关于易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金变更为易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修订基金合同和托管协议的公告

易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金（以下简称“易方达中证光伏产业指数发起式”）于2023年4月11日成立。《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）约定：“若基金管理人注册并成立追踪标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该ETF的联接基金。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。”

本公司旗下易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金（场内简称“光伏E”，扩位证券简称“光伏ETF易方达”，基金代码“562970”）已于2024年10月30日成立，并于2024年11月7日起在上海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，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定和基金合同的相关约定，本公司经与基金托管人华泰证券股份有限公司协商一致，决定于2024年12月17日起，将易方达中证光伏产业指数发起式变更为易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“易方达中证光伏产业ETF联接发起式”），并根据上述事项、法律法规、基金实际运作情况及基金托管人信息更新等相应修订基金合同、托管协议等法律文件相关条款。

现将具体事宜公告如下：

一、基金名称变更

易方达中证光伏产业指数发起式变更为易方达中证光伏产业ETF联接发起式当日，基金份额简称调整如下：

1. 原易方达中证光伏产业指数发起式A类基金份额简称“易方达中证光伏产业指数发起式A”变更为“易方达中证光伏产业ETF联接发起式A”，基金代码“017646”不变。

2. 原易方达中证光伏产业指数发起式C类基金份额简称“易方达中证光伏产业指数发起式C”变更为“易方达中证光伏产业ETF联接发起式C”，基金代码“017647”不变。

前述调整不影响各类基金份额净值的计算。

二、修订的《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》和《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》自2024年12月17日起生效。

三、重要提示

1. 本次基金合同修订系根据基金合同约定变更为联接基金而作出，属于基金合同约定的不需召开基金份额持有人大会的事项；并根据法律法规及基金的实际运作对相关条款进行必要的调整和修改，对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，根据基金合同的约定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. 本公司于公告当日在本公司网站（www.efunds.com.cn）上同时公布修订后的基金合同、托管协议以及相应更新的招募说明书及产品资料概要。

3. 变更生效后，A类基金份额申购费率及赎回费率、C类基金份额的销售服务费率及赎回费率保持不变，同时易方达中证光伏产业ETF联接发起式的日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务照常办理。对于本次变更前基金份额持有人持有的易方达中证光伏产业指数发起式基金份额，变更后，其原基金份额持有期将计入易方达中证光伏产业ETF联接发起式基金份额的持有期。

4. 本基金为发起式基金，本基金发起资金认购的易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金份额自原《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》生效日（即2023年4月11日）起持有不少于3年，持有满3年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时发起资金提供方有可能赎回前述基金份额变更后的易方达中证光伏产业ETF联接发起式基金份额。另外，原《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》生效之日（即2023年4月11日）起三年后的年度对应日，若基金资产净值低于2亿元，《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金合同》自动终止。

5. 本公告仅对易方达中证光伏产业指数发起式变更为易方达中证光伏产业ETF联接发起式事项予以说明。投资者欲了解易方达中证光伏产业ETF联接发起式的详细情况，可登录本公司网站（www.efunds.com.cn）查阅基金合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件及相关公告。

6. 投资者可通过以下途径咨询详情：

易方达基金管理有限公司

客户服务中心电话：400-881-8088

网址：www.efunds.com.cn

7. 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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

