8) 参与融资业务的投资策略

本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

4、投资限制

(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%；

(2) 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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持

证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：本基金在任何交易日日终，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，有价证券指目标 ETF、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；本基金在任何交易日日终，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%；本基金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%；基金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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(14) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(15) 本基金参与融资时遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(16) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外

的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(18)基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(1)、(2)、(10)、(17)、(18)项外，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、目标ETF申购、赎回、交易被暂停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。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(1)项规定的比例，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，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本基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

5、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $95\% \times$ 创业板50指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行税后活期存款利率。

由于本基金为ETF联接基金，投资组合中本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，并且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。因此，设定本基金的业绩比较基准为“ $95\% \times$ 创业板50指数收益率 $+5\% \times$ 商业银行税后活期

存款利率”，该基准能较为客观的衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。其中，若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若业绩比较基准的变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），经基金管理人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在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。

6、风险收益特征

本基金属于目标 ETF 的联接基金，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高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。

（四）变更后的基金资产估值方法

1、目标 ETF 份额的估值

本基金投资的目标 ETF 份额以估值日目标 ETF 的基金份额净值估值，若估值日目标 ETF 未公布净值，以其最近估值日的基金份额净值估值。如果基金管理人认为按上述价格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协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。

2、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及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。

3、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、交易所市场交易的固定收益品种（指在上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、资产支持证券、同业存单等债券品种，下同）的估值：

(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；

(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

5、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种

当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、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。

9、当发生大额申购或赎回时，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。

10、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。

（五）变更后基金的费率水平

1、年化管理费率：0.5%（本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费）。

2、年化托管费率：0.1%（本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费）。

3、申购费率

本基金申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

除养老金客户外，其他投资人申购本基金的申购费率如下表所示：

单笔申购金额（M）	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<300万	0.8%
300万≤M<500万	0.4%

M≥500万	每笔1000元
--------	---------

通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户申购费率为 500 元/笔。

4、赎回费率

本基金的赎回费率按持有期递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产，对持续持有期不少于 7 日的投资人收取的赎回费，不低于赎回费总额的 25%归基金财产。具体费率如下：

持有期限 (Y)	赎回费率
Y<7天	1.50%
7天≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
2年≤Y	0

注：1 年为 365 天，2 年为 730 天。

基金份额持有人在基金终止上市前持有的原华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）份额，持有期限不受影响持续计算。

（六）变更后基金的收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在按照监管部门要求

履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

（七）授权基金管理人修订基金合同

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的产品特征修订基金合同的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订基金合同。

（八）关于基金转型安排

本次持有人大会决议生效后，本基金将在转型正式实施前安排不少于二十个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回或者卖出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。选择期期间，本基金将开放场内赎回和场外赎回等业务。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）份额将于新基金合同生效后转换为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额。选择期内，本基金豁免《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》约定的投资组合比例、投资策略等约定。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。

选择期内，本基金豁免遵守基金合同中关于基金投资目标、投资组合比例等的相关规定。对于申请赎回的投资者，除持有期限不满 7 日收取 1.5% 的赎回费并全额归入基金财产外，不收取赎回费。

本基金转型为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金后，将进入封闭期，封闭期不超过三个月，在封闭期最后一个工作日，基金份额持有人所持有的基金份额在其资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.0000 元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。具体份额折算方案请见基金管理人届时发布的公告。

原本基金的场内基金份额将由中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登

记系统统一变更登记至中国证券登记结算有限责任公司登记结算系统。原本基金场内份额的基金份额持有人需要对其持有的基金份额进行重新确认与登记(即确权登记),办理确权登记后,方可通过相关销售机构办理华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的赎回等业务。办理确权登记的具体时间和相关业务规则请见基金管理人届时发布的公告。

(九)《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的生效

依据基金份额持有人大会决议,基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市,自基金终止上市之日起,原《华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效,《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自同一日起生效。

综上所述,基金管理人拟提请基金份额持有人大会,授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)转型并修改基金合同等相关事项的议案》的方案要点修订基金合同并实施转型方案。

