

# 关于华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF） 变更为华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券 投资基金联接基金（LOF）并修订基金合同和托管协议 的公告

华宝基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）经中国证监会《关于准予华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可【2016】1215 号）注册，于 2017 年 1 月 18 日成立并正式运作。

根据《华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第十三部分 基金的投资”中“八、未来条件许可情况下的基金模式转换”约定：“若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。”且《基金合同》“第九部分 基金份额持有人大会”中同时约定：“2、在不违背法律法规规定和《基金合同》约定，对基金份额持有人利益无实质性影响的前提下，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：……（3）若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》；……”。

本公司旗下《华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金基金合同》已于 2023 年 12 月 8 日生效，该基金于 2023 年 12 月 28 日开始于上海证券交易所上市交易，与华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）跟踪同一标的指数。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中国银行股份有限公司协商一致，决定于 2024 年 11 月 1 日起，将华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）转型变更为华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（以下简称“本基金”）并相应修订《基金合同》等法律文件相关条

款。现将具体事宜公告如下：

### 一、转型变更为联接基金

华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）转型变更为华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），根据《基金合同》约定，无须召开基金份额持有人大会。《基金合同》、《华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）托管协议》和《华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）招募说明书》将进行相应修订和补充。华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）原有的 A 类基金份额调整为本基金的 A 类基金份额，A 类基金份额场外简称“华宝标普中国 A 股红利机会指数（LOF）”变更为“华宝标普中国 A 股红利机会 ETF 联接 A（LOF）”，A 类基金份额场内简称“红利基金 LOF”不变，基金代码不变；华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）原有的 C 类基金份额调整为本基金的 C 类基金份额，C 类基金份额简称“华宝红利基金 C”变更为“华宝标普中国 A 股红利机会 ETF 联接 C”，基金代码不变。

转型变更后的本基金 A 类基金份额将继续在上海证券交易所上市交易。

### 二、转型变更后的基金管理费率、托管费率、C 类基金份额销售服务费率调整

根据《基金合同》的相关约定及华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）于 2024 年 3 月 21 日召开的基金份额持有人大会审议通过的持有人大会决议，本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作的，相关费率调整为：

管理费“按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的 0.50%年费率计提”、托管费“按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的 0.10%年费率计提”、C 类基金份额的销售服务费“按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.30%年费率计提”。

三、修订后的《华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》、《华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》自 2024 年 11 月 1 日起生效，基金管理人将相应更新《华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书》及基金产品资料概要。

#### 四、重要提示

1、本次《基金合同》的修订系根据《基金合同》约定转型变更为 ETF 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审议的事项,其余修改对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响,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网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议、招募说明书及基金产品资料概要。

3、本公告仅对华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 转型变更及费率调整等有关事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,可登录本公司网站 ([www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)) 查阅本基金基金合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件,以及相关业务公告。

4、投资者可访问本公司网站 ([www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)) 或拨打公司客户服务电话 (400-700-5588、400-820-5050) 咨询相关情况。

#### 5、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。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等基金法律文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华宝基金管理有限公司  
2024 年 10 月 30 日

附件：《华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同》修改如下：

原基金合同涉及修改章节	华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同	华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同
全文	指定媒介、指定网站、指定报刊、指定互联网网站	规定媒介、规定网站、规定报刊、规定互联网网站  删除“募集”、“认购”、“发售”及类似表述
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（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》”）、《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3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、本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。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”）、《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》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（以下简称“本基金”）由华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）变更而来，华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）由华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）变</p>

	<p>质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p> <p>六、本基金为指数基金,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书。</p>	<p>更基金名称而来。基金管理人依照《基金法》、《华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)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。</p> <p>中国证监会对华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)募集的注册,并不表明其对本基金的价值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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p> <p>六、本基金主要投资于目标ETF,投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险,详见本基金招募说明书。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1、基金或本基金:指华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)</p> <p>4、基金合同或本基金合同:指《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书:指《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金份额发售公告:指《华宝兴业标普中国A股红利机会指数证券投资基金</p>	<p>1、基金或本基金:指华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),由华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)变更而来</p> <p>4、基金合同或本基金合同:指《华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书:指《华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要:指《华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基</p>

(LOF)基金份额发售公告》

8、基金产品资料概要：指《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要》及其更新

12、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《信息披露办法》：指中国2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《流动性规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

19、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

27、销售机构：指直销机构和其他销售机构

金(LOF)基金产品资料概要》及其更新

11、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、目标ETF：指另一获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“ETF”），该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金以华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF

17、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，与目标ETF的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，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

20、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

28、销售机构：指华宝基金管理有限公司，以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件、取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议、办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所交易系统办理基金

