

# 博时基金管理有限公司关于博时中证A500指数型证券投资基金变更为博时中证A500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A500指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2024年10月18日经中国证监会证监许可[2024]1439号文准予募集注册，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”），基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金于2024年10月30日成立。

《博时中证A500指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定：“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），则基金管理人有权在履行适当程序后使本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改基金合同，届时无须召开基金份额持有人大会但须提前公告。”

基金管理人旗下博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金于2024年11月1日经中国证监会证监许可[2024]1522号文准予募集注册，于2024年11月21日成立，并将于2024年11月28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2024年11月29日起，将本基金变更为博时中证A500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。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A500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A500指数型证券投资基金A类基金份额”变更为“博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额”，将“博时中证A500指数型证券投资基金C类基金份额”变更为“博时中证A500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	基金简称（变更前）	基金简称（变更后）
022457	博时中证A500指数A	博时中证A500ETF联接A
022458	博时中证A500指数C	博时中证A500ETF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A500指数型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A500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A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》自2024年11月29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。

## 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A500指数型证券投资基金变更为博时中证A500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](http://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](http://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

2024年11月26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
<p>第一部分 前言</p>	<p>一、订立本基金合同的<del>目的、依据和原则</del></p> <p>.....</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p>三、博时中证A500指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对<b>本基金</b>募集的注册，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> <p>基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p> <p>.....</p> <p><del>六、本基金因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，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</del></p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——<u>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>》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p>.....</p> <p>三、<u>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金由博时中证A500指数型证券投资基金变更而来</u>，博时中证A500指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对<u>博时中证A500指数型证券投资基金</u>募集的注册，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> <p>基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p> <p>.....</p> <p>六、<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票（含存托凭证）</u></p>

	<p>经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)。</p> <p><del>七、本基金为指数基金</del>，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>，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>(后续序号依此调整)</p>
<p><b>第二部分 释义</b></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<del>博时中证A500指数型证券投资基金</del></p> <p>.....</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《<del>博时中证A500指数型证券投资基金</del>基金合同》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《<del>博时中证A500指数型证券投资基金</del>托管协议》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《<del>博时中证A500指数型证券投资基金</del>招募说明书》及其更新</p> <p>7、<del>基金份额发售公告</del>：指《<del>博时中证A500指数型证券投资基金基金份额发售公告</del>》</p> <p>8、基金产品资料概要：指《<del>博时中证A500指数型证券投资基金</del>基金产品资料概要》及其更新</p> <p>.....</p> <p>16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<b>中国银行保险监督管理委员会</b></p> <p>.....</p> <p>23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，<del>发售基金份额</del>，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>.....</p> <p>29、基金合同生效日：指<b>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</b></p> <p>.....</p> <p>31、<del>基金募集期</del>：指自<b>基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不</b></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<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b></p> <p>.....</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b>基金合同》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《<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b>托管协议》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《<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b>招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b>基金产品资料概要》及其更新</p> <p>.....</p> <p>15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或<b>国家金融监督管理总局</b></p> <p>.....</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，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>.....</p> <p>28、基金合同生效日：指《<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b>基金合同》生效日</p> <p>.....</p> <p>44、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、证券持有期间的公允价值变动、<b>投资目标ETF基金份额</b>所得收益、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>45、基金资产总值：指基金拥有的各类有</p>

	<p>得超过3个月</p> <p>.....</p> <p><del>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</del></p> <p>.....</p> <p>47、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、证券持有期间的公允价值变动、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>48、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>.....</p>	<p>价证券、<u>目标ETF基金份额</u>、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>.....</p> <p><u>60、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A500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</u></p> <p><u>61、目标ETF：博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金</u></p> <p>.....</p> <p>（后续序号依次调整）</p>
<p>第三部分基金的基本情况</p>	<p>一、基金名称</p> <p><del>博时中证A500指数型证券投资基金</del></p> <p>二、基金的类别</p> <p><del>股票型证券投资基金</del></p> <p>三、基金的运作方式</p> <p>契约型开放式</p> <p>四、基金的投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。<del>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%。</del></p> <p>五、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证A500指数</p> <p><del>六、基金的最低募集份额总额和最低募集金额</del></p> <p><del>本基金的最低募集份额总额为2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币。</del></p> <p><del>七、基金份额发售面值和认购费用</del></p> <p><del>本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。</del></p> <p><del>本基金A类基金份额的具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。本基金C类基金份额不收取认购费。</del></p> <p>八、基金存续期限</p> <p>不定期</p> <p>九、基金份额类别设置</p> <p>本基金根据<del>认购</del>申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不</p>	<p>一、基金名称</p> <p><u>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</u></p> <p>二、基金的类别</p> <p><u>ETF联接基金</u></p> <p>三、基金的运作方式</p> <p>契约型开放式</p> <p>四、基金的投资目标</p> <p><u>通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数即中证A500指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</u></p> <p>五、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证A500指数</p> <p>六、基金存续期限</p> <p>不定期</p> <p><u>七、基金份额类别设置</u></p> <p>本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。</p> <p>本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。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>