二、基金管理人就方案相关事项的说明

1、华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)基本情况

华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)遵照《中华人民共和国证券投资基金法》于 2017 年 4 月 11 日成立,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,基金募集规模达 309,484,316.78 份基金份额,已顺利运作至今。

2、基金管理人将严格保证基金合同修订的合法合规

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同已经基金管理人和基金托管人签字盖章,并已经中国证监会变更注册。

3、关于本次基金份额持有人大会费用的说明

根据《华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本次基金份额持有人大会费用以及律师费等相关费用可从基金资产列支。

三、转型方案的可行性

1、法律可行性

在《基金法》第八十三条到第八十六条对基金持有大会的召集人、召开形式以及其相关事宜都作了规定与说明，这为基金持有大会的召开流程提供了法律依据。

本次基金份额持有人大会决议属于一般决议，经参加大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过，决议即可生效。

因此，基金转型方案不存在法律方面的障碍。

2、技术可行性

为了保障华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）持有人大会的顺利召开，基金管理人成立了工作小组，筹备、执行份额持有人大会相关事宜。基金管理人与基金托管人、律师事务所、公证机关、投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。

本基金的基金管理人、基金托管人已就本次转型方案进行了充分沟通和细致准备，技术可行。

因此，转型方案不存在运营技术层面的障碍。

四、转型方案的主要风险及预备措施

本次基金转型的主要风险是议案被持有人大会否决的风险。

在设计转型并确定具体方案之前，基金管理人已同基金份额持有人进行了沟通，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

若本次基金份额持有人大会表决通过本基金的转型事宜，则基金管理人将在转型实施前预留不少于二十个开放日供持有人选择赎回或转出。特别提请投资人关注本基金转型的风险，包括但不限于运作方式的转变等。

如果转型方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照

有关规定重新向持有人大会提交转型并修改基金合同等相关事项的议案。

附件：《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》（“《基金合同》”）与《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（“《基金合同》（修订）”）修改前后对照表

章节	《基金合同》	《基金合同(修订)》
全文修改基金名称	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
第一部分 前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《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》”)和其他有关法律、法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《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》”)和其他有关

		法律法规。
第一部分 前言	<p>三、华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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申请的注册，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。</p>	<p>三、华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来，华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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，变更后的华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金已经中国证监会变更注册。</p> <p>中国证监会对华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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>
第二部分 释义	<p>1、基金或本基金：指华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）</p> <p>7、基金份额发售公告：指《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》</p>	<p>1、基金或本基金：指华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，本基金由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来</p> <p>删除 7。</p>

		<p>增加：</p> <p>7、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（以下亦简称“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。本基金选择华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“创业板 50ETF”）为目标 ETF</p> <p>14、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p> <p>15、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人</p>
--	--	---

	<p>15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会</p> <p>22、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</p> <p>23、销售机构：指华安基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所办理基金销售业务的会员单位</p> <p>26、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户</p> <p>27、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民</p>	<p>利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</p> <p>17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会</p> <p>24、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</p> <p>25、销售机构：指华安基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构</p> <p>28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户</p> <p>删除 27。</p>
--	--	--

	<p>币普通股票账户（即 A 股账户） 或证券投资基金账户</p> <p>28、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</p> <p>29、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</p> <p>31、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、《业务规则》：指本基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订</p> <p>39、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</p> <p>42、上市交易：指基金投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行</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申购、赎回、转换及转托管、定期定额等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>30、基金合同生效日：指《华安创业板 50 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《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日终止</p> <p>删除 31。</p> <p>38、《业务规则》：指本基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订</p> <p>删除 39。</p> <p>删除 42。</p>
--	--	--

	<p>为</p> <p>43、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回</p> <p>44、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回</p> <p>46、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管及跨系统转托管</p> <p>47、系统内转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为</p> <p>48、跨系统转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管</p>	<p>删除 43。</p> <p>删除 44。</p> <p>42、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作</p> <p>删除 47。</p> <p>删除 48。</p>
--	--	---

