（上接B011版）

| | | |
|---|---|---|
| 基金份额的申购与赎回 | 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形<br>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。<br>5、接受赎回申请将招致实现有基金份额持有人利益的情形时。<br>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以受理赎回申请当日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。 | 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形<br>3、证券、期货交易所或外汇市场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。<br>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。<br>6、基金开投资的投资品种的估值出现重大转变时。<br>7、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。<br>8、目标ETF暂停申赎、暂停上市或目标ETF停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。<br>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以受理赎回申请当日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。 |
| 基金份额的申购与赎回 | 九、巨额赎回的情形及处理方式<br>2.巨额赎回的处理方式<br>（b）赎回申请日，若已披露的基金份额净值会影响基金份额持有人相对利益的，遵循“基金份额持有人利益优先”原则，基金管理人有权采用更高精度的基金份额净值（小数点后保留至第8位，小数点后第9位四舍五入）计算当日的赎回金额和申购、定期定额申购份额。在这种情况下，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。<br>（2）部分延期赎回：……若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%，基金管理人应当先行对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请一并按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”约定的方式进行一并处理，具体见招募说明书或相关公告。<br>（3）暂停赎回：连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。<br>3.巨额赎回的公告<br>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在2日内在指定媒介上刊登公告。<br>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告<br>1.发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。<br>3.基金管理人可根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告；也可根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。 | 九、巨额赎回的情形及处理方式<br>2.巨额赎回的处理方式<br>（b）赎回申请日，若已披露的基金份额净值会影响基金份额持有人相对利益的，遵循“基金份额持有人利益优先”原则，基金管理人有权采用更高精度的基金份额净值（小数点后保留至第8位，小数点后第9位四舍五入）计算当日的赎回金额和申购、定期定额申购份额。在这种情况下，基金管理人应当按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。<br>（2）部分延期赎回：……若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%，基金管理人应当先行对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人10%以内（含10%）的赎回申请与其他投资者的赎回申请一并按上述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”约定的方式进行一并处理，具体见招募说明书或相关公告。<br>（3）暂停赎回：连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。<br>3.巨额赎回的公告<br>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在2日内在规定媒介上刊登公告。<br>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告<br>1.发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。<br>3.基金管理人可根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告；也可根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。 |
| 基金份额的申购与赎回 | 十六、基金份额折算<br>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对基金份额进行折算，不需召开基金份额持有人大会审议。<br>十九、当技术条件成熟，本基金管理人在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，可根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，或者安排本基金的一类或多类基金份额在证券交易所上市交易、申购和赎回，或者办理基金份额的转让、过户、质押等业务，届时无须召开基金份额持有人大会审议，但应根据相关法规规定进行信息披露。 | 十六、基金份额折算<br>在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对基金份额进行折算，不需召开基金份额持有人大会审议。<br>十九、当技术条件成熟，本基金管理人在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，可根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，或者安排本基金份额在证券交易所上市交易、申购和赎回，或者办理基金份额的转让、过户、质押等业务，届时无须召开基金份额持有人大会审议，但应根据相关法规规定进行信息披露。 |
| 基金份额持有人大会 | 一、基金管理人<br>（二） 基金管理人的权利与义务<br>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：<br>（1）依法募集基金；<br>（15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；<br>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：<br>（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；<br>（8） 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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；<br>（10）编制季度、中期和年度基金报告；<br>（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表，记录和其他相关资料15年以上；<br>（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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；<br>（25） 执行生效的基金份额持有人大会的决定； | 一、基金管理人<br>（二） 基金管理人的权利与义务<br>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：<br>（1）依法募集基金；<br>（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；<br>（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；<br>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：<br>（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回登记事宜；<br>（3）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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；<br>（10）编制季度、中期和年度基金报告；<br>（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表，记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低年限；<br>（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议； |
| 基金合同当事人及权利义务 | 二、基金托管人<br>（一） 基金托管人简况<br>法定代表人：陶以平<br>（二） 基金托管人的权利与义务<br>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：<br>（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；<br>（4） 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；<br>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：<br>（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；<br>（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；<br>（15）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会； | 二、基金托管人<br>（一） 基金托管人简况<br>法定代表人：吕家进<br>（二） 基金托管人的权利与义务<br>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：<br>（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；<br>（4）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；<br>（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低年限；<br>（15）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；<br>（21） 执行生效的基金份额持有人大会的决议； |