同的类别。在投资者**认购、**申购时收取**认购、**申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者**认购、**申购时不收取**认购、**申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。

本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。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。

投资者可自行选择**认购、**申购的基金份额类别。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

#### **十、未来条件许可情况下的基金模式转换**

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），则基金管理人有权在履行适当程序后使本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改基金合同，届时无须召开基金份额持有人大会但须提前公告。

投资者可自行选择申购的基金份额类别。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

#### **八、本基金与博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF）的联系与区别**

**在投资方法和交易方式等方面，本基金与博时中证A500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：**

##### **联系：**

- 1. 两只基金跟踪同一个标的指数即中证A500指数。**
- 2. 两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数即中证A500指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。**
- 3. 两只基金具有相似的风险收益特征。**
- 4. 博时中证A500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。**

##### **区别：**

- 1. 基金的投资管理方式不同：博时中证A500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。**
- 2. 基金的申购赎回不同：博时中证A500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。**
- 3. 基金是否挂牌交易不同：博时中证A500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；而本基金则不上市交易。**
- 4. 价格揭示机制不同：博时中证A500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；而本基金只**

		<p>揭示每日基金份额净值。</p> <p>5. 投资人申购赎回基金的程序不同：博时中证A500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；而本基金则通过场外销售机构办理基金的申购与赎回。</p> <p>九、本基金与博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金业绩表现的差异</p> <p>本基金的业绩表现与博时中证A500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，差异产生的主要原因有以下几个方面：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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A500交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>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国债期货、股指期货和股票期权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A500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。</p>
<p>第四部分 基金份额的发售的历史沿革</p>	<p><del>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</del></p> <p>1、<del>发售时间</del> 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、<del>发售方式</del> 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站。</p>	<p>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金由博时中证A500指数型证券投资基金变更而来。博时中证A500指数型证券投资基金经中国证监会《关于准予博时中证A500指数型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2024〕1439号）准予募集注册，基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。博时中证A500指数型证券投资基金自2024年10月25日至2024年10月28日进行公</p>



<p>3、<u>发售对象</u> 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p>二、<u>基金份额的认购</u></p> <p>1、<u>认购费用</u> 本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。本基金C类基金份额不收取认购费用。</p> <p>2、<u>募集期利息的处理方式</u> 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，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、<u>基金认购份额的计算</u> 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、<u>认购份额余额的处理方式</u> 认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>5、<u>认购申请的确认</u> 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。</p> <p>三、<u>基金份额认购金额的限制</u></p> <p>1、<u>投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</u></p> <p>2、<u>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。</u></p> <p>3、<u>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。</u></p> <p>4、<u>投资者在募集期内可以多次认购基金份额，A类基金份额的认购费按每笔该类基金份额认购申请单独计算，但已</u></p>	<p>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，《博时中证A500指数型证券投资基金基金合同》于2024年10月30日生效。</p> <p>根据《博时中证A500指数型证券投资基金基金合同》的约定：“若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（ETF），则基金管理人有权在履行适当程序后使本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改基金合同，届时无须召开基金份额持有人大会但须提前公告”，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定将博时中证A500指数型证券投资基金变更为博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订《博时中证A500指数型证券投资基金基金合同》。</p> <p>自2024年11月29日起，博时中证A500指数型证券投资基金正式变更为博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金。</p>
---	---

