

广发基金管理有限公司

关于广发纳斯达克100指数证券投资基金变更为广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）并修改法律文件的公告

广发基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的广发纳斯达克100指数证券投资基金（以下简称“本基金”），于2012年4月26日经中国证监会证监许可[2012]568号准予募集注册，《广发纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2012年8月15日生效。基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“托管人”）。

根据《广发纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》的约定：“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式并修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会核准或备案并提前公告。”

本公司旗下的广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金，已于2015年2月16日获得中国证监会准予注册的批复，于2015年6月10日成立运作，于2015年7月13日正式在深圳证券交易所上市交易。

为了更好地满足投资者投资需求，本公司经与托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定将广发纳斯达克100指数证券投资基金变更为广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII），并据此修改法律文件。

相关情况如下：

一、转型变更为联接基金

广发纳斯达克100指数证券投资基金变更为广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）后，本基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“广发纳斯达克100指数证券投资基金A类基金份额”变更为“广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）A类基金份额”，

“广发纳斯达克100指数证券投资基金C类基金份额”变更为“广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）C类基金份额”。同时在每一份额类别内，根据申购、赎回所使用货币的不同，再分为人民币份额和美元现汇份额。

本基金基金简称分别由“广发纳斯达克100指数人民币（QDII）A”变更为“广发纳指100ETF联接人民币（QDII）A”，“广发纳斯达克100指数美元（QDII）A”变更为“广发纳指100ETF联接美元（QDII）A”，“广发纳斯达克100指数人民币（QDII）C”变更为“广发纳指100ETF联接人民币（QDII）C”，“广发纳斯达克100指数美元（QDII）C”变更为“广发纳指100ETF联接美元（QDII）C”，基金代码保持不变。

前述变更不影响各类基金份额净值的计算，各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率保持不变。

二、关于修改法律文件的说明

本公司经与基金托管人协商一致，对《基金合同》中涉及基金转型的相关内容进行修改，并根据最新法律法规以及《基金合同》的有关规定对相关内容进行修订和补充。除上述涉及基金转型的相关内容外，基金管理人与基金托管人协商一致，对《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）部分内容进行修订与补充。上述修改事项对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，并已向证监会履行备案手续，无需召开基金份额持有人大会。

《基金合同》及《托管协议》具体修改详见附件。本公司将于公告当日在网站上同时公布经修订后的《基金合同》《托管协议》及《招募说明书》等法律文件，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

修订后的《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)基金合同》《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)托管协议》《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)招募说明书》自 2022 年 4 月 1 日起生效，原《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议》《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金招募说明书》于当日失效。

本公告仅对本次法律文件修改的事项予以说明，最终解释权归本公司。投资者欲了解本公司旗下基金的详细情况，请登录本公司网站(www.gffunds.com.cn)查询或拨打本公司客户服务电话 95105828 或 020-83936999 进行咨询。

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。

广发基金管理有限公司

2022年3月31日

附件 1: 《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同》修订对照表

章节	广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同
全文	广发纳斯达克 100 指数证券投资基金	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）
全文	指定媒介	规定媒介
全文	指定报刊	规定报刊
全文	指定网站	规定网站
全文	具有证券、期货相关从业资格的	符合《证券法》规定的
一、前言	<p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>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》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）、《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>（二）<u>本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关规定募集，并经中国证监会批准。中国证监会对本基金募集的批准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</u></p>	<p>2、订立本基金合同的依据</p> <p>订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《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》”）、<u>《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》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）、《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。</u></p> <p>（二）<u>本基金由广发纳斯达克 100 指数证券投资基金转型而来。广发纳斯达克 100 指数证券投资基金依照《基金法》、基金合同和其他有关规定募集，并经中国证监会批准。中国证监会对广发纳斯达克 100 指数证券投资基金（转型更名前）募集的批准及后</u></p>