	<p>的行为</p> <p>49、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统</p> <p>50、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统</p> <p>55、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</p> <p>59、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p>	<p>删除 49。</p> <p>删除 50。</p> <p>47、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</p> <p>删除 59。</p>
第三部分 基金的基本情况	<p>二、基金的类别</p> <p>股票型证券投资基金</p> <p>四、上市交易所</p> <p>深圳证券交易所</p>	<p>二、基金的类别</p> <p>股票型证券投资基金、ETF 联接基金</p> <p>删除。</p>

	<p>五、基金的投资目标</p> <p>本基金通过被动的指数化投资管理，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>六、基金的最低募集份额总额</p> <p>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</p> <p>本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金认购费率按招募说明书的规定执行。</p>	<p>四、基金的投资目标</p> <p>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>本基金的目标 ETF 为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>删除。</p> <p>删除。</p> <p>增加：</p> <p>六、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为创业板 50 指数。</p> <p>如果未来目标 ETF 的标的指数发生变更，本基金不变更目标 ETF，且本基金的标的指数将随之变更，不需另行召开基金份额持有人大会。</p> <p>七、本基金与目标 ETF 的联系与区别</p>
--	--	---

		<p>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、在基金的投资方法方面，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，申购、赎回目标 ETF；而本基金可以与普通的开放式基金一样，通过基金管理人及其他销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回，但不可以在交易所市场买卖。</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、投资比例要求。目标 ETF 作为一种特殊的基金品种，可将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，仍需保留不低于基金资产净值 5%的现金或者到期</p>
--	--	---

		<p>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 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，采取实物申赎方式进行的申购、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购、赎回的方式，大额申购、赎回可能会对基金净值产生一定冲击。</p>
第四部分 基金的历史沿革	<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>本基金将以场内和场外两种方式公开发售。</p> <p>场内发售是指本基金募集期结束前获得基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位发售基金份额的行为。</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革</p> <p>一、本基金的历史沿革</p> <p>华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来。</p> <p>华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）经中国证监会 2016 年 8 月 22 日《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可【2016】1901 号文）注册，基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。</p> <p>华安中证定向增发事件指数证券</p>

	<p>场外发售是指通过基金销售机构（包括直销机构及其他场外销售机构）通过场外公开发售基金份额的行为。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>场外发售的基金份额可在办理跨系统转托管业务后，在深交所上市交易，跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。</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、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>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。</p> <p>2、募集期利息的处理方式</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>3、基金认购份额的计算</p>	<p>投资基金（LOF）自 2017 年 2 月 20 日至 2017 年 3 月 31 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，《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 4 月 11 日起正式生效。</p> <p>经中国证监会 2018 年 8 月 14 日《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更注册的批复》，华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）就基金转型事宜进行变更注册。</p> <p>华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）自 2018 年 9 月 10 日至 2018 年 10 月 8 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型及修改基金合同等相关事项的议案，内容包括华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更标的指数、基金类别、申购赎回规则、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、收益分配原则、费率水平、估值方法以及修订基金合同等，</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>4、认购份额余额的处理方式</p> <p>本基金场外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。场内认购份额按整数申报。</p> <p>5、认购申请的确认</p> <p>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。</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、投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申</p>	<p>并同意将转型后的基金更名为“华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。</p> <p>依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》失效，《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效。</p> <p>二、基金份额的变更登记</p> <p>基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。</p>
--	--	---

	请不允许撤销。	
第五部分 基金的 存续	<p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件</p> <p>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。</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>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金</p>	<p>第五部分 基金的存续</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 万元人民币情形的，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，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>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>

	<p>备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</p> <p>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>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	
	第六部分 基金份额的上市交易	删除。

	<p>一、基金上市</p> <p>1、上市交易的地点</p> <p>深圳证券交易所。</p> <p>2、上市交易的时间</p> <p>基金管理人于本基金合同生效后三个月内申请基金份额在深圳证券交易所上市交易。</p> <p>3、基金上市条件</p> <p>基金合同生效后具备下列条件，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请上市：</p> <p>（1）基金募集金额不低于 2 亿元；</p> <p>（2）基金份额持有人不少于 1000 人；</p> <p>（3）《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。</p> <p>4、上市交易公告</p> <p>基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。</p> <p>基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。</p> <p>二、基金份额的上市交易</p> <p>本基金基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《深圳证券</p>	
--	---	--