	<p>受理的认购申请不允许撤销。</p> <p>5、单一投资者持有本基金份额集中度不得达到或者超过50%，对于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，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。法律法规、监管机构另有规定或基金合同另有约定的除外。</p> <p>6、本基金可设置首次募集规模上限，具体募集上限及规模控制的方案详见基金份额发售公告或其他公告。若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受首次募集规模的限制。</p>	
<p>第五部分 基金 备案 的 存 续</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，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</li> <li>2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；</li> <li>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。</li> </ol> <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数</p>	<p>《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在六个月内召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>

	<p><b>量和资产规模</b></p> <p>《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在六个月内召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></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，投资人全额交付申购款项，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。</p> <p>投资者的赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的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>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、或其他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，则赎回款项划付时间相应顺延。</p> <p>.....</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</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>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，投资人全额交付申购款项，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。</p> <p>投资者的赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的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><b><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></b></p> <p>.....</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>.....</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、<b><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></b>，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</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</p>

<p>暂停接受投资人的申购申请：  ..... 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。  4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。  5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。  6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  7、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。  <b><del>8、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%集中度的情形时。</del></b>  9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。  发生上述第1、2、3、5、6、7、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项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>暂停接受投资人的申购申请：  .....  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<b>或无法进行证券交易</b>。  4、基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。  5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。  6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。  7、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。  <b><u>8、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></b>  <b><u>9、所投资的目标ETF暂停申购或二级市场交易停牌。</u></b>  <b><u>10、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></b>  11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。  发生上述第1、2、3、5、6、7、<b><u>8、9、11</u></b>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项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  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：  1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。  2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形  发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：  1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。  2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。  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</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、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。</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>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><b>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。</b></p> <p><b>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。</b></p> <p>7、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。</p> <p><b>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。</b></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><b>第七部分基金合同当事人及权利义务</b></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>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金<b>认购、</b>申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；</p> <p>(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>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<b>发售、</b>申购、赎回和登记事宜；</p> <p>.....</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额<b>认购、</b>申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>.....</p> <p><del>(24) 基金在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集</del></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>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；</p> <p><b>(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；</b></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>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>.....</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>.....</p> <p>(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p>

	<p>资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；</p> <p>(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p> <p>(26) 建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。</p>	<p>(25) 建立并保存基金份额持有人名册；</p> <p>(26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。</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，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。</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>.....</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>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>.....</p> <p>(4) 交纳基金<del>认购</del>—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>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》取得基金份额，即成为本基金的<del>基金</del>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，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。</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>.....</p> <p>(5) 出席或者委派代表出席<b>本基金或目标ETF</b>的基金份额持有人大会，对<b>本基金或目标ETF</b>的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p> <p>.....</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>.....</p> <p>(4) 交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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>(13) 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、在法律法规规定和《基金合同</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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>(13) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会；</u></p> <p>(14) 法律法规、《基金合同》或中国</p>

<p>》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： .....</p> <p>（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其他情形。</p>	<p>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、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： .....</p> <p><b>（7）由于目标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、目标ETF终止上市或目标ETF基金合同终止等情形时本基金变更为直接投资该标的指数的指数基金；</b></p> <p>（8）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其他情形。</p>
<p>四、基金份额持有人出席会议的方式 .....</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址<b>或系统</b>。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。 .....</p> <p>3、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，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，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p>	<p>四、基金份额持有人出席会议的方式 .....</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。 .....</p> <p>3、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，<b>经会议通知载明</b>，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，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p>
<p>六、表决 .....</p> <p>采取通讯方式进行表决时，除非在计票时<b>监督员及公证机关均认为</b>有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。</p>	<p>六、表决 .....</p> <p>采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。</p>
	<p><b>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，</b></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，基金管理人应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>其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数：<u>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。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF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>十一、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，基金管理人应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><b>第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b></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>(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。新任基金托管人或临时基金托管人<u>应</u>与基金管理人核对基金资产总值和净值；</p>