| 基金合同当事人及权利义务 | 三、基金份额持有人<br>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：<br>（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；<br>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：<br>（4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；<br>（7）执行生效的基金份额持有人大会的决定； | 三、基金份额持有人<br>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：<br>（3） 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；<br>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：<br>（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；<br>（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议； |
| 基金份额持有人大会 | 本基金份额持有人大会不设日常机构。 | 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直接参加或者委派代表参加目标ETF基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会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基金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。本基金份额折算为目标ETF后的每一参会份额和目标ETF的每一参会份额拥有平等的投票权。若本基金日用侧袋机制且特定资产不包括目标ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标ETF基金份额持有人大会并表决。<br>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，但可授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。<br>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会。<br>本基金份额持有人大会不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。 |
| 基金份额持有人大会 | 一、召开事由<br>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：<br>（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；<br>2、在法律法规和基金合同规定的范围内，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：<br>（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内，对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；<br>（6）在不违反法律法规、基金合同以及不对基金份额持有人权益产生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，基金管理人可根据实际情况，经与基金托管人协商，调整本基金份额类别的设置；<br>（7）在不违反法律法规、基金合同以及在不损害已有基金份额持有人权益的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；<br>（8）在不违反法律法规、基金合同以及在不损害已有基金份额持有人权益的前提下，基金推出新业务或服务； | 一、召开事由<br>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：<br>（11）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份额持有人大会；<br>（13）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；<br>2、在法律法规和基金合同规定的范围内，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：<br>（3）调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；<br>（6）根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人可根据实际情况，经与基金托管人协商，调整本基金份额类别的设置；<br>（7）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；<br>（8）本基金的基金总资产不得超过基金净资产的140%；<br>（9）本基金投资于股指期货，还应遵循如下投资组合限制：<br>1）在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的10%，卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的20%；<br>2）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的80%；<br>3）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、买入返售金融资产（不含质押式回购）等； |
| 基金份额持有人大会 | 二、会议召集人及召集方式<br>1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；<br>2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；<br>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式<br>1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：<br>（4）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、授权方式、送达时间和地点；<br>四、基金份额持有人出席会议的方式<br>1、现场开会：由基金份额持有人本人出席或以代理权票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：<br>（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；<br>2、通讯开会。……<br>（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。 | 二、会议召集人及召集方式<br>1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。<br>2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。<br>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式<br>1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：<br>（4）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、授权方式、送达时间和地点；<br>四、基金份额持有人出席会议的方式<br>1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理权票授权委托书委派代表出席。现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：<br>（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；<br>2、通讯开会。……<br>（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。 |
| 基金份额持有人大会 | 八、生效与公告<br>基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。 | 八、生效与公告<br>基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。 |
| 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 | 二、基金管理人和基金托管人的更换程序<br>（一）基金管理人的更换程序<br>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；<br>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告；<br>（二）基金托管人的更换程序<br>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；<br>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告；<br>（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序<br>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介上联合公告。 | 二、基金管理人和基金托管人的更换程序<br>（一）基金管理人的更换程序<br>2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；<br>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告；<br>（二）基金托管人的更换程序<br>2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，并自表决通过之日起生效；<br>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告；<br>（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序<br>3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介上联合公告。 |
| 基金份额的登记 | 三、基金登记机构的权利<br>4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告； | 三、基金登记机构的权利<br>4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在规定媒介上公告； |
| 基金的投资 | 一、投资目标<br>本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。<br>二、投资范围<br>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证500质量成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册的上市股票、存托凭证）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。<br>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。<br>基金的投资组合比例为：本基金投资于中证500质量成长指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金及应收申购款等。 | 一、投资目标<br>通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。<br>二、投资范围<br>本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可少量投资于非成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称港股通标的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、资产支持证券、债券回购、信用衍生品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。<br>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。<br>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。<br>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；投资于港股通标的股票的比例不得超过本基金所投资股票资产的50%；本基金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，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、存出保证金及应收申购款等。 |