	<p>交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。</p> <p>三、上市交易的规则</p> <p>本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定，包括但不限于：</p> <p>1、本基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值；</p> <p>2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；</p> <p>3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；</p> <p>4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；</p> <p>四、上市交易的费用</p> <p>本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。</p> <p>五、上市交易的行情揭示</p> <p>本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一工作日的基金份额净值。</p> <p>六、上市交易的停复牌、暂停上</p>	
--	--	--

	<p>市、恢复上市和终止上市</p> <p>基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照法律法规及深圳证券交易所的相关业务规则执行。</p> <p>七、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>八、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能,基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。</p>	
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及基金场外销售机构的销售网点,场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。销售机构的具体信息将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及销售机构的销售网点。销售机构的具体信息将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p>

	<p>务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p> <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>3、基金投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行；</p> <p>5、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>6、投资人通过场外申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的深圳开放式基金账户，通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的证券账户（人民币普通股票账户和证券投资基金账户）。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p>	<p>三、申购与赎回的原则删除。</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>5、投资人申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金账户。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p>
--	--	---

	<p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停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。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认</p>	<p>投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。如遇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，则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停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。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认</p>
--	---	--

	<p>情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>4、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。</p> <p>5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份</p>	<p>情况。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。</p> <p>五、申购和赎回的数量限制删除。</p> <p>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人可以采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份</p>
--	---	--

	<p>额净值，有效份额单位为份。场内申购份额先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再采用截位方式，保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还投资者。场外申购份额计算结果按四舍五入方法，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>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，并在招募说明书中列示，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，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>4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据相关规定按照比例</p>	<p>份额净值，有效份额单位为份。申购份额计算结果按四舍五入方法，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>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，并在招募说明书中列示，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日的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>4、申购费用由申购基金份额的投资人承担，不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例应根</p>
--	--	--

	<p>归入基金财产，其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额归入基金财产，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费，具体约定详见招募说明书。</p> <p>7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p>	<p>据相关规定执行，并在招募说明书中列示。</p> <p>7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和赎回费率。</p> <p>增加：</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。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、自律组织的规定。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>增加：</p> <p>6、目标 ETF 暂停申购或目标 ETF 二级市场交易停牌；</p> <p>7、目标 ETF 暂停基金资产估值；</p>
--	--	---

	<p>6、基金销售机构或登记机构的技术保障等发生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、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的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形；</p> <p>8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 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指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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>8、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的技术故障等发生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>9、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、单个投资者单日或单笔申购金额上限的；</p> <p>10、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购申请；</p> <p>发生上述除第 4、9 项外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指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝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>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，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。对于场内赎回申请，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。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>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>增加：</p> <p>5、目标 ETF 暂停赎回或目标 ETF 二级市场交易停牌；</p> <p>6、目标 ETF 暂停基金资产估值；</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，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>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管</p>
--	--	--

	<p>理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>.....</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自</p>	<p>理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。</p> <p>.....</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动</p>
--	--	---

	<p>动延期赎回处理。</p> <p>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理，具体见招募说明书或相关公告。</p> <p>4、场内巨额赎回的处理方式按照中国证券登记结算有限公司有关业务规则执行。</p>	<p>延期赎回处理。</p> <p>若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请按部分延期赎回条款处理，即基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。具体见招募说明书或相关公告。</p> <p>删除。</p>
--	---	--

	<p>十三、基金的转托管</p> <p>本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或通过跨系统转托管从场内转入的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购、上市交易买入或通过跨系统转托管从场外转入的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人证券账户下。登记在证券登记系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在登记结算系统中的基金份额可申请场外赎回。</p> <p>本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。</p> <p>1、系统内转托管</p> <p>（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。本基金在募集期内不得办理系统内转托管。</p> <p>（2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构(网点)时，须办理已持有基金份额的系</p>	<p>十三、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的标准收取转托管费。具体办理方法参照中国证券登记结算有限责任公司以及基金销售机构的有关规定。</p>
--	--	---

