（上接B047版）

| | | |
|---|---|---|
| 第八部分基金份额持有人大会 | 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。 | 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。 |
| | 一、召开事由<br>2、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调整本基金的申购费率、调低赎回费率或收费方式、调整基金份额类别；<br>（7）在符合有关法律法规，并且对持有人利益无实质性不利影响的前提下，经中国证监会允许，基金管理人、代销机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则； | 一、召开事由<br>2、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调整本基金的申购费率、调低销售服务费率、变更收费方式、调整基金份额类别；<br>（7）在符合有关法律法规，并且对持有人利益无实质性不利影响的前提下，经中国证监会允许，基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务的规则； |
| | 二、会议召集人及召集方式<br>4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。 | 二、会议召集人及召集方式<br>4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。 |
| | 四、基金份额持有人出席会议的方式<br>2、通讯开会。……<br>（5）上述第（3）、（4）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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，并与基金登记注册机构记录相符；<br>（6）会议通知公布前报中国证监会备案。 | 四、基金份额持有人出席会议的方式<br>2、通讯开会。……<br>（5）上述第（3）、（4）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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。 |
| | 六、表决<br>……<br>2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。 | 六、表决<br>……<br>2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、监管机构另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。 |
| | 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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。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。 |
| | 无 | 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定<br>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：<br>1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；<br>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；<br>3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；<br>4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；<br>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；<br>6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；<br>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。<br>侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一类别账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。<br>侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关规定。 |
| 第九部分基金管理人、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>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；<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>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；<br>7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；<br>（二）基金托管人的更换程序<br>4、备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须报中国证监会备案；<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>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；<br>7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。<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>4、备案：基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须报中国证监会备案；<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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告；<br>6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值；<br>7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支；<br>（二）基金托管人的更换程序<br>4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；<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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告；<br>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；<br>7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。<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依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上联合公告。<br>（四）新任基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务，或新任基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原任基金管理人或原任基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原任基金管理人或原任基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。 |
| 第十二部分基金的投资 | 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，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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）。<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>本基金股票资产的投资比例占基金资产的0–95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和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%。<br>待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理，届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 | 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，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包含国债、金融债、企业/公司债、公开发行的次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、货币市场工具（含同业存单）、衍生品（包括股指期货、国债期货、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（但须符合中国证监会相关规定）。<br>在符合法律法规规定的情况下，本基金可以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>本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和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%。<br>如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。 |
| | 三、投资策略<br>1、股票投资策略<br>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。但在极端市场情况下，为保护投资者的本金安全，股票资产比例可降至0%。<br>……<br>3、固定收益资产投资策略<br>本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。<br>固定收益资产包括债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等。<br>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。<br>4、权证投资策略<br>权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。<br>5、其他金融衍生工具投资策略<br>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。<br>6、融资融券及转融通证券出借业务的投资策略<br>在法律法规允许的范围内，在不改变基金的风险收益特征及对基金份额持有人无不利影响的前提下，本基金可参与融资融券及转融通证券出借业务，以提高组合的投资效率，从而更好地实现投资目标。本基金参与投资的比例将按照届时相关法律法规的规定执行。 | 三、投资策略<br>1、股票投资策略<br>本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。<br>本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%。<br>……<br>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金根据投资需要或市场环境变化，选择将部分资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资于港股。<br>……<br>3、债券投资策略<br>本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。<br>本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。<br>其中可转换债券和可交换债券，结合了权益类证券与固定收益类证券的特性，具有下行风险有限同时可分享基础股票价格上涨的特点。本基金将评估其内在投资价值，结合对可转换债券、可交换债券市场上的溢价率及其变动趋势、行业资金的配置以及基础股票基本面的综合分析，最终确定其投资权重及具体品种。<br>4、资产支持证券投资策略<br>资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。<br>5、衍生品投资策略<br>为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权、国债期货。<br>本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。<br>（1）股指期货投资策略<br>本基金投资股指期货时，将严格根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等。股指期货的投资主要采用流动性好、交易活跃的合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，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。<br>（2）股票期权投资策略<br>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。<br>本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范股票期权投资的风险。<br>（3）国债期货投资策略<br>本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。<br>6、融资及转融通证券出借业务的投资策略<br>本基金在参与融资及转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资及转融通证券出借业务。<br>本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。<br>为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将综合分析市场情况、投资者结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等条件，合理确定转融通证券出借的范围、期限和比例，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。<br>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。 |
