

博时基金管理有限公司关于博时中证全指证券公司指数证券投资 基金变更为博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基 金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告

博时中证全指证券公司指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2018]1894号文准予变更注册，于2020年8月7日起由博时中证800证券保险指数分级证券投资基金转型而来，基金管理人为博时基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国银行股份有限公司。

《博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定：“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）若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），即‘博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金’，则基金管理人有权在履行适当程序后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”。

基金管理人旗下博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金与本基金跟踪同一标的指数。该基金于2025年5月16日经中国证监会证监许可[2025]1040号文准予募集注册，于2025年10月24日成立，并于2025年11月4日起在深圳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，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定于2025年12月3日起，将本基金变更为博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订相关法律文件。上述变更相关情况如下：

一、基金份额的变更登记

本基金变更为博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金后，基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“博时中证全指证券公司指数证券投资基金A类基金份额”变更为“博时中证全指证券公司交易型开

放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额”，本基金A类基金份额场内简称“证券指数基金”不变；将“博时中证全指证券公司指数证券投资基金C类基金份额”变更为“博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额”。

本基金的基金场外简称变更情况如下，各类基金份额对应的基金代码保持不变。

基金代码	基金场外简称（变更前）	基金场外简称（变更后）
160516	博时证券公司指数A	博时证券公司ETF联接A
018686	博时证券公司指数C	博时证券公司ETF联接C

前述变更不影响各类基金份额净值的计算，各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率均保持不变。

二、基金合同、托管协议等的修订内容

经与基金托管人协商一致，基金管理人决定对《基金合同》、《博时中证全指证券公司指数证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）中涉及变更为联接基金以及法律法规更新的内容进行修订和补充。修订后的《博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》自2025年12月3日起生效，《基金合同》、《托管协议》同日起失效。基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件将根据修订后的基金合同进行更新。

自《博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效之日起，各类基金份额继续按照基金招募说明书及相关公告办理申购、赎回、定期定额投资、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管）等业务。

三、重要提示

1、此次变更系根据《基金合同》约定变更为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审议的事项，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、本公告仅对博时中证全指证券公司指数证券投资基金管理更为博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，可登录本公司网站（www.bosera.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。

3、投资者可以登录本公司网站（www.bosera.com）或拨打客户服务电话（95105568）咨询相关信息。

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。投资者投资于基金时应认真阅读基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等资料。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

博时基金管理有限公司

2025年12月2日

附件1：《基金合同》修订对照表

章节	原基金合同内容	修订后基金合同内容
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(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管理人内部控制制度》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。</p> <p>三、博时中证全指证券公司指数证券投资基金由博时中证800证券保险指数分级证券投资基金管理人依照《基金法》、《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同》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>中国证监会对博时中证800证券保险指数分级证券投资基金转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</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》”)、《公开募集证券投资基金管理人内部控制制度》(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。</p> <p>三、博时中证全指证券公司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”)由博时中证全指证券公司指数证券投资基金变更而来，博时中证全指证券公司指数证券投资基金由博时中证800证券保险指数分级证券投资基金转型而来，博时中证800证券保险指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《博时中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同》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>中国证监会对博时中证800证券保险指数分级证券投资基金转型为博时中证全指证券公司指数证券投资基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值</p>

	<p>九、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、成份股停牌或退市等潜在风险，具体风险详见本基金招募说明书。</p>	及市场前景等作出实质性判断或者保证。
第二部分 释义	<p>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：</p> <p>1、基金或本基金：指<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>，本基金由<u>博时中证800证券保险指数分级证券投资基金</u>转型而来</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同</u>》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金托管协议</u>》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金招募说明书</u>》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金产品资料概要</u>》及其更新</p> <p>16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<u>中国银行保险监督管理委员会</u></p> <p>41、基金合同生效日：指《<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同</u>》生效日，原《<u>博时中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同</u>》自同一起失效</p>	<p>九、本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股票（含存托凭证），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、成份股停牌或退市等潜在风险，具体风险详见本基金招募说明书。</p> <p>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：</p> <p>1、基金或本基金：指<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>，本基金由<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>变更而来，<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>由<u>博时中证800证券保险指数分级证券投资基金</u>转型而来</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同</u>》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议</u>》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书</u>》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《<u>博时中证全指证券公司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</u>》及其更新</p> <p>16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<u>国家金融监督管理总局</u></p> <p>41、基金合同生效日：指《<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同</u>》生效日，原《<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同</u>》自同一起失效</p> <p>43、存续期：指《<u>博时中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同</u>》生效至</p>