<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>一、投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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%。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。</p> <p>.....</p> <p>本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于标的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、股票期权和国债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；股指期货、股票期权、国债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。</p> <p>.....</p> <p>三、投资策略</p> <p>1、组合复制策略</p> <p>本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>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</p>	<p>一、投资目标</p> <p><u>通过主要投资于目标ETF</u>，紧密跟踪标的指数即<u>中证A500指数的表现</u>，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于<u>目标ETF</u>、标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。</p> <p>.....</p> <p>本基金<u>投资于目标ETF</u>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%；<u>股指期货、股票期权、国债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、股票期权和国债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。</p> <p>.....</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>1、资产配置策略</p> <p>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、资产支持证券、衍生工具、债券回购、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<b>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。</b></p> <p>2、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：<u>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</u></p>
--------------------	--	--

<p>扩大。</p> <p>当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>为了实现更好的跟踪标的指数的目的，基金管理人还将综合考虑标的指数成份股的数量、流动性、投资限制、交易费用及成本，以及税务及其他监管限制，决定是否采用抽样复制的策略。对于复制方法的变更，本基金管理人需在方法变更前按规定在规定媒介公告，并阐明变更复制方法的原因。</p> <p><b>2、债券（除可转换债券、可交换债券）投资策略</b></p> <p>本基金债券投资组合将着重考虑基金的流动性管理及策略性投资的需要进行配置。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><b>3、资产支持证券的投资策略</b></p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，在力争本金安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。</p> <p><b>4、可转换债券、可交换债券投资策略</b></p> <p>在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金着重对可转换债券所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，并结合基金管理人可转债评级系统对可转换债券投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。</p> <p>可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司（以下简称“目标公司”）的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中，债券特性与可转换债券相同，指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特</p>	<p>目标ETF。</p> <p><b>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。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。</b></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><b>3、成份股、备选成份股投资策略</b></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><b>4、债券（除可转换债券、可交换债券）投资策略</b></p> <p>本基金债券投资组合将着重考虑基金的流动性管理及策略性投资的需要进行配置。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><b>5、资产支持证券的投资策略</b></p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同，在力争本金安全和基金资产流动性基础上获得长期稳定收益。</p> <p><b>6、可转换债券、可交换债券投资策略</b></p> <p>在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金着重对可转换债券所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，并结合基金管理人可转债评级系统对可转换债券投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。</p> <p>可交换债券在换股期间用于交换的股票是</p>
---	---

性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析,综合开展投资决策。

#### 5、衍生品投资/交易策略

##### (1) 股指期货、国债期货交易策略

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,力争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。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的交易,改善组合的风险收益特性。

##### (2) 股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

#### 6、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。本基金将根据市场情况、投资者类型和结构、本基金的历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素,合理确定出借证券的范围和品类。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来在法律法规允许的前提下,本基金将依据法律法规的相关规定参与融券业务。

#### 7、存托凭证投资策略

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。

未来,随着投资工具的发展和丰富,本基金可在不改变投资目标的前提下,相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明更新中公告。

发行人持有的其他上市公司(以下简称“目标公司”)的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中,债券特性与可转换债券相同,指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析,综合开展投资决策。

#### 7、衍生品投资/交易策略

##### (1) 股指期货、国债期货交易策略

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,力争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。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的交易,改善组合的风险收益特性。

##### (2) 股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

#### 8、融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上,审慎参与融资及转融通证券出借业务。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析,确定投资时机、标的证券以及投资比例。本基金将根据市场情况、投资者类型和结构、本基金的历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素,合理确定出借证券的范围和品类。若相关融资及转融通证券出借业务法律法规发生变化,本基金将从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来在法律法规允许的前提下,本基金将依据法律法规的相关规定参与融券业务。

#### 9、存托凭证投资策略

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。

未来,随着投资工具的发展和丰富,本基金可在不改变投资目标的前提下,相应调

<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）本基金的<b>股票</b>资产<b>投资</b>比例不低于基金资产的90%，<b>其中投资手标的指数成份股和备选成份股的资产</b>不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>.....</p> <p>除上述第（2）、（8）、（13）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</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> <p>（1）承销证券；</p> <p>（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（3）从事承担无限责任的投资；</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>.....</p> <p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求以及法律法规、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<b>更换基金标的指数</b>、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><b>若标的指数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），则无需召开基金份额持有人大会，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</b></p>	<p>整和更新相关投资策略，并在招募说明更新中公告。</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<b>投资于目标ETF</b>的资产比例不低于基金资产<b>净值</b>的90%，<b>且</b>不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>.....</p> <p>除上述第<b>（1）、（2）、（8）、（13）、（14）、（15）</b>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、<b>目标ETF暂停申购/赎回或二级市场交易停牌</b>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。<b>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。</b></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> <p>（1）承销证券；</p> <p>（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（3）从事承担无限责任的投资；</p> <p>（4）买卖<b>除目标ETF外的</b>其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>.....</p> <p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求以及法律法规、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</p>
--	--