| | 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）本基金股票资产的投资比例占基金资产的0–95%；<br>（2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和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%；<br>（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；<br>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；<br>（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；<br>（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；<br>（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；<br>……<br>（14）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%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；<br>（15）本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；<br>（16）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%；<br>（17）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95%；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、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；<br>（18）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；<br>（19）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>（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>……<br>（22）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；<br>……<br>除上述第（2）、（12）、（23）、（24）项外，因证券、期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。<br>……<br>如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，无需经基金份额持有人大会审议。<br>2、禁止行为<br>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：<br>（6）依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。<br>上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定，如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制；基金管理人应提前三个交易日公告，此调整无需召开基金份额持有人大会。<br>3、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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循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同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。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。 | 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）本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）资产的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；<br>（2）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和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%；<br>（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合并计算）不超过基金资产净值的10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；<br>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H股合并计算），不超过该证券的10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；<br>……<br>（11）本基金参与股指期货、国债期货交易，应当遵守下列要求：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95%；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>（12）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>（13）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>（14）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；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>（15）基金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%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；<br>……<br>（17）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；本基金完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分可不受该比例限制；<br>……<br>（20）任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；<br>（21）本基金参与转融通证券出借业务应当符合以下要求：<br>1）出借证券资产不得超过基金资产净值的30%，出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入流动性受限证券的范围；<br>2）参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的50%；<br>3）最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；<br>4）本基金参与证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；<br>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上述规定的，基金管理人不得新增转融通证券出借业务；<br>……<br>除上述第（2）、（9）、（18）、（19）、（21）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。法律法规另有规定的，从其规定。<br>……<br>如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。<br>2、禁止行为<br>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：<br>（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；<br>（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。<br>如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。<br>3、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，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循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。 |
| | 五、业绩比较基准<br>本基金的业绩比较基准为：95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）<br>沪深300指数是由中证指数有限公司编制的反映A股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取300只交易活跃、代表性强的A股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数。本基金为灵活配置混合型基金，股票资产的投资比例最高可达基金资产的95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金净资产的5%。因此，本基金适宜采用该业绩比较基准。<br>随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整，并报中国证监会备案并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。 | 五、标的指数和业绩比较基准<br>本基金的标的指数：沪深300指数<br>本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%<br>1、业绩比较基准设定的原因<br>本基金为增强型指数基金，利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金的标的指数为沪深300指数，相应选取沪深300指数作为基准要素，同时将沪深300指数的基准要素权重设置为95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和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%，相应选取活期存款基准利率作为基准要素，同时将活期存款基准利率的基准要素权重设置为5%。<br>综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。<br>2、业绩比较基准要素的基本信息<br>沪深300指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为000300，指数具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。<br>活期存款基准利率由中国人民银行发布，具体信息详见中国人民银行网站，网址：www.pbc.gov.cn。<br>3、业绩比较基准的计算方法<br>本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算业绩比较基准中沪深300指数、活期存款基准利率的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，并连乘每日收益率。<br>4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法<br>本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%。本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制在目标范围内。<br>5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序<br>若本基金调整业绩比较基准的要素权重，本基金将根据法律法规、中国证监会的规定和基金合同约定履行相关程序。<br>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。<br>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。 |
| | 六、风险收益特征<br>本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 | 六、风险收益特征<br>本基金是一只股票指数增强型基金，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。<br>本基金还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |
| | 七、基金的融资融券及转融通证券出借业务<br>本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券及转融通证券出借业务。 | 删除 |
| | 无 | 八、侧袋机制的实施和投资运作安排<br>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，无需召开基金份额持有人大会审议。<br>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后20个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。<br>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。 |
| 第十三部分基金的财产 | 四、基金财产的保管和处分<br>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。 | 四、基金财产的保管和处分<br>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。 |
| 第十四部分基金资产估值 | 一、估值日<br>本基金的估值日为本基金相关的证券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。 | 一、估值日<br>本基金的估值日为本基金相关的证券/期货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。 |
| | 二、估值对象<br>基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 | 二、估值对象<br>基金所拥有的股票、存托凭证、债券、资产支持证券、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 |
| | 无 | 三、估值原则<br>基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。<br>（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。<br>与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。<br>（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。<br>（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。 |