	<p>43、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p> <p>.....</p> <p>57、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>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><u>《博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》</u>终止之间的不定期期限</p> <p>.....</p> <p>57、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、<u>投资目标ETF基金份额所得收益</u>、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>58、基金资产总值：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、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>.....</p> <p>64、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务</p> <p>65、联接基金：指本基金，即将绝大部分基金财产投资于博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金</p> <p>66、目标ETF：博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金 (后续序号依次调整)</p>
第三部分基金的基本情况	<p>一、基金名称 博时中证全指证券公司指数证券投资基金</p> <p>二、基金的类别 股票型证券投资基金</p> <p>三、基金的运作方式 契约型开放式</p> <p>四、基金的投资目标 本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以下、年跟踪误差控制在4%以下</p> <p>◦</p> <p>.....</p> <p>七、基金份额类别 本基金根据申购费用与销售服务费收</p>	<p>一、基金名称 博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</p> <p>二、基金的类别 ETF联接基金</p> <p>三、基金的运作方式 契约型开放式</p> <p>四、基金的投资目标 <u>通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数即中证全指证券公司指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</u></p> <p>.....</p> <p>七、基金份额类别 本基金根据申购费用与销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。</p>

<p>取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。</p> <p>在投资者申购基金时收取申购费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购基金时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。</p> <p>本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。</p> <p>投资者可自行选择申购的基金份额类别。</p> <p>在对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以增加本基金新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会。</p> <p><u>八、本基金与博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF）的联系与区别</u></p> <p>在投资方法和交易方式等方面，本基金与博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF）的联系与区别主要体现在以下几个方面：</p> <p><u>联系：</u></p> <ol style="list-style-type: none"> 两只基金跟踪同一个标的指数即中证全指证券公司指数。 两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数即中证全指证券公司指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 两只基金具有相似的风险收益特征。 博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金是本基金的主要投资对象。 <p><u>区别：</u></p> <ol style="list-style-type: none"> 基金的投资管理方式不同：博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金通过直接买卖标的指数成份股和备选成份股等，直接跟踪复制标的指数的表现；而本基金则是通过买卖目标ETF基金（包 	<p>在投资者申购基金时收取申购费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购基金时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。</p> <p>本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。</p> <p>投资者可自行选择申购的基金份额类别。</p> <p>在对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以增加本基金新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会。</p> <p><u>八、本基金与博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF）的联系与区别</u></p> <p>在投资方法和交易方式等方面，本基金与博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF）的联系与区别主要体现在以下几个方面：</p> <p><u>联系：</u></p> <ol style="list-style-type: none"> 两只基金跟踪同一个标的指数即中证全指证券公司指数。 两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数即中证全指证券公司指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 两只基金具有相似的风险收益特征。 博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金是本基金的主要投资对象。 <p><u>区别：</u></p> <ol style="list-style-type: none"> 基金的投资管理方式不同：博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金通过直接买卖标的指数成份股和备选成份股等，直接跟踪复制标的指数的表现；而本基金则是通过买卖目标ETF基金（包
---	---