	<p>后在<b>规定媒介上及时公告。</b></p> <p>六、<b>风险收益特征</b>  <b>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</b>本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证A500指数，其<b>风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</b></p> <p>七、<b>基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法</b>  .....</p> <p>八、<b>侧袋机制的实施和投资运作安排</b></p>	<p>，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、<b>风险收益特征</b>  <b>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。</b>同时，本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证A500指数，其<b>预期风险与预期收益高于债券型基金、混合型基金、货币市场基金。</b></p> <p>七、<b>目标ETF发生相关变更情形时的处理</b>  <b>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出现下述情形之一的，本基金将在履行适当程序后由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，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。</b></p> <p><b>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；</b>  <b>2、目标ETF终止上市；</b>  <b>3、目标ETF基金合同终止；</b>  <b>4、目标ETF与其他基金进行合并；</b>  <b>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）；</b>  <b>6、中国证监会规定的其他情形。</b></p> <p>八、<b>基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法</b>  .....</p> <p>九、<b>侧袋机制的实施和投资运作安排</b></p>
<p><b>第十三部分 基金的财产</b></p>	<p>一、<b>基金资产总值</b>  <b>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。</b></p>	<p>一、<b>基金资产总值</b>  <b>基金资产总值是指基金拥有的目标ETF基金份额、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。</b></p>
<p><b>第十四部</b></p>	<p>一、<b>估值日</b>  <b>本基金的估值日为本基金相关的证券交</b></p>	<p>一、<b>估值日</b>  <b>本基金的估值日为本基金相关的证券、期</b></p>

<p><b>分基金资产估值</b></p>	<p>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（含存托凭证）、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、其它投资等资产及负债。</p> <p>.....</p> <p>四、估值方法</p>	<p><b>货</b>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<u>目标ETF基金份额</u>、股票（含存托凭证）、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、其它投资等资产及负债。</p> <p>.....</p> <p>四、估值方法</p> <p><b><u>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。</u></b></p> <p>○ (后续序号依此调整)</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><del>3</del>、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、法律法规规定、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>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货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><b><u>3、所投资的目标ETF暂停估值、暂停公告基金份额净值时；</u></b></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、法律法规规定、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13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><b>第十五部分</b></p>	<p>一、基金费用的种类</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p><b><u>10、基金投资目标ETF的相关费用；</u></b>（后续序号依次调整）</p>

<p><b>基金费用与税收</b></p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5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、公休假或不可抗力等，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0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。</p> <p>……</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p>E为前一日的基金资产净值<b>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。</b></p> <p><b>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。</b></p> <p>基金管理费每日计提，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双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5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、公休假或不可抗力等，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0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>E为前一日的基金资产净值<b>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。</b></p> <p><b>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。</b></p> <p>基金托管费每日计提，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双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。</p> <p>……</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><b>第十七部</b></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</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</p>

分基金的会计与审计	<p>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；<del>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；</del></p> <p>.....</p>	<p>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>
第十八部分基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>.....</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<del>认购</del>—申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。</p> <p>.....</p> <p><del>4、基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。</del></p> <p><del>（二）基金份额发售公告</del></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规定媒介上。</p> <p><del>（三）《基金合同》生效公告</del></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规定报刊和规定网站上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>（四）基金净值信息</p> <p>.....</p> <p>（五）基金份额申购、赎回价格</p> <p>.....</p> <p>（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）</p> <p>.....</p> <p><del>《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</del></p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（一）基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>.....</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。</p> <p>.....</p> <p>（二）基金净值信息</p> <p>.....</p> <p>（三）基金份额申购、赎回价格</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（含资产组合季度报告）</p> <p>.....</p> <p>（五）临时报告</p> <p>.....</p> <p><u>25、变更目标ETF；</u></p> <p>.....</p> <p>（后续序号依次调整）</p> <p><u>（十四）投资目标ETF的信息披露</u></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>报告或者年度报告。</p> <p>.....</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>.....</p> <p>8、<del>基金募集期延长或提前结束募集；</del></p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>(后续序号依次调整)</p>
第二十二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》<del>经基金管理人、基金托管人双方加盖公章(或合同专用章)以及双方法定代表人或授权代表签字(或盖章)并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。</del></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》<u>由《博时中证A500指数型证券投资基金基金合同》修订而来。自2024年11月29日起,本基金合同生效,《博时中证A500指数型证券投资基金基金合同》失效。</u></p> <p>.....</p>
第二十四部分基金合同内容摘要		<p>基金合同摘要修改同基金合同正文部分内容</p>