	<p>(四) 投资者<u>认购、申购</u>确认人民币基金份额和赎回确认人民币基金份额均以人民币元计算, 申购确认美元现汇基金份额和赎回确认美元现汇基金份额均以美元现汇计算; 在本基金存续期间, 基金管理人不承担汇率变动风险。</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策, 自行承担投资风险。</p> <p><u>本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求, 自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</u></p> <p>(五) 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、<u>成份券停牌</u>等潜在风险, 详见本基金招募说明书。</p>	<p><u>续转型为本基金的备案, 并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证, 也不表明投资于本基金没有风险。</u></p> <p>(四) 投资者申购确认人民币基金份额和赎回确认人民币基金份额均以人民币元计算, 申购确认美元现汇基金份额和赎回确认美元现汇基金份额均以美元现汇计算; 在本基金存续期间, 基金管理人不承担汇率变动风险。</p> <p>投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件, 自主判断基金的投资价值, 自主做出投资决策, 自行承担投资风险。</p> <p>(五) 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、<u>成份股停牌</u>等潜在风险, 详见本基金招募说明书。</p>
<p>二、释义</p>	<p>基金或本基金: <u>指广发纳斯达克 100 指数证券投资基金;</u></p> <p><u>发售公告: 指《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金份额发售公告》;</u></p> <p>(删除)</p> <p><u>《合同法》: 指《中华人民共和国合同法》;</u></p> <p><u>《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《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;</u></p>	<p>基金或本基金: <u>指广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII), 由广发纳斯达克 100 指数证券投资基金转型而来;</u></p> <p><u>《民法典》: 指《中华人民共和国民法典》;</u></p> <p><u>《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; (新增)</u></p> <p><u>《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, 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;</u></p>

	<p><u>合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；</u></p> <p><u>基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月；</u>（删除）</p> <p><u>基金合同生效日：基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续，获得中国证监会书面确认之日；</u></p> <p><u>认购：指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；</u>（删除）</p> <p><u>指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；</u></p>	<p><u>目标 ETF：指广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（简称广发纳指 100 ETF）；</u>（新增）</p> <p><u>ETF 联接基金：指将绝大多数基金财产投资于目标 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，简称“联接基金”；</u>（新增）</p> <p><u>标的指数：指纳斯达克集团编制并发布的纳斯达克 100 指数及其未来可能发生的变更；</u>（新增）</p> <p><u>合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定可以使用来自境外的资金投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者；</u></p> <p><u>基金合同生效日：指《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同》生效日，原《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》自本基金合同生效日起失效；</u></p> <p><u>规定媒介：指中国证监会规定的用以进行信息披露的全国性报刊及规定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；</u></p>
三、基金的基本情况	<p>（二）基金的类别 <u>股票型证券投资基金、QDII</u></p> <p>（四）基金的投资目标 <u>本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数</u></p>	<p>（二）基金的类别 <u>ETF 联接基金、QDII</u></p> <p>（四）基金的投资目标 <u>本基金主要通过投资于目标 ETF，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟</u></p>

	<p><u>量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。</u></p> <p><u>（五）基金的最低募集份额总额</u> 本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。（删除，序号依次调整）</p> <p><u>（六）基金份额面值和认购费用</u> 每份人民币基金份额发售面值为人民币 1.00 元。 本基金认购费率最高不超过 5%，具体费率按招募说明书的规定执行。（删除，序号依次调整）</p>	<p><u>跟踪误差的最小化。</u></p> <p><u>（七）本基金与目标 ETF 的联系与区别</u> 本基金的目标 ETF 是广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（简称广发纳指 100ETF）。 本基金为广发纳指 100ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别： <u>（1）在投资方法方面，目标 ETF 直接投资于标的指数的成份股及备选成份股；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。</u> <u>（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；而本基金通常大部分情况下像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及代销机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。</u> 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： <u>（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投资于标的指数成份股及备选成份股；而本基金作为普通的开放式基金，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。</u> <u>（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、</u></p>
--	--	---