| | 三、估值方法<br>1、证券交易所上市的有价证券的估值<br>（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；<br>（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；<br>（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；<br>（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。<br>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：<br>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；<br>（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。<br>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。<br>3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。<br>4、同一债券同时在两个或者两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。<br>5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。<br>6、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。<br>7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。<br>8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。<br>如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。<br>根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。 | 四、估值方法<br>1、证券交易所上市的权益类证券的估值<br>交易所上市的权益类证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。<br>2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：<br>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；<br>（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；<br>（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。<br>3、固定收益品种的估值<br>（1）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。<br>（2）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。<br>对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。<br>（3）对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券，选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。<br>（4）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。<br>4、同一证券同时在两个或者两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。<br>5、存款的估值方法<br>持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。<br>6、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。<br>7、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。<br>8、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价。<br>9、税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。<br>10、本基金参与融资业务的，按照相关法律法规、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。<br>11、本基金参与转融通证券出借业务的，应参照监管机构或行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。<br>12、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。<br>13、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。<br>14、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。<br>如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。<br>根据有关法律法规，基金净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。 |
| | 四、估值程序<br>1、各类基金份额净值是按照每个交易日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，各类基金份额净值均精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。<br>每个交易日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。 | 五、估值程序<br>1、各类基金份额净值是按照每个交易日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，各类基金份额净值均精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。<br>基金管理人于每个交易日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。 |
| | 五、估值错误的处理<br>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。<br>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：<br>（2）错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。<br>（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。 | 六、估值错误的处理<br>基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。<br>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：<br>（2）错误偏差达到该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人，及时公告，并报中国证监会备案。<br>（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。 |
| | 六、暂停估值的情形<br>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；<br>3、当前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性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；<br>4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。 | 七、暂停估值的情形<br>1、基金投资所涉及的证券、期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；<br>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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；<br>4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。 |
| | 无 | 九、实施侧袋机制期间的基金资产估值<br>本基金实施侧袋机制的，应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，暂停披露侧袋账户份额净值。 |
| | 八、特殊情况的处理<br>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7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；<br>2、由于不可抗力，或证券、期货交易所、登记机构及存款银行发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。 | 十、特殊情况的处理<br>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；<br>2、由于不可抗力，或证券、期货交易所、登记机构、结算公司、指数编制机构、第三方估值基准服务机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误、遗漏，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。 |
| 第十五部分基金费用与税收 | 一、基金费用的种类<br>无 | 一、基金费用的种类<br>10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用； |
| | 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式<br>1、基金管理人的管理费<br>本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：<br>H＝E×1.20%÷当年天数<br>H为每日应计提的基金管理费<br>E为前一日的基金资产净值<br>2、基金托管人的托管费<br>……<br>基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。<br>3、C类基金份额的销售服务费<br>本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：<br>H＝E×0.25%÷当年天数<br>H为C类基金份额每日应计提的销售服务费<br>E为C类基金份额前一日基金资产净值<br>C类基金份额销售服务费每日计提，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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。<br>本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。<br>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。 | 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式<br>1、基金管理人的管理费<br>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：<br>H＝E×0.80%÷当年天数<br>H为每日应计提的基金管理费<br>E为前一日的基金资产净值<br>2、基金托管人的托管费<br>……<br>基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。<br>3、C类基金份额的销售服务费<br>本基金基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费。本基金C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：<br>H＝E×0.20%÷当年天数<br>H为C类基金份额每日应计提的销售服务费<br>E为C类基金份额前一日的基金资产净值<br>销售服务费每日计提。<br>（1）基金管理人直销渠道：<br>对于基金份额计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。<br>若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。<br>（2）代销渠道：<br>对于投资者持续持有期限未超过一年（即365天，下同）的基金份额收取的销售服务费每日计提，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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。<br>对于持续持有期限超过一年的基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。<br>若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。<br>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。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<br>下列费用不列入基金费用：<br>3、基金合同生效前的相关费用； | 三、不列入基金费用的项目<br>下列费用不列入基金费用：<br>1、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；<br>4、基金合同生效前的相关费用根据《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定执行； |
| | 无 | 四、实施侧袋机制期间的基金费用<br>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支。侧袋账户资产不收取管理费，其他费用详见招募说明书的规定。 |
| | 四、基金税收<br>本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 | 五、基金税收<br>本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。 |
| 第十六部分基金的收益与分配 | 三、基金收益分配原则<br>1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配； | 三、基金收益分配原则<br>删除<br>在不违反法律法规和监管部门的规定且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人履行适当程序后，可对基金收益分配原则进行调整。 |