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系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,<del>拟募集发行博时中证A500指数型证券投资基金</del>;</p> <p>鉴于招商银行股份有限公司系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的资格和能力;</p> <p>鉴于博时基金管理有限公司拟担任博时中证A500指数型证券投资基金的基金管理人,招商银行股份有限公司拟担任博时中证A500指数型证券投资基金的基金托管人;</p> <p>为明确博时中证A500指数型证券投资基金的基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系,特制订本托管协议;</p>	<p>鉴于博时基金管理有限公司系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>鉴于招商银行股份有限公司系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的资格和能力;</p> <p>鉴于博时基金管理有限公司拟担任博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金管理人,招商银行股份有限公司拟担任博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金托管人;</p> <p>为明确博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系,特制订本托管协议;</p>

	<p>除非另有约定,《<b>博时中证A500指数型证券投资基金</b>基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义,若有抵触应以基金合同为准,并依其条款解释。</p> <p>若本基金实施侧袋机制的,侧袋机制实施期间的相关安排按照基金合同的规定执行。</p>	<p>除非另有约定,《<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b>基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义,若有抵触应以基金合同为准,并依其条款解释。</p> <p>若本基金实施侧袋机制的,侧袋机制实施期间的相关安排按照基金合同的规定执行。</p>
<p><b>二、基金托管协议的依据、目的和原则</b></p>	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>本协议依据《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信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。</p>	<p>(一) 订立托管协议的依据</p> <p>本协议依据《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信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、<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>、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》等有关法律法规、基金合同及其他有关规定制订。</p>
<p><b>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</b></p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。</p> <p>1. 本基金的投资范围为: 本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。 ..... 本基金资产<b>投资</b>比例不低于基金资产的90%,<b>其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产</b>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、股票期权和国债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;<del>股指期货、股票期权、国债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。</del> ..... 2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为: (1) 本基金资产<b>投资</b>比例不低于基金</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,对基金投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。</p> <p>1. 本基金的投资范围为: 本基金主要投资于<b>目标ETF</b>、标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)。 ..... 本基金<b>投资于目标ETF</b>的资产比例不低于基金资产<b>净值</b>的90%,<b>且</b>不低于非现金基金资产的80%;<b>股指期货、股票期权、国债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。</b>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,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。 ..... 2. 本基金各类品种的投资比例、投资限制为: (1) 本基金<b>投资于目标ETF</b>的资产比例不低于基金资产<b>净值</b>的90%,<b>且</b>不低于非现金基金资产的80%;</p>

<p>资产的90%，<b>其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产</b>不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>.....</p> <p>除上述第（2）、（8）、（13）、（14）、（15）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</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<b>本</b>基金合同生效之日起开始。</p> <p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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，或以变更后的规定为准。</p> <p>3. 本基金财产不得用于以下投资或者活动：</p> <p>（1）承销证券；</p> <p>（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（3）从事承担无限责任的投资；</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>.....</p> <p>2. 基金管理人负责对本基金存款银行的评估与研究，建立健全银行存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。基金托管人负责对本基金银行定期存款业务的监督与核查，审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。</p> <p>（1）基金管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成基金财产损失的，由基金管理人承担责任。</p>	<p>.....</p> <p>除上述第（1）、（2）、（8）、（13）、（14）、（15）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、<b>目标ETF暂停申购/赎回或二级市场交易停牌</b>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。<b>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。</b></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基金合同生效之日起开始。</p> <p>法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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，或以变更后的规定为准。</p> <p>3. 本基金财产不得用于以下投资或者活动：</p> <p>（1）承销证券；</p> <p>（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（3）从事承担无限责任的投资；</p> <p>（4）买卖<b>除目标ETF外的</b>其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>.....</p> <p>2. 基金管理人负责对本基金存款银行的评估与研究，建立健全银行存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。基金托管人负责对本基金银行定期存款业务的监督与核查，审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。</p> <p>（1）基金管理人负责控制信用风险，<b>并承担因控制不力而造成的损失</b>。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行</p>
--	---