		<p>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。（新增）</p>
<p>四、基金的发售（章节标题更改为“基金的历史沿革”）</p>	<p><u>四、基金份额的发售</u></p> <p><u>（一）发售时间</u> 本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在基金份额发售公告中披露。</p> <p><u>（二）发售方式</u> 本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资者公开发售。 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。</p> <p><u>（三）发售对象</u> 本基金的发售对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。</p> <p><u>（四）基金认购费用</u> 本基金的认购费不超过5%。</p> <p><u>（五）发售规模</u> 本基金可根据中国证监会、外管局核准的境外投资额度（美元额度需折算为人民币），对基金发售规模进行限制。具体规模限制在招募说明书或基金份额发售公告中约定。 《基金合同》生效后，基金的资产规模不受上述限制，但基金管理人有权根据基金的外汇额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。</p> <p><u>（六）基金认购的具体规定</u> 投资者认购原则、认购限额、认购</p>	<p><u>四、基金的历史沿革</u> 广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）由广发纳斯达克 100 指数证券投资基金转型而来。广发纳斯达克 100 指数证券投资基金于 2012 年 4 月 26 日经中国证监会证监许可[2012]568 号文核准，基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。广发纳斯达克 100 指数证券投资基金自 2012 年 7 月 9 日至 2012 年 8 月 10 日进行发售，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 8 月 15 日生效。 根据《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》的约定：“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会核准或备案并提前公告”，基金管理人经与基金托管人协商一致并向中国证监会备案后，决定将广发纳斯达克 100 指数证券投资基金转型为广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII），并据此修订《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》。 自 2022 年 4 月 1 日起，广发纳斯达克 100 指数证券投资基金正式转型为广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII），《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同》生效，原《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》同日失效。</p>

	<p>份额的计算公式、认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在招募说明书和基金份额发售公告中确定并披露。</p>	
<p>五、基金备案（章节标题更改为“基金的存续”）</p>	<p><u>五、基金备案</u></p> <p><u>（一）基金备案的条件</u></p> <p><u>本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：</u></p> <p><u>1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；</u></p> <p><u>2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。</u></p> <p><u>（二）基金的备案</u></p> <p><u>基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起十日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起十日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。</u></p> <p><u>（三）基金合同的生效</u></p> <p><u>1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕且基金合同生效；</u></p> <p><u>2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告；</u></p> <p><u>3、在基金合同生效前，基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前任何人不得动用。</u></p> <p><u>（四）基金募集失败的处理方式</u></p> <p><u>基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：</u></p> <p><u>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</u></p> <p><u>2、在基金募集期限届满后三十日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期活期存款利息。</u></p> <p><u>（五）基金存续期内的基金份额持</u></p>	<p><u>五、基金的存续</u></p> <p>本基金基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当向中国证监会说明原因及报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。</p>

	<p><u>有人数量和资产规模</u></p> <p>本基金基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当向中国证监会说明原因及报送解决方案。</p> <p>法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。</p>	
<p>六、基金份额的申购与赎回</p>	<p>(二) 申购与赎回办理的开放日及时间</p> <p><u>1、开放日及开放时间</u></p> <p>上海证券交易所、深圳证券交易所和美国纳斯达克证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外，开放日的具体业务办理时间详见招募说明书的规定。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。</p> <p>若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。</p> <p><u>2、申购与赎回的开始时间</u></p> <p><u>本基金的申购自基金合同生效后不超过三个月开始办理。具体业务办理时间由基金管理人另行公告。</u></p> <p><u>本基金的赎回自基金合同生效后不超过三个月的时间开始办理。具体开放时间由基金管理人另行公告。</u></p> <p><u>在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人于开始申购或赎回的 2 日前在至少一种指定媒介公告。</u></p>	<p>(二) 申购与赎回办理的开放日及时间</p> <p>上海证券交易所、深圳证券交易所和美国纳斯达克证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外，开放日的具体业务办理时间详见招募说明书的规定。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。</p> <p>若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。</p>