附件：易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金变更前后基金合同、托管协议对照表

易方达基金管理有限公司

2024年12月11日

附件：易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金变更前后基金合同、托管协议对照表

一、基金合同修订对照表

修改章节	《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》	《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》
第一部分前言	三、易方达中证光伏产业指数发起式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。 中国证监会对本基金募集的注册，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。	三、易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金变更而来，易方达中证光伏产业指数发起式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。 中国证监会对易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金募集的注册，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。
第二部分释义	1、基金或本基金：指易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金 4、基金合同或本基金合同：指《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新 8、基金份额发售公告：指《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金份额发售公告》 18、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会 25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 30、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 31、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 33、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月 41、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 50、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 57、A类基金份额：在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再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 58、C类基金份额：从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额	1、基金或本基金：指易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金变更而来，易方达中证光伏产业指数发起式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。 中国证监会对易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金募集的注册，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。 4、基金合同或本基金合同：指《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要》及其更新 删除 增加： 9、目标ETF：指易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金 10、ETF联接基金：指将绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF（以下简称目标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，简称联接基金 11、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局 26、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 31、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 32、基金合同生效日：指《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效日，原《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》自同一日失效 删除 删除 49、基金资产总值：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、基金应收申购款及其他资产的价值总和 56、A类基金份额：在投资人申购基金时收取申购费用，并不再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 57、C类基金份额：从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为C类基金份额
第三部分基金的基本情况	一、基金名称 易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金 二、基金的类别 股票型证券投资基金、指数基金 五、标的指数 中证光伏产业指数 六、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为1000万份。 七、发起资金的认购金额下限、持有期限下限 认购本基金的发起资金金额不少于1000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年，法律法规、中国证监会另有规定的除外。 八、基金份额面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金认购费率按招募说明书的规定执行。 十、基金份额的类别 本基金将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再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；从本类基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。具体费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。 本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。 投资人在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见招募说明书或相关公告。 十一、若基金管理人注册并成立追踪标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该ETF的联接基金。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。	一、基金名称 易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 二、基金的类别 指数基金、联接基金 五、目标ETF及基金的标的指数 本基金的目标ETF为易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金，简称“易方达中证光伏产业ETF”，标的指数为中证光伏产业指数。 删除 删除 删除 七、基金份额的类别 本基金将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费用，并不再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；从本类基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为C类基金份额。具体费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。 本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。 投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见招募说明书或相关公告。 删除 增加： 八、本基金与目标ETF的联系与区别 本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别。 本基金与目标ETF之间的联系：（1）两只基金的投资目标均为紧密跟踪业绩比较基准；（2）两只基金具有相似的风险收益特征；（3）目标ETF是本基金的主要投资对象。 本基金与目标ETF之间的区别：（1）在基金的投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。（2）在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所买卖目标ETF的基金份额，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求申赎目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，投资者可以通过基金管理人及非直销销售机构按未知价法进行基金的申购与赎回。 本基金与目标ETF业绩表现仍可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括：（1）法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。（2）申购赎回的影响。目标ETF采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金资产净值产生一定影响。