	<p>统内转托管。</p> <p>(3)基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位(交易单元)时,须办理已持有基金份额的系统内转托管。</p> <p>具体办理方法参照深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司以及基金代销机构的有关规定。</p> <p>2、跨系统转托管</p> <p>(1)跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为。</p> <p>(2)本基金处于募集期内、权益分派期间或处于质押、冻结状态时,不得办理跨系统转托管。</p> <p>(3)本基金跨系统转托管的具体业务按照深证证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。</p> <p>十五、基金份额的冻结和解冻</p> <p>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与</p>	<p>十五、基金份额的冻结、解冻和质押</p> <p>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与</p>
--	---	---

	<p>解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。</p>	<p>解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或监管部门另有规定的除外。</p> <p>如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。</p> <p>增加： 十七、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</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>(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；</p> <p>(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；</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>(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；</p> <p>(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；</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、转托管、定期定额投资等方面的业务规则, 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高管理费和托管费率之外的相关费率结构和收费方式;</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资产净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;</p> <p>(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>(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、转托管、定期定额投资等方面的业务规则, 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除管理费和托管费率之外的相关费率结构和收费方式;</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资产净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;</p> <p>(24) 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;</p>
--	--	---

	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国建设银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区金融大街 25 号</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立时间：2004 年 09 月 17 日</p> <p>批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】143 号</p> <p>组织形式：股份有限公司</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>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】12 号</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>(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)</p> <p>住所：北京市西城区金融大街 25 号</p> <p>办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼</p> <p>法定代表人：田国立</p> <p>成立时间：2004 年 09 月 17 日</p> <p>组织形式：股份有限公司</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>存续期间：持续经营</p> <p>基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号</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>(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p>
--	---	--

	<p>三、基金份额持有人</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>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>（4）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；</p>	<p>三、基金份额持有人</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>增加：</p> <p>（6）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，对目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</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>（4）缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</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>本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。</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>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金投资的目标 ETF 拟召开基金份额持有人大会时，本基金需提前召开基金份额持有人大会，就目标 ETF 的基金份额持有</p>

		<p>人大会拟表决事项征求本基金基金份额持有人的意见。本基金基金份额持有人大会应在目标 ETF 基金份额持有人大会召开之前召开并完成表决，并应当就全部表决意见进行分类统计，确定本基金基金份额持有人大会各类表决意见的具体比例（比例以百分数表示，分子四舍五入精确到小数点后两位）。本基金的基金管理人（或基金托管人）应当分别按照上述分类表决意见的具体比例参加目标 ETF 基金份额持有人大会并据此投票表决（各类表决意见代表的目标 ETF 基金份额=权益登记日本基金持有的目标 ETF 总份额×该类表决意见占比，基金份额四舍五入精确到整数位）。</p> <p>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</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>（13）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；</p> <p>2、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>会。</p> <p>本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。</p> <p>一、召开事由</p> <p>1、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、中国证监会另有规定的除外：</p> <p>（8）变更基金投资目标、范围或策略，但法律法规和中国证监会另有规定，或由于目标 ETF 基金变更标的指数、交易方式变更、终止上市或基金合同终止等情形而变更基金投资目标、范围或策略的除外；</p> <p>增加：</p> <p>（10）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；</p> <p>删除。</p> <p>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情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需</p>
--	---	--

	<p>(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；</p> <p>(4) 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情况下，增加、减少或调整基金份额类别及定义；</p> <p>(5) 因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定，发生变动而应当对《基金合同》进行修改；</p> <p>(7) 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情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、基金交易、非交易过户、定期定额投资等业务规则；</p>	<p>召开基金份额持有人大会：</p> <p>(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；</p> <p>(4) 增加、减少或调整基金份额类别及定义；</p> <p>(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；</p> <p>增加：</p> <p>(7) 由于目标 ETF 变更标的指数、交易方式变更、终止上市或基金合同终止等情形而变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>(8) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、转托管、基金交易、非交易过户、定期定额投资等业务规则；</p>
--	--	--

	<p>(8) 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情况下，本基金推出新业务或新服务；</p> <p>九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p>(9) 本基金推出新业务或新服务；</p> <p>九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p>第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p> <p>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一) 基金管理人的更换程序</p> <p>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值；</p>