<p>(四) 申购与赎回的程序</p> <p>3、申购与赎回申请的款项支付</p> <p>申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。</p> <p>投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构及其相关基金销售机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过十个工作日内划往投资者银行账户，但中国证监会另有规定除外。如果基金投资所处的交易所或外汇市场休市、本基金所投资市场的交易清算规则有变更或国家外汇管理相关规定有变更影响赎回款项的划付的，赎回款项支付的时间将相应调整，基金管理人应及时在<u>指定媒介</u>上公告。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。</p> <p>(八) 申购与赎回的注册登记</p> <p>2、投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，<u>投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额</u>。</p> <p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p><u>(10) 接受某笔或某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%或者变相规避 50%集中度时。</u>(删除，序号依次调整)</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。发生上述第(9)、<u>(10)</u>项以外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停或拒绝申购的，基金管理人应当在<u>指定媒介</u>上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>(四) 申购与赎回的程序</p> <p>3、申购与赎回申请的款项支付</p> <p>申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。</p> <p>投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构及其相关基金销售机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过十个工作日内划往投资者银行账户，但中国证监会另有规定除外。如果基金投资所处的交易所或外汇市场休市、<u>且目标 ETF 暂停交易或赎回</u>、本基金所投资市场的交易清算规则有变更或国家外汇管理相关规定有变更影响赎回款项的划付的，赎回款项支付的时间将相应调整，基金管理人应及时在<u>规定媒介</u>上公告。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。</p> <p>(八) 申购与赎回的注册登记</p> <p>2、投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续。</p> <p>(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p><u>(11) 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；</u></p> <p><u>(12) 目标 ETF 暂停申购、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申购的情形；</u>(新增，序号依次调整)</p> <p>基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。发生上述第(9)项以外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停或拒绝申购的，基金管理人应当在<u>规定媒介</u>上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人</p>
--	--

		<p>应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：</p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(9) 目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或证券交易所场内交易停牌等有必要暂停本基金赎回的情形；</u>（新增，序号依次调整）</p>
八、基金合同当事人及其权利义务	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>名称：广发基金管理有限公司</p> <p>住所：<u>广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）</u></p>	<p>(一) 基金管理人</p> <p>1、基金管理人基本情况</p> <p>名称：广发基金管理有限公司</p> <p>住所：<u>广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室</u></p>
九、基金份额持有人大会	<p>(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。</p>	<p>(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。</p> <p><u>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席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，其持有的享有表决权的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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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</u></p>

		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。
十四、基金的投资	<p>(一) 投资目标</p> <p>本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。</p> <p>(二) 投资范围</p> <p>本基金投资范围为美国证券市场中的纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股、以纳斯达克 100 指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等，其中，对纳斯达克 100 指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%，对纳斯达克 100 指数备选成份股及以纳斯达克 100 指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）的投资比例不高于基金资产净值的 10%，现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、公募基金、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。</p> <p>(三) 投资理念</p>	<p>(一) 投资目标</p> <p>本基金主要通过投资于目标 ETF，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。</p> <p>(二) 投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF（广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金）、美国证券市场中的纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股、以纳斯达克 100 指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等，其中，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、公募基金、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。</p> <p>(三) 投资理念</p>

<p>本基金以跟踪纳斯达克 100 指数为原则，采用被动式指数化投资方法，为投资者提供一个投资于美国纳斯达克市场的有效投资工具。</p> <p>（四）投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。</p> <p>本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.5%，基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 5%。</p> <p>本基金对纳斯达克 100 指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%，对纳斯达克 100 指数备选成份股及以纳斯达克 100 指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）的投资比例不高于基金资产净值的 10%，现金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%。</p> <p>2、权益类投资策略</p> <p>（1）股票组合构建原则</p> <p>本基金主要采用完全复制法来跟踪纳斯达克 100 指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。</p> <p>（2）股票组合构建方法</p> <p>本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，降低跟踪误差。</p> <p>如有因受股票停牌、股票流动性或其他一些影响指数复制的市场因素</p>	<p>本基金主要通过投资于目标 ETF，以跟踪纳斯达克 100 指数表现，为投资者提供一个投资于美国纳斯达克市场的有效投资工具。</p> <p>（四）投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>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。在正常情况下，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 0.5% 以内，年跟踪误差控制在 5% 以内。</p> <p>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。</p> <p>2、目标 ETF 投资策略</p> <p>（1）投资组合的投资方式</p> <p>本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券交易所场内交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。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。</p> <p>（2）投资组合的调整</p> <p>本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资目标 ETF 的时间和方式。</p> <p>1) 当净申购时，本基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、目标 ETF 的申购或买入等；</p> <p>2) 当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定目标 ETF 的赎回或卖出等。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>（1）股票组合构建原则</p> <p>根据标的指数，结合研究判断和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。</p> <p>（2）股票组合构建方法</p> <p>本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的</p>
---	---