<p>28、直销机构：指华宝基金管理有限公司</p> <p>29、其他销售机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过上海证券交易所办理基金销售业务的会员单位。其中可通过上海证券交易所办理本基金销售业务的机构必须具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位</p> <p>30、基金销售网点：指直销机构的直销中心及其他销售机构的销售网点</p> <p>31、会员单位：指具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位</p> <p>32、场外：指通过上海证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回</p> <p>33、场内：指通过上海证券交易所内具有相应业务资格的会员单位办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回</p> <p>41、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资、交易等业务导致基金份额变动</p>	<p>销售业务的会员单位。其中可通过上海证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须具有基金销售业务资格、并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所交易系统办理本基金销售业务的上海证券交易所会员单位</p> <p>29、场外：指通过上海证券交易所外的销售机构办理基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回</p> <p>30、场内：指通过上海证券交易所内具有相应业务资格的会员单位办理基金份额申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回</p> <p>38、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资、交易等业务导致基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>39、上海证券账户：指在中国证券登记结算有</p>
--	---

	<p>及结余情况的账户</p> <p>42、上海证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户，投资者通过上海证券交易所办理基金交易、场内认购、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户</p> <p>43、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</p>	<p>限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户，投资者通过上海证券交易所办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户</p> <p>40、基金合同生效日：指《华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效日，《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日失效</p>
<p>第三部分 基金的基本情况</p>	<p>一、基金名称 华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金（LOF）</p> <p>二、基金的类别 股票型证券投资基金</p> <p>六、基金的投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将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控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。</p>	<p>一、基金名称 华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）</p> <p>二、基金的类别 ETF 联接基金</p> <p>六、基金的投资目标 本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>新增： 七、目标 ETF 华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金</p> <p>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： （1）在投资方法方面，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；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，实现对标的指数的紧密跟踪。</p>

		<p>(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市场买卖目标 ETF，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；而本基金作为上市开放式基金，日常交易包括申购赎回和上市交易两种方式，投资者既可以通过场外销售机构申购和赎回本基金 A 类基金份额和/或 C 类基金份额，也可以在交易所买卖本基金 A 类基金份额或进行 A 类基金份额的申购与赎回。</p> <p>本基金与目标 ETF 业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括：</p> <p>(1) 法律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；而本基金作为上市开放式基金，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，仍需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。</p> <p>(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净值产生一定冲击。</p>
<p>第四部分 基金份额的发售</p>	<p>删除原第四部分 基金份额的发售章节全部内容</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革</p> <p>华宝标普中国 A 股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 由华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 变更而来。</p> <p>华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 经中国证券监督管理委员会 2016 年 6 月 3 日证监许可【2016】1215 号文注册，基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。</p> <p>《华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2017 年 1 月 18 日正式生效。自 2017 年 12 月 30 日起，华宝兴业标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 变更基金名称为华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)。</p> <p>根据《华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》约定，“若将来</p>

		<p>基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。”本基金目标ETF为华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金，华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金基金合同已于2023年12月8日生效，并于2023年12月28日开始于上海证券交易所上市交易。</p> <p>基金管理人在与基金托管人协商一致后，决定将华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）变更为华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），并据此修订《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同》。自2024年11月1日起，《华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效，原《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。</p>
<p>第五部分 基金 备案</p>	<p>删除原第五部分 基金备案章节全部内容</p>	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>一、基金份额的变更登记</p> <p>基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要信息的变更。</p> <p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>《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60个工作日基金资产净值低于5000万元或基金份额持有人数量不满200人的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开</p>

		<p>基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>
<p>第六部分 基金份额的上市交易</p>	<p>一、上市交易的基金份额</p> <p>基金合同生效后，在本基金符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请本基金 A 类基金份额上市交易。</p> <p>二、上市交易的地点</p> <p>上海证券交易所。</p> <p>三、上市交易的时间</p> <p>基金合同生效后六个月内，本基金 A 类基金份额将申请在上海证券交易所上市交易。</p> <p>在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登《上市交易公告书》。</p> <p>四、上市交易的条件</p> <p>基金合同生效后具备下列条件，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请本基金 A 类基金份额上市：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、募集金额不少于 2 亿元人民币；</li> <li>2、基金份额持有人不少于 1000 人；</li> <li>3、上海证券交易所规定的其他条件。</li> </ol> <p>基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。</p>	<p>一、上市交易的地点</p> <p>上海证券交易所。</p> <p>二、上市交易的时间</p> <p>基金管理人已于 2017 年 2 月 8 日在规定媒介刊登上市交易公告书，原华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) A 类基金份额已于 2017 年 2 月 13 日上市交易。</p> <p>基金合同生效后，华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) 的登记机构将进行基金份额变更登记，将华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF) A 类基金份额调整为本基金 A 类基金份额，基金代码不变。</p>