	<p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>6、交接:基金托管人职责终止的,应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料,及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续,新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或者临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值;</p> <p>(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。</p> <p>1、提名:如果基金管理人和基金托管人同时更换,由单独或合计持有基金总份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人;</p>	<p>(二) 基金托管人的更换程序</p> <p>6、交接:基金托管人职责终止的,应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料,及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续,新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或者临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值;</p> <p>(三) 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>1、提名:如果基金管理人和基金托管人同时更换,由单独或合计持有基金总份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人提名新任基金管理人和基金托管人;</p>
第十二部分 基金的投资	<p>一、投资目标</p> <p>本基金通过被动的指数化投资管理,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>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证定向增发事件指数的成分股及其备选成分股、其他国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及</p>	<p>一、投资目标</p> <p>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>二、投资范围</p> <p>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,把接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现。为更好地实现投资目标,本基金可少</p>

	<p>其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、固定收益资产(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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相关规定)。</p> <p>本基金将根据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>本基金组合投资比例为:股票资产投资比例不低于基金资产的90%,投资于中证定向增发事件指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货及其他金融</p>	<p>量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、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、银行存款、股指期货、权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(但须符合中国证监会相关规定)。</p> <p>本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。</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:投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本</p>
--	--	---

	<p>工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p> <p>三、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证定向增发事件指数。</p> <p>如果中证定向增发事件指数被停止编制及发布，或中证定向增发事件指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证定向增发事件指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下，更换本基金的标的指数和投资对象；并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。若标的指数变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更</p>	<p>基金的投资范围会做相应调整。</p> <p>删除。</p>
--	--	----------------------------------

	标的指数，报中国证监会备案并及时公告。	
第十二部分 基金的投资	<p>四、投资策略</p> <p>本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现，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%。</p> <p>为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本</p>	<p>三、投资策略</p> <p>本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。</p> <p>本基金通过把接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和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。正常情况下，本基金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%。</p> <p>如因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上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>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投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、央行票据、</p>

	<p>低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。</p> <p>例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。</p> <p>基于流动性管理的需要，本基金可以投资于期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p>	<p>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、银行存款、股指期货、权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（但须符合中国证监会相关规定），其目的是为了为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>2、目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金投资目标 ETF 的方式如下：</p> <p>（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购、赎回目标 ETF。</p> <p>（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。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。</p> <p>本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据标的指数成份股的构成及权重构建股</p>
--	--	---

		<p>票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金将通过自上而下的宏观分析，结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>本基金运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特</p>
--	--	---

		<p>殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标 ETF 仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。</p> <p>6、权证投资策略</p> <p>本基金在实现权证投资时，将通过权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，谨慎地进行投资，以追求较为稳定的收益。</p> <p>7、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>8、参与融资业务的投资策略</p> <p>本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。</p> <p>参与融资业务时，本基金将力争</p>
--	--	--

		<p>利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>五、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）股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证定向增发事件指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>（2）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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>（12）基金参与股指期货交易，</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）本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>（2）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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>（12）基金参与股指期货交易，</p>

	<p>应当遵守下列要求：本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约价值不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；基金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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>（13）本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>（14）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%；本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券</p>	<p>应当遵守下列要求：本基金在任何交易日日终，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，有价证券指目标 ETF、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；本基金在任何交易日日终，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%；本基金在任何交易日内交易的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；基金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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>（13）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场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>（14）基金总资产不得超过基金</p>
--	---	--

	<p>回购到期后不得展期；</p> <p>(15) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；</p> <p>(16) 基金参与融资融券交易及转融通证券出借交易，应当遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；</p> <p>(18) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>除上述第(2)、(10)、(18)、(19)项外，因证券或期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动</p>	<p>净资产的 140%；</p> <p>(15) 本基金参与融资时遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；</p> <p>删除。</p> <p>(17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>除上述第(1)、(2)、(10)、(17)、(18)项外，因证券或期货市场波动、证券发行人合并、基金规</p>
--	---	---

	<p>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。法律法规或监管部门另有规定时，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。期间，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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</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>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 申购、赎回、交易被暂停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。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（1）项规定的比例，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，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。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>(4) 买卖除目标 ETF 基金份额以外的其他基金份额，中国证监会</p>
--	---	---