	<p><u>括在目标ETF的一级市场进行股票篮子组合的申购与赎回，也包括在目标ETF的二级市场以现金直接买卖ETF份额），间接跟踪标的指数的表现。</u></p> <p><u>2. 基金的申购赎回不同：博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金采用股票篮子组合的方式进行基金份额的申购与赎回，而本基金的申购和赎回均采用现金方式。</u></p> <p><u>3. 基金是否挂牌交易不同：博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金在深圳证券交易所挂牌交易；博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，博时中证全指证券公司指数证券投资基金联接基金将申请在深圳证券交易所上市交易，具体日期及业务规则详见基金管理人届时发布的相关公告。</u></p> <p><u>4. 价格揭示机制不同：博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金有实时市场交易价格和每日基金份额净值；而本基金在申请在深圳证券交易所上市交易前只揭示每日基金份额净值。</u></p> <p><u>5. 投资人申购赎回基金的程序不同：博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金通过指定场内申购赎回代理券商办理基金的申购与赎回；而本基金基金份额可通过场内和场外两种方式申购，本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及各场外销售机构的基金销售网点，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，具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或在基金管理人网站公示。</u></p> <p><u>九、本基金与博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金业绩表现的差异</u></p> <p><u>本基金的业绩表现与博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的业绩表现可能会出现差异，差异产生的主要原</u></p>
--	---

		<p>因有以下几个方面：</p> <ol style="list-style-type: none"> <u>1. 投资对象和投资范围的不同，会导致两只基金的业绩有差异。</u> <u>2. 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，会导致两只基金的业绩有差异。</u> <u>3. 基金规模、投资成本、各种费用与税收的不同，会导致两只基金的业绩有差异。由于两只基金的投资对象和投资范围不同，投资管理方式不同，基金规模也可能不同，所以，本基金的投资成本、各种费用及税收可能不同于博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金。</u> <u>4. 现金比例及现金管理方式的不同，会导致两只基金的业绩有差异。本基金须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，对现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，而博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金仅规定在每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。</u>
第四部分 基金的历史沿革	博时中证全指证券公司指数证券投资基金由博时中证800证券保险指数分级证券投资基金管理而来。	<p>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金由博时中证全指证券公司指数证券投资基金变更而来。博时中证全指证券公司指数证券投资基金由博时中证800证券保险指数分级证券投资基金管理而来。</p> <p>.....</p> <p>根据《博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同》的约定：“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) 若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金(ETF)，即‘博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金’，则基金管理人有权在履行适当程序后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”，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定将博时中证全指证券公司指</p>

		<p><u>数证券投资基金变更为博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此将《博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同》修订为本基金合同。</u></p> <p><u>自2025年12月3日起，博时中证全指证券公司指数证券投资基金正式变更为博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金。</u></p>
第六部分 基金份额的上市交易	<p>六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市</p> <p>本基金基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关业务规则执行。</p> <p>当基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将转型为非上市开放式基金，本基金的基金费率，基金的投资范围和投资策略等均不变，届时无需召开基金份额持有人大会。基金转型并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则由基金管理人提前制定并公告。</p>	<p>六、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市</p> <p>本基金基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关业务规则执行。</p> <p>当基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将转型为非上市开放式基金，本基金的基金费率，基金的投资范围和投资策略等均不变，届时无需召开基金份额持有人大会。</p>
第七部分 基金份额的申购与赎回	<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；基金份额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；基金份额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。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p>.....</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；基金份额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；基金份额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。</p> <p>在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p><u>遇目标ETF的投资市场休市、目标ETF暂停交易或赎回、目标ETF延迟支付赎回对价或延迟交收、交易所或登记机构的交易结算规则发生较大变化、本基金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、或其他非基金管</u></p>

	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>.....</p>	<p><u>理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延至该因素消除的最近一个工作日。</u></p> <p>.....</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、<u>基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限</u>，具体规定请参见招募说明书或相关公告。</p> <p>.....</p>
	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>.....</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>.....</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<u>50%</u>，或者变相规避<u>50%集中度的情形时</u>。</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、8项之一且基金管理人决定暂停申购情形时，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>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>.....</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易。</p> <p>.....</p> <p>7、<u>所投资的目标ETF暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u></p> <p>8、<u>所投资的目标ETF暂停申购或二级市场交易停牌。</u></p> <p>9、<u>申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限。</u></p> <p>10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、7、8、10项之一且基金管理人决定暂停申购情形时，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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>