| | 五、收益分配方案的确定、公告与实施<br>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。<br>基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。 | 五、收益分配方案的确定、公告与实施<br>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核。基金收益分配方案确定后，由基金管理人按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。 |
| | 六、基金收益分配中发生的费用<br>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。 | 六、基金收益分配中发生的费用<br>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。 |
| | 无 | 七、实施侧袋机制期间的收益分配<br>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。 |
| 第十七部分基金的会计与审计 | 一、基金会计政策<br>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； | 一、基金会计政策<br>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日； |
| | 二、基金的年度审计<br>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<br>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。 |
| 第十八部分基金的信息披露 | 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。<br>二、信息披露义务人<br>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。<br>……<br>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中国证监会指定的全国性报刊（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。<br>四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。 | 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。<br>二、信息披露义务人<br>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。<br>……<br>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“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）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。<br>四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。 |
| | 五、公开披露的基金信息<br>公开披露的基金信息包括：<br>（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<br>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。……<br>基金募集申请在中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。<br>（二）基金份额发售公告<br>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。<br>（三）基金合同生效公告<br>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定媒介上登载基金合同生效公告。<br>（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<br>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，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。基金年度报告中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。<br>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、中期报告或者年度报告。<br>……<br>本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。<br>（七）临时报告<br>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。<br>8、基金募集期延长或提前结束募集；<br>16、某类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五；<br>23、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；<br>（八）澄清公告<br>在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。<br>（十）清算报告<br>基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。<br>（十一）中国证监会规定的其他信息<br>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。 | 五、公开披露的基金信息<br>公开披露的基金信息包括：<br>（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<br>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。……<br>（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<br>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中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。<br>……<br>基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。<br>（五）临时报告<br>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。<br>15、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；<br>22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；<br>23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；<br>24、本基金变更标的指数；<br>（六）澄清公告<br>在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。<br>（八）清算报告<br>基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。<br>（九）参与融资及转融通证券出借业务的信息披露<br>本基金参与融资及转融通证券出借业务，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资和转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。<br>（十）投资股指期货的信息披露<br>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标。<br>（十一）投资国债期货的信息披露<br>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。<br>（十二）投资股票期权的信息披露<br>基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。<br>（十三）投资资产支持证券的信息披露<br>基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。<br>（十四）投资港股通标的股票的相关公告<br>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与港股通交易的相关情况。<br>（十五）实施侧袋机制期间的信息披露<br>本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。<br>（十六）中国证监会规定的其他信息。 |
| | 六、信息披露事务管理<br>……<br>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。<br>……<br>基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。 | 六、信息披露事务管理<br>……<br>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金净值信息、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。<br>……<br>基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。 |
| | 七、信息披露文件的存放与查阅<br>依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。 | 七、信息披露文件的存放与查阅<br>依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。 |
| | 八、暂停或延迟披露基金信息的情形<br>1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； | 八、暂停或延迟披露基金信息的情形<br>1、基金投资所涉及的证券、期货交易所或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； |
| 第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | 一、基金合同的变更<br>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。<br>2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，并自决议生效后2日内在指定媒介公告。 | 一、基金合同的变更<br>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意并履行适当程序后变更并公告。<br>2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。 |
| | 二、基金合同的终止事由<br>有下列情形之一的，经履行适当程序后，基金合同应当终止：<br>无 | 二、基金合同的终止事由<br>有下列情形之一的，经履行适当程序后，基金合同应当终止：<br>3、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的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，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； |
| | 三、基金财产的清算<br>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。<br>5、基金财产清算的期限为6个月。 | 三、基金财产的清算<br>2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。<br>5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。 |
| | 五、基金财产清算剩余资产的分配<br>依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。 | 五、基金财产清算剩余资产的分配<br>依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的各类基金份额比例进行分配。<br>其中，对于投资者通过直销机构申购的C类基金份额计提的销售服务费（如有）将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者；对于投资者通过代销机构申购且持续持有期限超过一年的C类基金份额继续计提的销售服务费（如有）将在基金合同终止时随剩余资产分配款项一并返还给投资者。 |
| | 六、基金财产清算的公告<br>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。…… | 六、基金财产清算的公告<br>清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。…… |
| | 七、基金财产清算账册及文件的保存<br>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。 | 七、基金财产清算账册及文件的保存<br>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。 |
| 第二十一部分争议的处理和适用的法律 | 各方当事人同意，……仲裁费和律师费由败诉方承担。<br>……<br>基金合同受中国法律管辖。 | 各方当事人同意，……除非仲裁裁决另有决定，仲裁费和律师费由败诉方承担。<br>……<br>基金合同受中国法律（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。 |
| 第二十二部分基金合同的效力 | 基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。<br>1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字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。<br>4、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。 | 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。<br>1、《华泰柏瑞沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，自202*年*月*日起生效，原《华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效。<br>4、基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。 |