修改章节	《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金托管协议》	《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》
	鉴于易方达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，拟将易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金变更为易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金； 鉴于易方达基金管理有限公司拟担任易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金的基金管理人，华泰证券股份有限公司拟担任易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金托管人； 为明确易方达中证光伏产业指数发起式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： 除非另有约定，《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《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。	鉴于易方达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，拟将易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金变更为易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金； 鉴于易方达基金管理有限公司拟担任易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金管理人，华泰证券股份有限公司拟担任易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金托管人； 为明确易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式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： 除非另有约定，《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（以下简称“《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。
一、托管协议当事人	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 名称：易方达基金管理有限公司 办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-42楼 （二）基金托管人（或简称“托管人”） 名称：华泰证券股份有限公司（简称：华泰证券） 注册资本：907558.9027万人民币	（一）基金管理人（或简称“管理人”） 名称：易方达基金管理有限公司 删除 （二）基金托管人（或简称“托管人”） 名称：华泰证券股份有限公司（简称：华泰证券） 注册资本：902730.2281万人民币
二、托管协议的依据、目的、原则和解释	（一）依据 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》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号（托管协议的内容与格式）》、《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》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《易方达中证光伏产业指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。	（一）依据 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》）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号（托管协议的内容与格式）》、《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》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 1、基金托管人根据《关于证券投资基金若干问题的暂行规定》、《关于证券投资基金运作管理有关问题的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号（托管协议的内容与格式）》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金流动性风险管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号（托管协议的内容与格式）》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号（托管协议的内容与格式）》、《证券投资基金流动性风险管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《易方达中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）及其他有关法律、法规制定。 本基金的投资范围包括目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票（包括创业板、科创板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的资产不低于基金资产净值的90%，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。 1、目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下： （1）申购、赎回方式：按照目标ETF法律文件约定的方式申购、赎回目标ETF。 （2）二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。 本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回方式或二级市场方式进行目标ETF的投资。 2、股票（含存托凭证）投资策略 本基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪业绩比较基准。同时，在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标ETF。因此对可投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸，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。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个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。 四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于目标ETF的资产不低于基金资产净值的90%； （10）本基金参与股指期货交易的，应当符合下列要求：在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指目标ETF、股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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及目标ETF总市值的20%；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；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%；每个交易日日终，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 除上述（2）、（7）、（8）、（13）、（14）、（15）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、流动性限制、或成份股市场价格变化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、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不符合第（13）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规或监管部门另有规定的，届时按最新规定执行。 五、业绩比较基准 本基金以“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标，在投资中将不低于基金资产净值90%的资产投资于标的指数成份股及备选成份股并保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，因此选取“中证光伏产业指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%”作为业绩比较基准，能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。 六、风险收益特征 本基金为ETF联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。 增加： 七、目标ETF发生相关变更情形的处理方式 目标ETF出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。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。 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； 2、目标ETF终止上市； 3、目标ETF基金合同终止； 4、目标ETF与其他基金进行合并； 5、目标ETF的基金管理人发生变更； 6、中国证监会规定的其他情形。 若目标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。	（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围进行监督。 本基金的投资范围包括目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票（包括创业板、科创板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的80%且不低于基金资产净值的90%，其中，有价证券指目标ETF、股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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及目标ETF总市值的20%；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；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%；每个交易日日终，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 除上述（2）、（7）、（8）、（13）、（14）、（15）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、流动性限制、或成份股市场价格变化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、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不符合第（13）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规或监管部门另有规定的，届时按最新规定执行。 五、业绩比较基准 本基金以“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标，在投资中将不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF并保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，因此选取“中证光伏产业指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%”作为业绩比较基准，能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。 六、风险收益特征 本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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。
第十二部分基金的投资	二、投资范围 本基金的投资范围包括标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他股票（包括创业板、科创板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的资产不低于基金资产净值的90%，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。 三、投资策略 本基金为目标ETF的联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致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误差进一步扩大。 1、目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下： （1）申购、赎回方式：按照目标ETF法律文件约定的方式申购、赎回目标ETF。 （2）二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。 本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回方式或二级市场方式进行目标ETF的投资。 2、股票（含存托凭证）投资策略 本基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪业绩比较基准。同时，在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标ETF。因此对可投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸，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。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个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。 四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于目标ETF的资产不低于基金资产净值的90%； （10）本基金参与股指期货交易的，应当符合下列要求：在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指目标ETF、股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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及目标ETF总市值的20%；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；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%；每个交易日日终，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等； 除上述（2）、（7）、（8）、（13）、（14）、（15）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、流动性限制、或成份股市场价格变化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、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不符合第（13）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规或监管部门另有规定的，届时按最新规定执行。 五、业绩比较基准 本基金以“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标，在投资中将不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF并保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，因此选取“中证光伏产业指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%”作为业绩比较基准，能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。 六、风险收益特征 本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。 增加： 七、目标ETF发生相关变更情形的处理方式 目标ETF出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会。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。 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； 2、目标ETF终止上市； 3、目标ETF基金合同终止； 4、目标ETF与其他基金进行合并； 5、目标ETF的基金管理人发生变更； 6、中国证监会规定的其他情形。 若目标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。
第十三部分基金的财产	一、基金资产总值 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。	一、基金资产总值 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。
第十四部分基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 四、估值方法 七、暂停估值的情形 九、特殊情况的处理 1、基金管理人或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。	二、估值对象 基金所拥有的目标ETF基金份额、股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 四、估值方法 增加： 1、目标ETF基金份额估值方法 对持有的目标ETF基金份额，按估值日目标ETF基金的份额净值估值。 七、暂停估值的情形 增加： 4、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形； 九、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第10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。
第十五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扣除前一日所持有目标ETF公允价值后的余额（若为负数，则取0）的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下： H＝E×0.50%÷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 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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下： H＝E×0.10%÷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	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扣除前一日所持有目标ETF