	<p>估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、基金管理人认为继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>6、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，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，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。基金份额持有人在场外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。当出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，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业务规则办理。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>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易。</p> <p>4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>5、所投资的目标ETF暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>6、所投资的目标ETF暂停赎回、延缓支付赎回对价或二级市场交易停牌。</p> <p>7、基金管理人认为继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请。</p> <p>8、本基金当日总赎回份额达到基金管理人所设定的上限，基金管理人可拒绝赎回申请。</p> <p>9、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p> <p>10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形（第4项除外）之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，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，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。基金份额持有人在场外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。当出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，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业务规则办理。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>
--	---	--

第八部分 基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p><u>(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；</u></p> <p>(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p>
	<p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，本基金同一类别每份基金份额具有同等合法权益。</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>(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；</p> <p>.....</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金的基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。</p> <p>除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，本基金同一类别每份基金份额具有同等合法权益。</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><u>(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；</u></p> <p>.....</p>
第九部分 基金份额持有人大会	<p>一、召开事由</p> <p>1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>.....</p> <p>(14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。</p> <p>2、以下情况可由基金管理人和基金</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：</p> <p>.....</p> <p><u>(14) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会；</u></p> <p>(15) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。</p> <p>2、以下情况可由基金管理人和基金托</p>

<p>托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>.....</p> <p>(5) 若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金(ETF)，即“博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金”，则基金管理人有权在履行适当程序后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；</p> <p>(6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。</p>	<p>管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>.....</p> <p>(5) 在法律法规和中国证监会允许范围内，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；</p> <p>(6) 履行相关程序后，基金推出新业务或服务；</p> <p>(7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。</p>
<p>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</p> <p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明。</p> <p>.....</p> <p>十、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>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</p> <p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，<u>经会议通知载明</u>，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明。</p> <p>.....</p> <p>十、鉴于本基金是目标ETF的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额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。</p> <p>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。</p> <p>本基金的基金管理人代表本基金的基金份</p>

		<p><u>额持有人提议召开或召集目标ETF的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的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的基金份额持有人大会。</u></p> <p>十二、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>
第十部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序		<p><u>三、新基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务，或新基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原基金管理人或原基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。</u></p> <p><u>四、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，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，基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</u></p>
第十三部分 基金的投资	<p>一、投资目标 本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以下、年跟踪误差控制在4%以下。</p> <p>二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的</p>	<p>一、投资目标 <u>通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数即中证全指证券公司指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</u></p> <p>二、投资范围 <u>本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。</u> 为更好地实现基金的投资目标，本基金可</p>

<p>金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）、存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转债和可交换债）、债券回购、权证、股指期货、银行存款、同业存单、货币市场工具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>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>本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于90%，中证全指证券公司指数成分股和备选成分股（含存托凭证）占非现金基金资产的比例不低于80%；权证投资比例为基金资产净值的0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>三、投资策略</p> <p>本基金为指数型基金，采用组合复制法，按照成份股在中证全指证券公司指数中的基准权重构建指数化投资组合，同时为实现对标的指数更好的跟踪，本基金将辅以适当的替代性策略调整组合。</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。</p> <p>股票资产占基金资产的比例不低于90%，中证全指证券公司指数成分股和备选</p>	<p><u>能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转债和可交换债）、债券回购、权证、股指期货、银行存款、同业存单、货币市场工具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)。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；权证投资比例为基金资产净值的0-3%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</u>每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。</p> <p>三、投资策略</p> <p><u>本基金主要通过投资于目标ETF，实现对指数的紧密跟踪。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于0.35%，预期年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</u></p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p><u>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成</u></p>
---	--