	<p>投资者参与本基金的相关业务，应当满足上海证券交易所投资者适当性管理的相关要求。</p>	
<p>第七部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>新增：</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>8、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>9、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回或延缓支付赎回款项的情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>新增：</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>7、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>8、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回或延缓支付赎回款项的情形。</p>
<p>第八部分 基金合同当事人</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一） 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：XIAOYI HELEN HUANG（黄</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一） 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：黄孔威</p>

<p>人及 权利 义务</p>	<p>小意)</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(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；</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：刘连舸</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(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；</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>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：</p> <p>(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p>	<p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(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不少于法律法规规定的最低期限；</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：葛海蛟</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>(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不少于法律法规规定的最低期限；</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>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：</p> <p>(5) 出席或者委派代表出席本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会，对本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p>
<p>第九 部分 基金 份额 持有</p>		<p>新增：</p> <p>鉴于本基金和目标ETF的相关性，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金的基金份额直接出席目标ETF的基金份额持有人大会</p>

人大  
会

或者委派代表出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会基金份额和表决票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会基金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份额的总数乘以该基金份额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。

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，但可接受本基金的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。

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。

#### 一、召开事由

2、在不违背法律法规规定和《基金合同》约定，对基金份额持有人利益无实质性影响的前提下，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：

(3) 若将来本基金管理人推出跟踪同

#### 一、召开事由

2、在不违背法律法规规定和《基金合同》约定，对基金份额持有人利益无实质性影响的前提下，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：

(4) 由于目标ETF变更标的指数、变更交易方式、终止上市或基金合同终止而变更基金

	<p>一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》；</p>	<p>投资目标、范围或策略；</p>
<p>第十部分 基金的投资</p>	<p>一、投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将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控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。</p> <p>二、投资范围</p> <p>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（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指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）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金投资于股票的比例不低于基金资产的90%，投资于标普中国A股红利机会指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的80%；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，应保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指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）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；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，应保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。</p>

府债券。

### 三、投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

#### 1、组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

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，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。

#### 2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

#### 3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

#### 4、资产支持证券投资策略

本基金本着风险可控和优化组合风险收益的原则，将投资于资产支持证券产品，以期获得稳定的收益。本基金综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，制定相应的资产支持证

### 三、投资策略

本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本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控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

#### 1、资产配置策略

本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%；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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、货币市场工具、股指期货、国债期货、资产支持证券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。

本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

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，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。

#### 2、目标ETF投资策略

##### 1) 投资组合的投资方式

本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标ETF基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标ETF基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标ETF的投资方式。通常情况下，本基金以申购和赎回为主：当收到净申购时，本基金构建股票组合、申购目

券投资计划。

#### 5、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金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。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，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

#### 6、存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

标ETF；当收到净赎回时，本基金赎回目标ETF、卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续实物申购目标ETF的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

#### 2) 投资组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

#### 3、股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理，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。基金管理人也可适度投资其他非成份股以增强基金收益。

#### 4、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金本着风险可控和优化组合风险收益的原则，将投资于资产支持证券产品，以期获得稳定的收益。本基金综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，制定相应的资产支持证券投资策略。

#### 6、股指期货、权证等金融衍生工具投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金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。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，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

#### 7、转融通投资策略

为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的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

#### 8、融资投资策略

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成的基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

#### 9、存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

### 四、投资限制

## 1、组合限制

(1) 本基金持有股票的比例不低于基金资产的90%，投资于标普中国A股红利机会指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的80%；

除上述第(2)、(11)、(17)、(18)项外，因证券/期货市场波动、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。法律法规另有规定的，从其规定。

(1) 本基金持有的目标ETF的比例不得低于基金资产净值的90%；

(20) 本基金参与融资，每个交易日日终，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%；

(21) 本基金参与转融通证券出借业务，需遵守下列规定：

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《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

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%；

3) 最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

4) 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；

因证券、期货市场波动、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出借业务；

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。

除上述第(1)、(2)、(11)、(17)、(18)、

(21)项外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、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

## 五、标的指数和业绩比较基准

### 2、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：标普中国A股红利机会指数收益率×95% + 同期银行活期存款利率（税后）×5%。

未来若出现标的指数不符合要求（不包括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）、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，如对基金份额持有人利益有实质性影响，则在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

## 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基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数基金，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。

七、待公司具备法律法规和中国证监会的相关要求后，本基金可参与融资及转融通业务，届时相关投资比例限制按照法律法规以及中国证监会的相关规定执行。

## 八、未来条件许可情况下的基金模

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。法律法规另有规定的，从其规定。

## 五、标的指数和业绩比较基准

### 2、业绩比较基准

标普中国A股红利机会指数收益率×95% + 同期银行活期存款利率（税后）×5%。

未来若出现标的指数不符合要求（不包括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）、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，如对基金份额持有人利益有实质性影响，则在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。但下文“目标ETF发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。

## 六、风险收益特征

本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型基金，本基金的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跟踪标的指数表现，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。