	<p>.....</p> <p>(三) 基金投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划付、账目核对、到期兑付、提前支取</p> <p>1. 基金投资银行存款协议的签订</p> <p>(1) 基金管理人应与符合资格的存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》(以下简称《总体合作协议》), 确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。</p>	<p>的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成基金财产损失的, 由基金管理人承担责任。</p> <p>.....</p> <p>(三) 基金投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划付、账目核对、到期兑付、提前支取</p> <p>1. 基金投资银行存款协议的签订</p> <p>(1) 基金管理人应与符合资格的存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》(以下简称“《总体合作协议》”), 确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由基金托管人与基金管理人共同商定。</p>
<p>五、基金财产的保管</p>	<p><del>(二) 基金募集期间及募集资金的验资</del></p> <p><del>1. 基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。</del></p> <p><del>2. 基金募集期满或基金停止募集时, 募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后, 基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金资金账户, 同时在规定时间内, 基金管理人应聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资, 出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。</del></p> <p><del>3. 若基金募集期限届满, 未能达到基金合同生效的条件, 由基金管理人按规定办理退款等事宜, 基金托管人应当予以必要的协助和配合。</del></p> <p>(三) 基金资金账户的开立和管理</p> <p>1. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户(也可称为“托管账户”), 保管基金的银行存款, 并根据基金管理人的指令办理资金收付。托管账户名称应为“<b>博时中证A500指数型证券投资基金</b>”, 预留印鉴为基金托管人印章。</p>	<p>(二) 基金资金账户的开立和管理</p> <p>1. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户(也可称为“托管账户”), 保管基金的银行存款, 并根据基金管理人的指令办理资金收付。托管账户名称应为“<b>博时中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金</b>”, 预留印鉴为基金托管人印章。</p> <p>(后续序号依次调整)</p>
<p>六、指令的发送、</p>	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p>.....</p> <p>对于指定时间出款的交易指令, 基金管</p>	<p>(三) 指令的发送、确认及执行的时间和程序</p> <p>.....</p> <p>对于指定时间出款的交易指令, 基金管理人</p>

<p><b>确认及执行</b></p>	<p>理人应提前2小时将指令发送至基金托管人；对于基金管理人于15:00以后发送至基金托管人的指令，基金托管人不保证当日出款，如出款不成功，基金托管人不承担责任。</p> <p>.....</p> <p>（五）基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序 基金托管人发现基金管理人发送的指令有可能违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、本协议或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知基金管理人，基金管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知基金管理人在法规规定期限内及时纠正。对于基金托管人事前难以监督的交易行为，基金托管人在事后履行了对基金管理人的通知义务后，即视为完全履行了其投资监督职责。对于基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、本协议或其他有关法律法规的规定造成基金财产损失的，由基金管理人承担<b>全部</b>责任，基金托管人免于承担责任。</p>	<p>应提前2小时将指令发送至基金托管人；对于基金管理人于15:00以后发送至基金托管人的指令，基金托管人不保证当日出款，<b>但应尽力执行</b>，如出款不成功，基金托管人不承担责任。</p> <p>.....</p> <p>（五）基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序 基金托管人发现基金管理人发送的指令有可能违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、本协议或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知基金管理人，基金管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知基金管理人在法规规定期限内及时纠正。对于基金托管人事前难以监督的交易行为，基金托管人在事后履行了对基金管理人的通知义务后，即视为完全履行了其投资监督职责。对于基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、本协议或其他有关法律法规的规定造成基金财产损失的，由基金管理人承担<b>相应</b>责任，基金托管人免于承担责任。</p>
<p><b>七、交易及清算交收安排</b></p>	<p>（一）选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <p>（3）基金管理人应责成其选择的期货公司对发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。</p> <p>由于交易结算报告的记载事项出现与实际交易结果和权益不符造成本基金估值计算错误的，应由基金管理人负责向数据发送方追偿，基金托管人不承担责任。</p>	<p>（一）选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构</p> <p>（3）基金管理人应责成其选择的期货公司对发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。</p> <p>由于交易结算报告的记载事项出现与实际交易结果和权益不符造成本基金估值计算错误的，应由基金管理人负责向数据发送方追偿，<b>基金托管人不承担责任，但应给予必要协助。</b></p>
<p><b>八、基金资产净值计算和会计核算</b></p>	<p>（六）基金财务报表与报告的编制和复核</p> <p>3. 财务报表的编制与复核时间安排 基金管理人、基金托管人应当在每月结束后5个工作日内完成月度报表的编制及复核；在每个季度结束之日起15个工作日内完成基金季度报告的编制及复核；在上半年结束之日起2个月内完成基金中期报告的编制及复核；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制及复核。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进</p>	<p>（六）基金财务报表与报告的编制和复核</p> <p>3. 财务报表的编制与复核时间安排 基金管理人、基金托管人应当在每月结束后5个工作日内完成月度报表的编制及复核；在每个季度结束之日起15个工作日内完成基金季度报告的编制及复核；在上半年结束之日起2个月内完成基金中期报告的编制及复核；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制及复核。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。基金年度报告的财务会计报告</p>