<p>成份股占非现金基金资产的比例不低于80%，权证投资比例为基金资产净值的0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、股票组合构建原则</p> <p>本基金采用组合复制法跟踪中证全指证券公司指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。</p> <p>2、股票组合构建方法</p> <p>本基金采取组合复制法，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。</p> <p>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，降低跟踪误差。</p> <p>如出现股票停牌、股票流动性较差或其他影响指数复制的因素，使基金管理人无法依指数权重购买成份股时，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，以适当的替代性策略对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。</p> <p>3、股票组合调整</p> <p>(1) 定期调整</p> <p>本基金股票组合根据所跟踪的中证全指证券公司指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p>(2) 不定期调整</p> <p>1) 与指数相关的调整</p> <p>根据指数编制规则，当中证全指证券公司指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重重新调整时，本基</p>	<p>份股（含存托凭证）、依法发行上市的非成份股（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）、债券、债券回购、权证、股指期货、银行存款、同业存单、货币市场工具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），其目的是为了使本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>(二) 基金投资策略</p> <p>本基金投资目标ETF的两种方式如下：</p> <p>1. 申购和赎回：目标ETF开放申购赎回后，按照目标ETF法律文件约定的方式申赎目标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份额的交易。</p> <p>当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金将在履行适当程序后，作相应的变更或调整。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，灵活选用上述方式进行目标ETF的交易。</p> <p>(三) 成份股、备选成份股投资策略</p> <p>本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制策略，即完全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而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。</p> <p>(四) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>(五) 债券投资策略</p> <p>基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国</p>
---	--

	<p>金将进行相应调整。</p> <p>2) 申购赎回调整</p> <p>根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。</p> <p>3) 其它调整</p> <p>根据法律、法规和基金合同的规定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，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小于 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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>(四) 股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的</p> <p>债、央行票据等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>(六) 股指期货交易策略</p> <p>本基金参与股指期货交易将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>(七) 权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于提高基金资产的投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。</p> <p>未来随着证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金可相应调整和更新相关投资策略。</p>
--	---

<p>系统性风险和流动性风险。并利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>(五) 权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于提高基金资产的投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。</p> <p>未来随着证券市场投资工具的发展和丰富，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金可相应调整和更新相关投资策略。</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) 股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于90%，中证全指证券公司指数成分股和备选成分股（含存托凭证）占非现金基金资产的比例不低于80%；</p> <p>.....</p> <p>(8) 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%；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>(9) 本基金参与股指期货投资的，应遵循下列限制：</p> <p>1) 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%；</p> <p>2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 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%；</p> <p>4) 本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规定；</p> <p>5) 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%；</p> <p>(9) 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%；</p> <p>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</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%，且不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>.....</p> <p>(8) 本基金参与股指期货交易的，应遵循下列限制：</p> <p>1) 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%；</p> <p>2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 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%；</p> <p>4) 本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规定；</p> <p>5) 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%；</p> <p>(9) 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%；</p> <p>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</p>
--	--

	<p>4) 本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规定；</p> <p>5) 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%；</p> <p>(10) 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%；</p> <p>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>(11) 本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；</p> <p>(11) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算：</p> <p>(12) 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。</p> <p>除上述第(1)、(2)、(9)、(10)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(1)项规定的比例的，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。</p> <p>.....</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <ul style="list-style-type: none"> (1) 承销证券； (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保； (3) 从事承担无限责任的投资； (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； (5) 向其基金管理人、基金托管人出资； (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格 <p>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>(10) 本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；</p> <p>(11) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算：</p> <p>(12) 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。</p> <p>除上述第(1)、(2)、(9)、(10)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(1)项规定的比例的，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。</p> <p>.....</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <ul style="list-style-type: none"> (1) 承销证券； (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保； (3) 从事承担无限责任的投资； (4) 买卖除目标ETF外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； (5) 向其基金管理人、基金托管人出资； (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格
--	---

<p>格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>.....</p> <p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>基金采取如上的业绩比较基准的主要理由是：1、本基金以跟踪中证全指证券公司指数为投资目标，基金资产主要投资于中证全指证券公司指数成分股及其备选成分股，故选取中证全指证券公司指数收益率×95%作为本基金股票投资的业绩比较基准；2、考虑到现金或到期日在一年以内的政府债券不得低于基金净资产的5%，故选取活期存款利率（税后）×5%作为本基金固定收益类资产、货币资产的业绩比较基准。</p> <p>3、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，如更换运作方式、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。</p> <p>.....</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为被动跟踪指数的股票型指数证券投资基金，属于证券投资基金当中中高预期风险、中高预期收益的品种。一般情形下，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。</p> <p>七、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事</p>	<p>及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>.....</p> <p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>3、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以及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、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。</p> <p>.....</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>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型指数基金，跟踪中证全指证券公司指数，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。</p> <p>七、目标ETF发生相关变更情形时的处理</p> <p>除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以及法律法规、监管机构另有规定的情形除外）、指数编制机构退出等原因外，目标ETF出现下述情形之</p>
---	--