注：1、“第二十四部分 基金合同内容摘要”章节涉及上述内容的一并修改。

2、涉及基金名称的修改未再一一列举。

3、涉及“指定媒介”、“指定报刊”、“指定网站”变更为“规定媒介”、“规定报刊”、“规定网站”的修改未再一一列举。

---

# 华泰柏瑞基金管理有限公司 关于华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告

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》、《华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，截至2026年4月28日日终，华泰柏瑞均衡成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已连续40个工作日基金资产净值低于5000万元，可能触发基金合同终止情形，现将相关事宜公告如下：

一、可能触发基金合同终止的情形说明

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50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，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

二、其他需要提示的事项

1、若出现基金合同终止的情形，基金管理人将根据相关法律法规的规定和基金合同的约定成立基金财产清算小组，履行基金财产清算程序。本基金进入清算程序后将不再办理申购、赎回等业务，敬请投资人关注相应的流动性风险，妥善做好投资安排。

2、投资人欲了解本基金产品的详细情况，请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

3、如有疑问，投资者可以拨打本公司客户服务热线400-888-0001，或登录本公司网站www.huatai-pb.com获取相关信息。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证旗下基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资有风险，本公司管理的其它基金的过往业绩并不构成对本基金的业绩表现的保证。本公司提醒投资人在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。投资者投资基金时应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2026年4月30日

---

# 华泰柏瑞基金管理有限公司 关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告

根据《深圳证券交易所证券投资基金业务指引第2号——流动性服务》等有关规定，自2026年4月30日起，本公司指定下列流动性服务商为相关证券投资基金的主流动性服务商：

1、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金（159738）：

兴业证券股份有限公司

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2026年4月30日

---

# 华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金调整大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告

公告送出日期：2026年4月30日

1.公告基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | | 华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金 |
| 基金简称 | | 华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期 |
| 基金主代码 | | 015863 |
| 基金管理人名称 | | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 公告依据 | | 根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》、《华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》等相关规定。 |
| 限制相关业务的起始日、金额及原因说明 | 限制大额申购起始日 | 2026年5月6日 |
| | 限制大额转换转入起始日 | 2026年5月6日 |
| | 限制大额定期定额投资起始日 | 2026年5月6日 |
| | 限制申购金额（单位：人民币元） | 1,000,000.00 |
| | 限制转换转入金额（单位：人民币元） | 1,000,000.00 |
| | 限制定期定额投资金额（单位：人民币元） | 1,000,000.00 |
| | 暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）的原因说明 | 为保证本基金的稳定运作，保护基金份额持有人利益。 |

2.其他需要提示的事项

1、自2026年5月6日起本基金大额申购业务限制金额由500万元调整为100万元，即自2026年5月6日起限制单日单个基金账户单笔或累计超过100万元(不含100万元)的申购申请：如单日单个基金账户单笔申购本基金的金额超过100万元(不含100万元)，对于该笔申购申请，本公司有权拒绝；如单日单个基金账户多笔累计申购本基金的金额超过100万元(不含100万元)，对超过限额的该笔或多笔申购申请，本公司有权拒绝。

2、根据本公司于2024年11月1日《华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金规模控制的公告》，自2024年11月1日起华泰柏瑞中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金对基金规模进行控制。

本基金总规模上限为100亿元人民币（但因基金份额净值波动导致基金资产净值超过该金额的除外）。本基金管理人未来有权调整本基金在存续过程中的基金资产净值上限，具体以本基金管理人届时相关公告为准。

若T日的申购和赎回申请全部确认后，基金的总规模超过100亿元，本基金管理人将对 T日有效申购申请采用“申购申请比例确认”的原则给予部分确认。比例确认结果以投资者在销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认结果为准。

在本基金限制大额申购（含转换转入、定期定额投资）期间，本基金的赎回、转换转出等业务正常办理。本基金恢复办理正常申购（含转换转入、定期定额投资）业务的时间将另行公告。

3、投资者可登陆本公司网站（www.huatai-pb.com）查询相关信息或拨打客户服务电话（400-888-0001）咨询相关事宜。

风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本基金对每份基金份额设定最短持有期限，对投资者存在流动性风险。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同、招募说明书和基金产品资料概要（更新）等法律文件。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2026年4月30日