	<p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。</p> <p>六、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准：$95\% \times$中证定向增发事件指数收益率 $+ 5\% \times$ 同期银行活期存款利率（税</p>	<p>另有规定的除外；</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准：$95\% \times$创业板 50 指数收益率 $+ 5\% \times$ 商业银行税后活期存款利率。</p>
--	---	--

	<p>后)。</p> <p>由于本基金投资标的指数为中证定向增发事件指数，且保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。因此，设定本基金的业绩比较基准为“95%×中证定向增发事件指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）”，该基准能较为客观的衡量本基金的投资绩效。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。若业绩比较基准的变更对基金投资无实质性不利影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，需经基金管理人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，在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。</p>	<p>由于本基金为 ETF 联接基金，投资组合中本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，并且每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。因此，设定本基金的业绩比较基准为“95%×创业板 50 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率”，该基准能较为客观的衡量本基金的投资绩效。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。其中，若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若业绩比较基准的</p>
--	---	---

	<p>七、风险收益特征</p> <p>本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p>	<p>变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），经基金管理人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在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金属于目标ETF的联接基金，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高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。</p> <p>增加：</p> <p>七、目标ETF的变更</p> <p>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，而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，可</p>
--	---	--

		<p>选取其他合适的指数作为标的指数，并召开基金份额持有人大会进行表决。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。</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/基金托管人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人/基金托管人相同的除外）。</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>第十三部分 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。</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的目标 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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>一、估值日</p> <p>本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。</p> <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值方法</p>	<p>一、估值日</p> <p>本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。</p> <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值方法</p> <p>增加：</p> <p>1、目标 ETF 份额的估值</p> <p>本基金投资的目标 ETF 份额以估值日目标 ETF 的基金份额净值估值，若估值日目标 ETF 未公布净值，以其最近估值日的基金份额净值估值。如果基金管理人认为按上述价格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协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。</p>

	<p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(2) 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估值。</p> <p>(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价。</p> <p>(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应</p>	<p>2、证券交易所上市的权益类证券的估值</p> <p>交易所上市的权益类证券（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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及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。</p>
--	---	--

	<p>持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>（3）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。</p> <p>（4）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的</p>	<p>3、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>（3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>
--	---	--

	<p>估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p>	<p>增加：</p> <p>4、交易所市场交易的固定收益品种（指在上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、资产支持证券、同业存单等债券品种，下同）的估值：</p> <p>（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；</p> <p>（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如</p>
--	--	---

	<p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长</p>	<p>最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>5、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。</p>
--	---	--

	<p>待偿期所对应的价格进行估值。</p> <p>对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>4、存款的估值方法</p> <p>持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>5、投资证券衍生品的估值方法</p> <p>（1）从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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，确定公允价值。</p> <p>（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>（3）因持有股票而享有的配股</p>	<p>删除。</p> <p>删除。</p>
--	--	-----------------------

	<p>权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。</p> <p>（4）本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>7、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。</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，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人</p>	<p>7、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>增加：</p> <p>9、当发生大额申购或赎回时，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>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</p>
--	---	--

	<p>出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对外公布基金资产净值的计算结果对外予以公布。</p>	<p>产净值的计算结果对外予以公布。</p>
<p>第十五部分 基金资产估值</p>	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、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，决定延迟估值；</p> <p>4、如果出现属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售</p>	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、本基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</p> <p>删除。</p>

	<p>或评估基金资产时；</p> <p>5、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>七、基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。</p>	<p>4、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>七、基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。</p>
<p>第十五部分 基金费用与税收</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>3、基金的指数使用许可费；</p> <p>10、基金的上市费用及年费；</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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>删除。</p> <p>删除。</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>本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。在通常情况下，本基金的管理费按前一</p>

	<p>$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$</p> <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>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 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> <p>$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$</p> <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>3、基金的指数使用许可费</p>	<p>日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> <p>$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$</p> <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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（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：</p> <p>$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$</p> <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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</p> <p>删除。</p>
--	--	---

	<p>本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的指数使用许可费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。</p> <p>指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>如上述指数许可使用协议约定的指数使用许可费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的</p>	
--	--	--