	<p>务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>	<p><u>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；若届时基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，基金管理人应本着维护投资人合法权益的原则，提出解决方案，并相应履行适当程序，届时将由基金管理人另行公告。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。</u></p> <p>1、目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</p> <p>2、目标ETF终止上市；</p> <p>3、目标ETF基金合同终止；</p> <p>4、目标ETF与其他基金进行合并；</p> <p>5、目标ETF的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外）；</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p> <p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，<u>无需召开基金份额持有人大会审议</u>。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
第十四部分 基金的财产	<p>一、基金资产总值</p> <p>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。</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买的目标ETF基金份额、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。</p>
第十五部分	<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</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</p>

<p>基金资产估值</p> <p>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>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</p>	<p>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基金份额、股票（含存托凭证）、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值原则</p> <p>基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。</p> <p>(一) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。</p> <p>与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</p> <p>(二) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。</p> <p>(三) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。</p> <p>四、估值方法</p>
---	---

<p>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) 交易所上市的债券，采用估值技术确定公允价值。对在交易所市场上交易的不含权债券，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；对在交易所市场上交易的含权债券，选取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；</p> <p>(3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。</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) 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>3、全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。</p> <p>4、本基金若转为ETF联接基金，本基金投资的目标ETF份额以目标ETF估值目的净值估值。</p>	<p>1、本基金持有的目标ETF基金份额以其当日基金份额净值估值，当日无基金份额净值的，以最近工作日的基金份额净值估值。</p> <p>2、交易所上市或挂牌转让的有价证券（包括股票等，本基金合同另有约定的除外），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>3、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。</p> <p>4、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。</p> <p>对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。</p> <p>5、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。</p> <p>6、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够的利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</p>
--	---

	<p>5、同一<u>债券</u>同时在两个或两个以上市场交易的，按<u>债券</u>所处的市场分别估值。</p> <p>6、本基金<u>投资</u>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、当发生大额申购或赎回的情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p> <p>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。</p> <p>9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>7、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，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) <u>流通受限的股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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。</u></p> <p>8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</p> <p>9、同一<u>证券</u>同时在两个或两个以上市场交易的，按<u>证券</u>所处的市场分别估值。</p> <p>10、本基金<u>参与</u>股指期货合约<u>交易</u>，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>11、当发生大额申购或赎回的情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。</p> <p>12、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>13、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p>
<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市</p>

	<p>市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> <p>.....</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>场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</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、所投资的目标ETF暂停估值、暂停公告基金份额净值时；</p> <p>4、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>5、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> <p>.....</p> <p>九、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第12项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十六部分 基金费用与税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>.....</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ <p>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</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ <p>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</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>.....</p> <p>11、基金投资目标ETF的相关费用；（后续序号依次调整）</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ <p>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已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额，金额为负时以零计。</p> <p>基金管理人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金管理费。</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</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</p>

<p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>3、C类基金份额的销售服务费</p> <p>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率为0.30%。本基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。</p> <p>本基金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。销售服务费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的C类基金份额的销售服务费 E为前一日的C类基金份额基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月初五个工作日内进行支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> <p>.....</p> <p>五、基金税收</p> <p>本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。</p> <p>本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。</p>	<p>0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ <p>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已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额，金额为负时以零计。</p> <p>基金托管人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金托管费。</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>3、C类基金份额的销售服务费</p> <p>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率为0.30%。本基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。</p> <p>本基金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。销售服务费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的C类基金份额的销售服务费 E为前一日的C类基金份额基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>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。</p> <p>.....</p> <p>五、基金税收</p> <p>本基金支付给基金管理人、基金托管人的</p>
--	---

