

(上接A29版)

第十一部分 基金的投资	<p>除上述(2)、(7)、(10)、(11)、(19)情形之外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(19)项规定的,基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的,从其规定。</p> <p>如果法律法规或监管部门对上述投资组合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,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。</p>	<p>除上述(1)、(2)、(7)、(16)、(17)、(19)情形之外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、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、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。因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(19)项规定的,基金管理人不得新增出借业务。因证券市场波动、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、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第(1)项投资比例的,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。法律法规另有规定的,从其规定。</p> <p>基金管理人应当自转换为联接基金之日起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。</p> <p>如果法律法规或监管部门对上述投资组合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,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。</p>
第十一部分 基金的投资	<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、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动; (7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 <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的同意,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>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,但是投资目标ETF、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、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动; (7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 <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的同意,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>
第十一部分 基金的投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金投资组合的业绩比较基准为:中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。</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导致的指数不符合要求以及法律法规、监管机构另有规定的除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当对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,如更换基金标的指数、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,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。但若标的指数及业绩比较基准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名称变更、指数更名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在履行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告。</p> <p>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金投资组合的业绩比较基准为:中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。</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导致的指数不符合要求以及法律法规、监管机构另有规定的除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当对该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、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,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止,但仅“目标ETF发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。但若标的指数及业绩比较基准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名称变更、指数更名等),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人可在履行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告。</p> <p>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</p>
第十一部分 基金的投资	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为股票型基金,其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。本基金为指数量型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为ETF联接基金,其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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>
第十一部分 基金的投资	<p>七、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</p> <p>1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利,保护基金份额持有人的利益;</p>	<p>七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法</p> <p>1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益;</p>
第十一部分 基金的投资		<p>八、目标ETF发生相关变更情形时的处理</p> <p>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者对目标ETF的联接基金变更直接投资该标的指数的指数基金;若届时本基金管理人已将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,履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地,本基金《基金合同》中将去掉关于目标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>若目标ETF变更标的指数,本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF,但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的,本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决,目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的,本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。</p> <p>九、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。</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>
第十二部分 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各类证券及票据价值、目标ETF基金份额、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>
第十三部分 基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、存托凭证、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>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标ETF份额、股票、存托凭证、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>四、估值方法</p>

第十三部分 基金资产估 值	七、暂停估值的情形 3、当某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时，经与基金管理人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；	七、暂停估值的情形 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； 4、基金管理人所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形
第十三部分 基金资产估 值	九、特殊情况的处理 1、基金管理人、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。	九、特殊情况的处理 1、基金管理人、基金托管人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
第十三部分 基金资产估 值		十、实施侧袋机制期间的基金资产估值 本基金实施侧袋机制的，根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。
第十四部分 基金费用与 税收	一、基金费用的种类 4、基金标的指数许可使用费；	一、基金费用的种类 删除。
第十四部分 基金费用与 税收	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.5\% - \text{当年天数}$ 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核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5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、公休日等，支付日期顺延。	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金基金财产中投资于目标ETP的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持目标ETP基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.5\% - \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETP基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则取0 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核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5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、公休日等，支付日期顺延。
第十四部分 基金费用与 税收	2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% - \text{当年天数}$ 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核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。	2、基金托管人的托管费 本基金基金财产中投资于目标ETP的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持目标ETP基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% - \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETP基金份额部分的基金资产净值后的余额，若为负数，则取0 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核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
第十四部分 基金费用与 税收	4、基金的指数许可使用费 本基金指数许可使用费分为许可使用固定费和许可使用基点费，其中许可使用基点费由基金管理人承担。 本基金指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的万分之二（2个基点）的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年费率} - \text{当年天数}$ H 为每日应付的指数许可使用基点费 E 为前一日的基金资产净值 指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。自基金合同生效日起，基金管理人、基金托管人和指数供应商核对一致后，于每年1月、4月、7月、10月的前10个工作日日内，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用基点费划款指令，按照确认的金额和指定的账户路径将上一季度的指数许可使用基点费从基金财产中一次性支付给指数供应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 许可使用基点费的收取下限为每季度人民币8000元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。 基金管理人可根据指数使用许可协议和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用基点费费率、计费方式及支付方式，基金管理人必须依照有关规定最近于新的费率、计费方式及支付方式实施日前2日在指定媒介上刊登公告。	删除。
第十四部分 基金费用与 税收	上述“一、基金费用的种类”中第5—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，由基金管理人从基金财产中支付。	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，由基金管理人从基金财产中支付。
第十四部分 基金费用与 税收	三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用：	三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用：根据《天弘中证全债指数公司型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行；
第十四部分 基金费用与 税收		四、实施侧袋机制期间的基金费用 本基金实施侧袋机制的，从侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应列于侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。
第十五部分 基金的收益 与分配		七、实施侧袋机制期间的收益分配 本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。
第十六部分 基金的会计 与审计	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则确定：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
第十六部分 基金的会计 与审计	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。	二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
第十七部分 基金的信息 披露	二、信息披露义务人 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。	二、信息披露义务人 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。
第十七部分 基金的信息 披露	五、公开披露的基金信息 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，说明基金份额认购、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指定网站上；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。	五、公开披露的基金信息 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，说明基金份额认购、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指定网站上；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。
第十七部分 基金的信息 披露	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、《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上，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指定网站上，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网站上。	删除。
第十七部分 基金的信息 披露	(二)基金份额发售公告 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。	删除。
第十七部分 基金的信息 披露	(三)《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。基金合同生效公告中应说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额，承诺持有的期限等情况。	删除。
第十七部分 基金的信息 披露	(六)基金定期报告，包括基金年度报告、中期报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个半月内，编制基金年度报告，并将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。 基金管理人应在年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额，期限及期间的变动情况。如将来法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。	(四)基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个半月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。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。 基金管理人应在年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人持有基金的份额、期限及期间的变动情况。如将来法律法规或中国证监会将有另行规定的，从其规定。