	<p>规定在指定媒介进行公告。</p> <p>除管理费、托管费、指数使用许可费之外的基金费用，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> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用；</p>	<p>上述“一、基金费用的种类”中除基金管理费、基金托管费之外的其他费用，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。未来，如果指数公司针对联接基金收取标的指数使用许可费和数据提供费，基金管理人有权根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，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> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用根据《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》的约定执行；</p>
<p>第十六部分 基金的收益与分配</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认为现金分红；</p>

	<p>者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；</p> <p>在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>	<p>在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。</p> <p>六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>
--	--	--

<p>第十七部分 基金的会计与审计</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；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；</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>第十八部分 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，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在基金管理人网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管</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。《基金合同》生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在基金管理人网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管</p>

	<p>及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>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。</p> <p>（二）基金份额发售公告</p> <p>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>（三）《基金合同》生效公告</p> <p>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>（四）基金份额上市交易公告书</p> <p>基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定媒介上。</p> <p>（五）基金资产净值、基金份额</p>	<p>及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>基金转型经中国证监会变更注册并经基金份额持有人大会决议通过后，基金管理人应当将基金招募说明书、《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。</p> <p>删除。</p> <p>（二）《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>删除。</p> <p>（三）基金资产净值、基金份额</p>
--	---	---

	<p>净值</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过基金管理人网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p> <p>（六）基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</p>	<p>净值</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在基金份额开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个估值日的次日，通过基金管理人网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露估值日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p> <p>（四）基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。</p>
--	--	--

	<p>(七) 基金定期报告, 包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>.....</p> <p>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情形, 为保障其他投资者的权益, 基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险。中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>本基金持续运作过程中, 应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>(八) 临时报告</p> <p>7、基金募集期延长;</p> <p>26、本基金份额停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市;</p>	<p>(七) 基金定期报告, 包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告</p> <p>.....</p> <p>本基金持续运作过程中, 应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>基金运作期间, 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形, 为保障其他投资者的权益, 基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特定风险, 中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>(八) 临时报告</p> <p>删除。</p> <p>增加:</p> <p>24、本基金暂停接受申购;</p> <p>删除。</p> <p>增加:</p> <p>27、变更目标 ETF;</p>
--	--	--

	<p>28、基金推出新业务或服务；</p> <p>29、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资人赎回等重大事项时；</p> <p>（十三）参与融资和转融通证券出借交易的相关公告</p> <p>基金应在季度报告、半年度报告、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、风险及权利情况等。</p> <p>（十四）投资非公开发行股票相关公告</p> <p>基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。</p>	<p>28、本基金推出新业务或服务；</p> <p>29、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</p> <p>增加：</p> <p>30、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</p> <p>（十一）参与融资交易相关公告</p> <p>本基金应当在季度报告、半年度报告、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>（十二）投资于非公开发行股票等流通受限证券的信息</p> <p>基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。</p> <p>本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，基金管</p>
--	---	--

	<p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3、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，决定延迟估值；</p> <p>4、如果出现属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；</p> <p>5、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认暂停估值时；</p>	<p>理人应当在 10 个交易日内进行调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p> <p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>2、不可抗力；</p> <p>3、本基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</p> <p>4、本基金发生暂停估值的情形；</p>
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>八、基金的合并</p> <p>本基金与其他基金合并，应当按照法律法规规定的程序进行。</p>	删除。
第二十部分 违约责任	<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</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</p>

	<p>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。</p> <p>但如发生下列情况，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投资或不投资造成的直接损失或潜在损失等。</p>	<p>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。</p> <p>但如发生下列情况，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投资或不投资造成的损失等。</p>
第二十一部分 争议的处理和适用的法律	<p>各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交</p> <p>中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费及律师费用由败诉方承担。</p> <p>争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。</p>	<p>各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该机构届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。</p>
第二十二部分 基金合同的效力	<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</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</p>

	<p>定代表人或授权代表签字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>定代表人或授权代表签字或者盖章，经 2018 年 X 月 X 日华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）的基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，《华安创业板 50 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《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。</p>
--	---	--