		<p>各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。</p> <p>本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。</p>
第十八部分 基金的会计与审计	<p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</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>.....</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</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>.....</p>
第十九部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(一) 基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>.....</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>.....</p> <p>(四) 基金定期报告</p> <p>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</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(一) 基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>.....</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；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。</p> <p>.....</p> <p>(四) 基金定期报告（包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告）</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示</p>

<p>个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>《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。</p> <p>本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期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>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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>.....</p> <p>.....</p> <p>(五) 临时报告</p> <p>.....</p> <p>23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</p> <p>24、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。</p> <p>.....</p>	<p>性公告登载在规定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期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>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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>.....</p> <p>(五) 临时报告</p> <p>.....</p> <p>23、调整基金份额类别的设置；</p> <p>24、变更目标ETF；</p> <p>25、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</p> <p>26、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。</p> <p>.....</p> <p>(十) 参与股指期货交易的信息披露</p> <p>基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和交易目标等。</p> <p>(十一) 投资目标ETF的信息披露</p>
---	--

		<p><u>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：</u></p> <p><u>1、投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>.....</p>
第二 十三 部分 基金 合同 的效 力	<p>《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。</p> <p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并加盖。</p> <p>.....</p>	<p>《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。</p> <p>1、《基金合同》由《博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同》修订而来。自2025年12月3日起，本基金合同生效，《博时中证全指证券公司指数证券投资基金基金合同》失效。</p> <p>.....</p>
第二 十五 部分 基金 合同 摘要		基金合同摘要修改同基金合同正文部分内容

附件2：《托管协议》修订对照表

章节	原托管协议内容	修改后托管协议内容
	<p>鉴于博时基金管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；</p> <p>鉴于中国银行股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金</p>	<p>鉴于博时基金管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；</p> <p>鉴于中国银行股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人</p>

	<p>托管人的资格和能力；</p> <p>鉴于博时基金管理有限公司拟担任<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>的基金管理人，中国银行股份有限公司拟担任<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>的基金托管人；</p> <p>为明确<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。</p>	<p>的资格和能力；</p> <p>鉴于博时基金管理有限公司拟担任<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>的基金管理人，中国银行股份有限公司拟担任<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>的基金托管人；</p> <p>为明确<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。</p>
二、 托管 协议 的依 据、 目的 、原 则和 解释	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《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》及其他有关法律法规与《<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p> <p>(二) 目的</p> <p>订立本协议的目的是明确<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>基金托管人和<u>博时中证全指证券公司指数证券投资基金</u>基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。</p>	<p>(一) 依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《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》、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》</u>、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》</u>及其他有关法律法规与《<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>基金合同》(以下简称“《基金合同》”)订立。</p> <p>(二) 目的</p> <p>订立本协议的目的是明确<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>基金托管人和<u>博时中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u>基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。</p>
三、 基金 托管 人对	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的中证全指证</p>

基金管理人的业务监督和核查	<p>监督。基金管理人应将拟投资的中证全指证券公司指数成分股和备选成分股以及其他非成分股股票库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）、存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转债和可交换债）、债券回购、权证、股指期货、银行存款、同业存单、货币市场工具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)。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>本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于90%，中证全指证券公司指数成分股和备选成分股（含存托凭证）占非现金基金资产的比例不低于80%；权证投资比例为基金资产净值的0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督； (1) 股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于90%，中证全指证券公司指数成分股和备选成分股（含存托凭证）占非现金基金资产的比例不低于80%;</p> <p>(8) 本基金参与股指期货交易的，应遵</p>	<p>券公司指数成分股和备选成分股以及其他非成分股股票库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；</p> <p>本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。</p> <p>为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票和存托凭证）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转债和可交换债）、债券回购、权证、股指期货、银行存款、同业存单、货币市场工具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)。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>本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；权证投资比例为基金资产净值的0-3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督； (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%，且不低于非现金基金资产的80%； </p>
----------------------	---	--

