（上接B021版）

第十二部分 基金的投资	一、投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 二、投资范围 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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）。 …… 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货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。 三、投资策略 1、股票投资策略 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建本金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）指数成份股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因标的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。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 …… 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）本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%； …… （10）本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期； …… 除上述（2）、（8）、（14）、（15）、（16）情形外，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第（1）项规定投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整。除上述（1）、（2）、（8）、（13）、（14）、（15）情形外，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及法律法规另有规定的除外。 五、业绩比较基准 …… 本基金以“紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标，在投资中将不低于非现金基金资产的80%的资产投资于标的指数成份股及备选成份股，且每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货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，因此选取“国证新能源车电池指数收益率×95%+银行活期存款利率（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。 未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（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，基金合同终止。 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。 若基金标的指数发生变更（包括但不限于指数编制单位更名、指数更名等事项），基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据投资情况和市场惯例在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。 六、风险收益特征 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪国证新能源车电池指数，其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。 ……	一、投资目标 本基金通过主要投资于目标ETF，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。 二、投资范围 本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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）。 …… 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货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。 三、投资策略 1、股票投资策略 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建本金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）指数成份股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因标的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。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 …… 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）本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%； …… 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）项规定投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整。除上述（1）、（2）、（8）、（13）、（14）、（15）情形外，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及法律法规另有规定的除外。 五、业绩比较基准 …… 本基金以“通过主要投资于目标ETF，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，投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，且每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货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，因此选取“国证新能源车电池指数收益率×95%+银行活期存款利率（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。 未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（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，基金合同终止。但下文“目标ETF发生相关变更情形的处理方式”另有约定的除外。 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。 若基金标的指数发生变更（包括但不限于指数编制单位更名、指数更名等事项），基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据投资情况和市场惯例在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。 六、风险收益特征 本基金为ETF联接基金，所跟踪的目标ETF为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 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，其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。 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；若届时本基金管理人已有跟踪该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删除关于目标ETF的表述部分，或变更标的指数，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目标的指数事项的，本基金在履行适当程序后，可不召开基金份额持有人大会相应变更目标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。 ……	一、基金费用的种类 …… 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 …… 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。 三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： …… 3、《基金合同》生效前的相关费用； 4、标的指数许可使用费，本基金标的指数许可使用费由基金管理人承担； ……	一、基金费用的种类 …… 10、基金投资目标ETF的相关费用（包括但不限于目标ETF的交易费用、申赎费用等）； …… 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基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分（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扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0） …… 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扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）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扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0） …… 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。 三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： …… 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行； ……
第十五部分 基金费用与税收			
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：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； ……	
第十七部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告 …… 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。 …… 5、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。 基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的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，其中基金产品资料概要还应当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。 （二）《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规定媒介上登载《基金合同》生效公告。 （三）基金净值信息 《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 …… （六）临时报告 …… 8、基金募集期延长或提前结束募集； ……	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 …… 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。 …… （二）基金净值信息 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 …… （五）临时报告 …… 25、本基金变更目标ETF； …… （十四）基金投资目标ETF的相关公告 本基金在定期报告和招募说明书（更新）中应设立专门章节披露所持目标ETF的相关情况并揭示相关风险： 1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等； 2、交易及持有目标ETF产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等，在招募说明书（更新）中列明计算方法并举例说明； 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。 ……	
第十八部分 基金的投资	（二）《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规定媒介上登载《基金合同》生效公告。 （三）基金净值信息 《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 …… （六）临时报告 …… 8、基金募集期延长或提前结束募集； ……	（二）基金托管协议 …… 法定代表人：陈颖 经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算、票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务。	（二）基金托管人 …… 法定代表人：辛树人
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	（一）订立托管协议的依据 根据《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》、《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》、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关规定订立本托管协议。 …… （二）基金托管协议的效力 本基金托管协议经托管协议当事人双方盖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。 ……	（一）订立托管协议的依据 根据《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》、《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》、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关规定订立本托管协议。 …… （二）基金托管协议的效力 本基金托管协议经托管协议当事人双方盖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，于2026年2月13日生效，原《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》失效。 ……