	行调整，调整以国家有关规定为准。基金年度报告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。 <del>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。</del>	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。
十、基金信息披露	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要、<del>基金份额发售公告、基金合同生效公告</del>、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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（含资产组合季度报告））、临时报告、澄清公告、清算报告、基金份额持有人大会决议、参与股指期货、国债期货交易、投资股票期权、资产支持证券、非公开发行股票的信息披露、实施侧袋机制期间的信息披露、参与融资和转融通证券出借业务的信息披露及中国证监会规定的其他信息。基金年度报告中的财务会计报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p>	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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（含资产组合季度报告））、临时报告、澄清公告、清算报告、基金份额持有人大会决议、参与股指期货、国债期货交易、投资股票期权、资产支持证券、非公开发行股票的信息披露、实施侧袋机制期间的信息披露、参与融资和转融通证券出借业务的信息披露、投资目标ETF的信息披露及中国证监会规定的其他信息。基金年度报告中的财务会计报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p> <p>.....</p> <p><b><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></b></p> <p><b><u>1、投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；</u></b></p> <p><b><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></b></p> <p><b><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></b></p> <p><b><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></b></p>
十一、基金费用	<p>(一) 基金托管费的计提方法、计提标准和支付方式如下：</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月</p>	<p>(一) 基金托管费的计提方法、计提标准和支付方式如下：</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值<b>已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净</b></p>

	月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。	<u>额，金额为负时以零计。</u> <u>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。</u> 基金托管费每日计提，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双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。
十六、托管协议的变更、终止与基金财产的清算	<p>(二) 基金托管协议终止的情形</p> <p>1、《基金合同》终止；</p> <p>2、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；</p> <p>3、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；</p> <p>4、发生法律法规或《基金合同》规定的其他终止事项。</p>	<p>(二) 基金托管协议终止的情形</p> <p>1、《基金合同》终止；</p> <p>2、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；</p> <p>3、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；</p> <p>4、发生法律法规、<u>中国证监会</u>或《基金合同》规定的其他终止事项。</p>
十九、托管协议的效力	<p>双方对托管协议的效力约定如下：</p> <p>(一) <del>基金管理人向中国证监会申请发售基金份额时提交的</del>托管协议草案，<del>一</del>应经托管协议当事人双方盖章（公章或合同专用章）以及双方法定代表人或授权代表签字（或签章），<del>协议当事人双方根据中国证监会的意见修改并正式签署</del>托管协议。<del>托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。</del></p> <p>(二) 托管协议自基金合同成立之日起成立，<del>一</del>自基金合同生效之日起生效。托管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>双方对托管协议的效力约定如下：</p> <p>(一) 托管协议应经托管协议当事人双方盖章（公章或合同专用章）以及双方法定代表人或授权代表签字（或签章）。</p> <p>(二) 托管协议自基金合同生效之日起生效。托管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>