<p>80%;</p> <p>.....</p> <p>(8) 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%；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>(9) 本基金参与股指期货投资的，应遵循下列限制：</p> <p>1) 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%；</p> <p>2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 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%；</p> <p>4) 本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）应当不低于基金资产净值的90%；</p> <p>5) 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%；</p> <p>(10) 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%；</p> <p>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>(11) 本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</p>	<p>循下列限制：</p> <p>1) 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%；</p> <p>2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 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%；</p> <p>4) 本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）应当不低于基金资产净值的90%；</p> <p>5) 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%；</p> <p>(9) 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%；</p> <p>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>(10) 本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。基金管理人承诺本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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</p> <p>(11) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；</p> <p>(12) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。</p> <p>除上述第(1)、(2)、(9)、(10)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</p>
--	---

	<p>保持一致。本基金管理人承诺本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，并承担由于不一致所导致的风险和损失；</p> <p>(12) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。</p> <p>除上述第(2)、(10)、(11)项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>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，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(1)项规定的比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整。</u>法律法规另有规定的，从其规定。</p>
八、 基金 资产 净值 计算 和会 计核 算	<p>.....</p> <p>(二) 基金会计核算</p> <p>1、基金账册的建立</p> <p>基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。</p> <p>2、会计数据和财务指标的核对</p> <p>基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。</p> <p>3、基金财务报表和定期报告的编制和复核</p> <p>基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后45日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于</p>	<p>.....</p> <p>(二) 基金会计核算</p> <p>1、基金账册的建立</p> <p>基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。</p> <p>2、会计数据和财务指标的核对</p> <p>基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。</p> <p>3、基金财务报表和定期报告的编制和复核</p> <p>基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后45日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；中期报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于</p>

	<p>公告；中期报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于会计年度半年终了后两个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后三个月内予以公告。<u>基金合同生效不足两个月的，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。</u></p>	<p>会计年度半年终了后两个月内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后三个月内予以公告。</p>
十一、基金费用	<p>(一)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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。 在首期支付基金管理费前，基金管理人应向托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。基金管理人如需要变更此账户，应提前10个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。</p> <p>(二)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 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>(三)C类基金份额的销售服务费</p>	<p>(一)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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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<u>已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额，金额为负时以零计。</u> <u>基金管理人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金管理费。</u> 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。 在首期支付基金管理费前，基金管理人应向托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。基金管理人如需要变更此账户，应提前10个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。</p> <p>(二)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<u>已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额，金额为负时以零计。</u></p>

	<p>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率为0.30%。本基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。</p> <p>本基金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。销售服务费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的C类基金份额的销售服务费</p> <p>E为前一日的C类基金份额基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人根据与基金管理人协商一致的方式于次月初五个工作日内进行支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。</p>	<p>基金托管人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金托管费。</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>(三) C类基金份额的销售服务费</p> <p>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率为0.30%。本基金销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。</p> <p>本基金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。销售服务费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的C类基金份额的销售服务费</p> <p>E为前一日的C类基金份额基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p>
十九、托管协议的效力	<p>(一) 基金管理人在向中国证监会申请变更注册时提交的基金托管协议草案，应经托管协议双方当事人的法定代表人或授权签字人签字并加盖公章，<u>协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会备案的文本为正式文本。</u></p> <p>(二) 本协议自基金合同成立之日起成立，自基金合同生效之日起生效。本协议的有效期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。</p> <p>(三) 本协议自生效之日起对双方当事人具有同等的法律约束力。</p>	<p>(一) 基金托管协议应经托管协议双方当事人的法定代表人或授权签字人签字并加盖公章。</p> <p>(二) 本协议自基金合同生效之日起生效。本协议的有效期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。</p> <p>(三) 本协议自生效之日起对双方当事人具有同等的法律约束力。</p> <p>(四) 本协议正本一式六份，协议双方各执两份，上报有关监管机构一式二份，每份具有同等法律效力。</p>

	人具有同等的法律约束力。 （四）本协议正本一式陆份，协议双方各执贰份，上报有关监管机构一式二份，每份具有同等法律效力。	
--	--	--