<p>的限制，使基金管理人无法依指数权重购买成份股，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。</p> <p><u>(3) 股票组合调整</u></p> <p><u>1) 定期调整</u> 本基金股票组合根据所跟踪的纳斯达克 100 指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p><u>2) 不定期调整</u></p> <p><u>①与指数相关的调整</u> 当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。</p> <p><u>②申购赎回调整</u> 根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。</p> <p><u>③其他调整</u> 对于标的指数成份股，若因其出现停牌限制、存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大的不利的司法诉讼、或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。</p> <p><u>(4) 投资组合绩效评估</u> 本基金对投资组合进行监控与评估时，以跟踪偏离度为核心监控指标，跟踪误差为辅助监控指标，对投资组合的日常调整就以最小化跟踪偏离度为原则，以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。</p> <p><u>1) 核心监控指标：跟踪偏离度</u> 第 n 日跟踪偏离度为第 n 日基金份额净值增长率减去第 n 日基金业绩比较基准增长率后的绝对值。</p> <p><u>2) 辅助监控指标：跟踪误差</u></p>	<p>方法，根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。</p> <p><u>(3) 股票组合的调整</u></p> <p><u>1) 定期调整</u> 本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p><u>2) 不定期调整</u> 基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。 本基金参与非标的指数成份股投资的，应当坚守产品定位，符合投资目标、投资策略、跟踪误差等要求，具有充分的投资依据，并履行基金管理人内部决策程序。</p> <p><u>4、固定收益类投资策略</u> 本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。</p> <p><u>5、衍生品投资策略</u> 本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品，如与标的指数或标的指数成份股相关的股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。</p>
---	--

跟踪误差一般考察的是一段交易时间内投资组合日收益率与比较基准日收益率的偏离情况，计算公式如下：

$$TE = \sqrt{\frac{1}{T-1} \sum_{t=1}^T (R_t^E)^2}$$

其中：TE 为基金跟踪误差， $R_t^E = R_t^P - R_t^B$ 为基金超额收益率， R_t^P 为基金净值收益率， R_t^B 为基准收益率，T 为历史天数。

基金管理人可以调整跟踪偏离度和跟踪误差的计算方法，并予以公告。

3、固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

4、衍生品投资策略

本基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生品，如与标的指数或标的指数成份股相关的股指期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金在金融衍生品的投资中主要遵循有效管理投资策略，对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低仓位频繁调整带来的交易成本。

（六）风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，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）投资决策

1、投资决策依据

（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。

	<p><u>有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。</u></p> <p><u>2、投资管理体制</u></p> <p><u>本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。</u></p> <p><u>3、投资程序</u></p> <p><u>研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。</u></p> <p><u>(1) 研究支持：国际业务部依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。</u></p> <p><u>(2) 投资决策：投资决策委员会依据国际业务部提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。</u></p> <p><u>(3) 组合构建：根据标的指数，结合研究报告，基金经理主要以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。</u></p> <p><u>(4) 交易执行：中央交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。</u></p> <p><u>(5) 绩效评估：监察稽核部定期和</u></p>	
--	---	--