二、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金托管协议》修订对照表

章节	原托管协议表述	修订后托管协议表述
全文	万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金	万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
（前言）	鉴于万家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，拟募集发行万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金； ……	鉴于万家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，拟将万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更为万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金；
一、基金托管协议当事人	（二）基金托管人 …… 法定代表人：陈颖 经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算、票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务。	（二）基金托管人 …… 法定代表人：辛树人
二、基金托管协议的依据、目的、原则和解释	（一）订立托管协议的依据 根据《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》、《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》、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关规定订立本托管协议。 …… （二）基金托管协议的效力 本基金托管协议经托管协议当事人双方盖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。 ……	（一）…… 本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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）。 …… 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的90%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货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。 本基金的投资组合遵循以下限制： （1）本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%； …… 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及法律法规另有规定的除外。 （四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。（如有） …… 基金管理人对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，应及时通知基金托管人，新名单自基金托管人确认后生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人确认，双方共同协商解决。如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人，经提醒后基金管理人仍未改正的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。如基金管理人在基金首次投资银行间债券市场之前仍未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为基金管理人认可全市场交易对手。 …… （五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。 基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并在基金投资存款之前及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督，如基金管理人未按要求提供存款银行名单，导致基金托管人无法有效履行监督职责，由此造成的损失和责任均由基金管理人承担。如基金管理人在基金首次投资银行存款之前仍未向基金托管人提供存款名单的，视为基金管理人认可所有银行。 （六）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督（如有） …… 2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。	（一）…… 本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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）。 …… 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的90%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货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。 本基金的投资组合遵循以下限制： （1）本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%； …… 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及法律法规另有规定的除外。 （四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。（如有） …… 基金管理人对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，应及时通知基金托管人，新名单自基金托管人确认后生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人确认，双方共同协商解决。如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人，经提醒后基金管理人仍未改正的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。如基金管理人在基金首次投资银行间债券市场之前仍未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为基金管理人认可全市场交易对手。 …… （五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。 基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并在基金投资存款之前及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督，如基金管理人未按要求提供存款银行名单，导致基金托管人无法有效履行监督职责，由此造成的损失和责任均由基金管理人承担。如基金管理人在基金首次投资银行存款之前仍未向基金托管人提供存款名单的，视为基金管理人认可所有银行。 （六）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督（如有） …… 2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行注册管理办法》规范的在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。 …… （十）基金托管人发现托管产品违反法律法规或合同约定进行投资的，应当拒绝执行；按照交易程序已经达成交易的或无法拒绝执行的，应当及时提示基金管理人等相关方。
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	（一）基金投资说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告 …… 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。 …… 5、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。 基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的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，其中基金产品资料概要还应当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。 （二）《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规定媒介上登载《基金合同》生效公告。 （三）基金净值信息 《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 …… （六）临时报告 …… 8、基金募集期延长或提前结束募集； ……	（一）…… 本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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）。 …… 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的90%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货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。 本基金的投资组合遵循以下限制： （1）本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%； …… 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及法律法规另有规定的除外。 （四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。（如有） …… 基金管理人对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，应及时通知基金托管人，新名单自基金托管人确认后生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人确认，双方共同协商解决。如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人，经提醒后基金管理人仍未改正的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。如基金管理人在基金首次投资银行间债券市场之前仍未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为基金管理人认可全市场交易对手。 …… （五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。 基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并在基金投资存款之前及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督，如基金管理人未按要求提供存款银行名单，导致基金托管人无法有效履行监督职责，由此造成的损失和责任均由基金管理人承担。如基金管理人在基金首次投资银行存款之前仍未向基金托管人提供存款名单的，视为基金管理人认可所有银行。 （六）基金托管人对基金投资流通受限证券的监督（如有） …… 2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行注册管理办法》规范的在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。 …… （十）基金托管人发现托管产品违反法律法规或合同约定进行投资的，应当拒绝执行；按照交易程序已经达成交易的或无法拒绝执行的，应当及时提示基金管理人等相关方。
四、基金财产的保管	（一）基金财产保管的原则 …… 6、对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、申购过程中产生的应收资产，如基金托管人无法从公开信息或基金管理人提供的书面资料中获取到账日期信息的，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知并配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何