| 基金的投资 | 三、投资策略<br>本基金采用被动式指数化投资方法，按照中证500质量成长指数中的成份股构成及其权重构建股票投资组合，以跟踪中证500质量成长指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。<br>（一）资产配置策略<br>本基金投资人主要投照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动进行相应调整。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求和法律法规限制等因素确定各类资产的具体配置比例。<br>本基金将对基金组合与指数表现的跟踪偏离度和跟踪误差保持动态监控，每月定期分析基金组合与标的指数表现的累积偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪误差管理方案，实现对跟踪偏离度和跟踪误差的有效控制。本基金对标的指数的跟踪目标是：在正常情况下，力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。<br>（二）股票投资策略<br>1、股票投资策略<br>（1）根据目标ETF的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以中期目标ETF。因此对标的指数成份股、备选成份股的投资，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。本基金将根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。<br>（四）衍生品投资策略<br>1.本基金进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适当参与股指期货的投资。通过利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，改善组合的风险收益特性，从而实现套期保值；同时，还可利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率，从而实现有效管理。<br>2.本基金进行国债期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。<br>3.本基金进行股票期权投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分评估股票期权的流动性、风险收益特征等，同时结合对证券市场的判断，优选出估值合理的期权合约，从而有效地实现基金资产的增值及对下跌风险的控制。<br>（五）其他投资策略<br>1.资产支持证券投资策略<br>本基金资产支持证券投资将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。<br>2.融资投资策略<br>本基金参与融资业务，将在综合考虑风险、收益、流动性等因素的基础上，通过对市场行情、组合风险收益、信用资质等条件的详细分析，选择合适的交易对手方，确定明确的投资时机及合理的融资比例。若相关业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合法律法规和监管要求的变化。<br>3.参与转融通证券出借业务<br>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与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、期限以及投资比例。若相关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，以符合法律法规和监管要求的变化。<br>4.信用衍生品投资策略<br>本基金投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的。根据投资组合所持标的债券等固定收益品种的投资策略，以及潜在信用风险等情况，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等，从而实现有效地信用风险管理。同时，本基金还将对信用衍生品交易对手方、创设机构加强风险管理，合理分散相应集中度，且对其进行必要的尽职调查与严格的准入管理。<br>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。 | 三、投资策略<br>本基金为目标ETF的联接基金，通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。<br>（一）目标ETF投资策略<br>本基金投资目标ETF的方式如下：<br>（1）申购、赎回：按照目标ETF法律文件约定的方式申赎目标ETF。<br>（2）二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。<br>当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。<br>本基金将在充分考虑占用、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标ETF的投资。<br>（二）股票投资策略<br>1、股票投资策略<br>基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以中期目标ETF。因此对标的指数成份股、备选成份股的投资，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。本基金将根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。<br>（四）衍生品投资策略<br>1.本基金进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适当参与股指期货的投资。通过利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，改善组合的风险收益特性，从而实现套期保值；同时，还可利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率，从而实现有效管理。<br>2.本基金进行国债期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。<br>3.本基金进行股票期权投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分评估股票期权的流动性、风险收益特征等，同时结合对证券市场的判断，优选出估值合理的期权合约，从而有效地实现基金资产的增值及对下跌风险的控制。<br>（五）其他投资策略<br>1.资产支持证券投资策略<br>本基金资产支持证券投资将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。<br>2.融资投资策略<br>本基金参与融资业务，将在综合考虑风险、收益、流动性等因素的基础上，通过对市场行情、组合风险收益、信用资质等条件的详细分析，选择合适的交易对手方，确定明确的投资时机及合理的融资比例。若相关业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合法律法规和监管要求的变化。<br>3.参与转融通证券出借业务<br>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与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、期限以及投资比例。若相关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，以符合法律法规和监管要求的变化。<br>4.信用衍生品投资策略<br>本基金投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的。根据投资组合所持标的债券等固定收益品种的投资策略，以及潜在信用风险等情况，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等，从而实现有效地信用风险管理。同时，本基金还将对信用衍生品交易对手方、创设机构加强风险管理，合理分散相应集中度，且对其进行必要的尽职调查与严格的准入管理。 |
| 基金的投资 | 四、投资限制<br>1、组合限制<br>基金的投资组合应遵循以下限制：<br>（1）本基金投资于中证500质量成长指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；<br>（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保证现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。<br>（3）本基金投资于资产支持证券时，需遵守下列投资比例限制：<br>①本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；<br>②本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；<br>③本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；<br>④本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；<br>⑤本基金投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券，基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。<br>（4）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。<br>（5）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。<br>（6）本基金参与国债期货、股指期货交易时，需遵守下列投资比例限制：<br>①本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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30%；<br>②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%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；<br>③本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；<br>④本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；<br>⑤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约定。<br>（7）本基金参与股票期权交易时，需遵守下列投资比例限制：<br>①因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；<br>②开仓卖出认购期权的，应持有足额的标的证券；开仓卖出认沽期权