<p><u>不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、跟踪误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此总结和检讨投资策略，进而调整投资组合。</u></p> <p><u>(6) 组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数的变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</u></p> <p><u>基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并予以公告。(删除，序号依次调整)</u></p> <p><u>(八) 投资限制</u></p> <p><u>1、投资组合限制</u> 本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p><u>(九) 禁止行为</u></p> <p><u>11、买卖其他基金份额，但是监管部门另有规定的除外；(删除，序号依次调整)</u></p> <p><u>12、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</u></p> <p><u>13、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；(删除，序号依次调整)</u></p> <p><u>(十一) 投资组合比例调整</u> 基金管理人应当自基金合同生效之</p>	<p><u>(七) 投资限制</u></p> <p><u>1、投资组合限制</u> 本基金的投资组合将遵循以下限制： <u>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；</u> <u>(2) 现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；(新增，序号依次调整)</u></p> <p><u>(八) 禁止行为</u></p> <p><u>11、向其基金管理人、基金托管人出资；</u></p> <p><u>(十) 投资组合比例调整</u></p>
--	---

	<p>日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除前述本基金投资组合限制第<u>(7)、(8)</u>条外，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基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。</p> <p>(十二) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法</p> <p>1、基金管理人按照国家有关规定代</p>	<p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除前述本基金投资组合限制第<u>(2)、(9)、(10)</u>条外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、<u>目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌</u>等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。</p> <p><u>(十一) 目标 ETF 发生相关变更情形时的处理</u></p> <p><u>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；若届时本基金管理人已有以该指数作为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，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将删除关于目标 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。</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(2) 目标 ETF 终止上市；</u></p> <p><u>(3) 目标 ETF 基金合同终止；</u></p> <p><u>(4)目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）。</u></p> <p><u>若目标 ETF 变更标的指数，本基金将相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。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。（新增）</u></p> <p>(十二) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法</p> <p>1、基金管理人按照国家有关规定代表</p>
--	---	--

	<p>表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益；</p> <p>（十三）未来条件许可情况下的基金模式转换</p> <p>本基金管理人将在条件成熟时另行安排在证券交易所场内接受基金份额的申购赎回和上市交易使本基金转型为同一标的的指数的上市型开放式基金（LOF），其场内申购赎回、上市交易、注册登记、收益分配等场内业务规则遵循本基金上市交易的证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定，届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会<u>核准或备案</u>并提前公告。</p> <p><u>若将来本基金管理人推出同一标的的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会核准或备案并提前公告。</u></p>	<p>基金独立行使<u>股东或</u>债权人权利，保护基金投资者的利益；</p> <p>（十三）未来条件许可情况下的基金模式转换</p> <p>本基金管理人将在条件成熟时另行安排在证券交易所场内接受基金份额的申购赎回和上市交易使本基金转型为同一标的的指数的上市型开放式基金（LOF），其场内申购赎回、上市交易、注册登记、收益分配等场内业务规则遵循本基金上市交易的证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定，届时无须召开基金份额持有人大会但须报中国证监会备案并提前公告。</p> <p><u>（十四）基金的融资、融券</u></p> <p><u>本基金可以根据有关法律法规和政策规定进行融资、融券。</u></p>
<p><u>十五、基金的融资、融券</u>（删除，章节序号依次调整）</p>	<p><u>本基金可以根据有关法律法规和政策规定进行融资、融券。</u>（删除）</p>	
<p>十六、基金资产的估值</p>	<p>（三）估值对象</p> <p>本基金所拥有的股票和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。</p> <p>（四）估值方法</p> <p><u>5、基金估值方法</u></p> <p>（1）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘</p>	<p>（三）估值对象</p> <p>本基金所拥有的<u>目标 ETF 份额</u>、股票和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。</p> <p>（四）估值方法</p> <p><u>1、目标 ETF 份额的估值</u></p> <p><u>本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日基金份额净值估值，若估值日为非交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。</u>（新增、序号依次调整）</p> <p><u>6、基金（不含目标 ETF）估值方法</u></p> <p>（1）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。</p>