七、本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。

新增：

## 八、目标ETF发生相关变更情形时的处理

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于目标ETF的联接基金变更为直接投资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以

	<p>式转换</p> <p>若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。</p>	<p>该指数作为标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护投资者合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中删除关于目标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>（5）目标ETF与其他基金合并；</p> <p>（6）中国证监会规定的其他情形。</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>第十五部分基金资产估值</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、股指期货合约、权证、债券、资产支持证券和银行存款本息、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、股指期货合约、权证、债券、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>新增：</p> <p>三、估值方法</p> <p>1、目标ETF份额的估值</p> <p>本基金投资的目标ETF份额以目标ETF估</p>

	<p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第5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。</p>	<p>值日基金份额净值估值，若当日无目标ETF基金份额净值的，以目标ETF最近公布的基金份额净值估值。</p> <p>6、基金参与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、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；</p> <p>八、特殊情况的处理</p> <p>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。</p>
第十六部分 基金费用与税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>4、标的指数使用相关费用；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.75\% \div \text{当年实际天数}$ <p>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</p> <p>若将来基金管理人根据本基金合同“第十三部分 基金的投资”之</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>11、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、申购赎回费用等）；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = \text{MAX}(E \times 0.50\% \div \text{当年天数}, 0)$ <p>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ETF基金份额部分的基金资产净</p>

“八、未来条件许可情况下的基金模式转换”使本基金采取ETF联接基金模式进行运作的，基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额的0.50%年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = \text{MAX}(E \times 0.50\% \div \text{当年天数}, 0)$$

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ETF基金份额部分的基金资产净值

基金管理费每日计提，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，由基金托管人自动于次月首日起3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、公休假等，支付日期顺延。

## 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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年实际天数}$$

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

若将来基金管理人根据本基金合同“第十三部分 基金的投资”之

“八、未来条件许可情况下的基金模式转换”使本基金采取ETF联接基金模式进行运作的，基金托管费按前一日

值

基金管理费每日计提，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，由基金托管人自动于次月首日起3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、公休假等，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ETF的部分不收取托管费，基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX}(E \times 0.10\% \div \text{当年天数}, 0)$$

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ETF基金份额部分的基金资产净值

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

基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额的0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = \text{MAX} (E \times 0.10\% \div \text{当年天数}, 0)$$

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 ETF 基金份额部分的基金资产净值

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，由基金托管人自动于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

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年费率为0.40%。

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.40%的年费率计提。

若将来基金管理人根据本基金合同“第十三部分 基金的投资”之“八、未来条件许可情况下的基金模式转换”使本基金采取ETF联接基金模式进行运作的，基金C类份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.30%的年费率计提。

### 4、标的指数使用相关费用

本基金按照基金管理人与标的指数许

管人核对一致后，由基金托管人自动于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

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类基金份额基金资产净值的0.30%的年费率计提。

	<p>可方所签订的指数许可使用协议的约定计提标的指数使用相关费用，基金合同生效后的标的指数使用相关费用从基金财产中列支。标的指数使用相关费用的费率、具体计算方法及支付方式见招募说明书。</p> <p>如果指数使用许可协议约定的标的指数使用相关费用的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数使用相关费用。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露本基金最新适用的方法。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第5—12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。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用；</p>	<p>上述“一、基金费用的种类”中第4—12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。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用根据《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金(LOF)基金合同》执行；</p>
<p>第十八部分 基金的会计与审计</p>	<p>二、基金的年度审计</p> <p>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、期货相关从业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。</p>	<p>二、基金的年度审计</p> <p>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。</p>
<p>第十九部分 基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(七)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</p> <p>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</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(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</p> <p>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规</p>

<p>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。</p>	<p>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。</p> <p>新增：</p> <p>（五）临时报告</p> <p>23、目标ETF变更；</p> <p>（九）中国证监会规定的其他信息。</p> <p>本基金在招募说明书（更新）及定期报告等文件中应当设立专门章节披露所持目标ETF以下情况，并揭示相关风险：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；</li> <li>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，招募说明书（更新）中应当列明计算方法并举例说明；</li> <li>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。</li> </ol> <p>本基金参与融资业务，基金管理人应在季度报告、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交易的情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况。</p> <p>本基金参与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</p>
--	---

		业务发生的重大关联交易事项做详细说明。
第二 十部 分 基 金 合 同 的 变 更 、 终 止 与 基 金 财 产 的 清 算	<p>六、基金财产清算的公告</p> <p>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。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，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。</p> <p>七、基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>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。</p>	<p>六、基金财产清算的公告</p> <p>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。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，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。</p> <p>七、基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。</p>
第二 十三 部 分 基 金 合 同 的 效 力	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方加盖公章或合同专用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。</p>	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字，自2024年11月1日起，《华宝标普中国A股红利机会交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效，原《华宝标普中国A股红利机会指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。</p>