	<p>价估值。</p> <p>(2)其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>7、在任何情况下，基金管理人如采用本项 <u>1-6</u> 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项 <u>1-6</u> 小项规定的方法对基金财产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>(六) 暂停估值的情形</p> <p>(九) 特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按本条(四)估值方法中的第 <u>7</u> 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>	<p>(2)其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>8、在任何情况下，基金管理人如采用本项 <u>1-7</u> 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项 <u>1-7</u> 小项规定的方法对基金财产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>(六) 暂停估值的情形</p> <p><u>6、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；</u> (新增、序号依次调整)</p> <p>(九) 特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按本条(四)估值方法中的第 <u>8</u> 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p>
十七、基金的费用与税收	<p>(一) 基金费用的种类</p> <p><u>4、基金的指数使用费</u> (删除、序号依次调整)</p> <p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p><u>1、基金管理人的管理费</u> <u>基金管理人的基金管理费(如基金管理人委托境外投资顾问,包括投资顾问费)按基金资产净值的0.80%年费率计提。</u> <u>在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下:</u> $H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日应计提的基金管理费</u> <u>E 为前一日基金资产净值</u> <u>基金管理费每日计提,按月支付。</u> <u>由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。</u></p> <p><u>2、基金托管人的托管费</u></p>	<p>(一) 基金费用的种类</p> <p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p><u>1、基金管理人的管理费</u> <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。基金管理人的基金管理费(如基金管理人委托境外投资顾问,包括投资顾问费)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(若为负数,则取0)的0.80%年费率计提。</u> <u>计算方法如下:</u> $H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日应计提的基金管理费</u> <u>E 为前一日的基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值,若为负数,则 E 取 0</u> <u>基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管</u></p>

<p><u>基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）按基金资产净值的 0.25%年费率计提。</u></p> <p><u>在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：</u></p> <p><u>$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$</u></p> <p><u>H 为每日应计提的基金托管费</u></p> <p><u>E 为前一日基金资产净值</u></p> <p><u>基金托管费每日计提，按月支付。</u></p> <p><u>由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。</u></p> <p>3、销售服务费</p> <p>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 类基金份额资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：</p> <p>$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。</p> <p>销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。</p> <p><u>销售服务费使用范围不包括基金募集期间的上述费用。</u></p> <p>4、基金的指数使用费</p> <p><u>本基金作为指数基金，需根据与指数所有人 NASDAQ OMX Group, Inc. 签署的指数使用许可协议的约定向</u></p>	<p><u>理费划付指令，基金托管人复核后 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。</u></p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p><u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）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（若为负数，则取 0）的 0.25%年费率计提。</u></p> <p><u>计算方法如下：</u></p> <p><u>$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$</u></p> <p><u>H 为每日应计提的基金托管费</u></p> <p><u>E 为前一日基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0</u></p> <p><u>基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。</u></p> <p>3、销售服务费</p> <p>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 类基金份额资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：</p> <p>$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。</p> <p>销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。</p>
---	---

	<p><u>NASDAQ OMX Group, Inc. 支付指数使用费。</u></p> <p><u>通常情况下，基金每日应支付的指数使用费在次日按每日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：</u></p> <p><u>(1) 当 E ≤ 1 亿美元时：</u></p> <p><u>$H = E \times 0.06\% \div 365$</u></p> <p><u>(2) 当 E > 1 亿美元时：</u></p> <p><u>$H = 1 \text{ 亿美元} \times 0.06\% \div 365 + (E - 1 \text{ 亿美元}) \times 0.04\% \div 365$</u></p> <p><u>H 为每日应当计提且在次日实际计提的指数使用费</u></p> <p><u>E 为每日的基金资产净值</u></p> <p><u>指数使用费收取下限为每年 4 万美元（年度最低指数使用费），即不足 4 万美元时按照 4 万美元收取。</u></p> <p><u>年度最低指数使用费应在基金合同生效日及基金运作每满一整年时支付，每日应支付的指数使用费按季度从当年支付的年度最低指数使用费中抵扣。在指数使用费支付日，基金管理人向基金托管人发送基金指数使用费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</u></p> <p><u>如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告并通知基金托管人。此项调整无需召开基金份额持有人大会。（删除）</u></p> <p><u>5、本条第（一）款第 5 至第 14 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。</u></p>	<p><u>4、本条第（一）款第 4 至第 13 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。</u></p>
<p>十八、基金收益与分配</p>	<p><u>(三) 收益分配原则</u></p> <p><u>2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的</u></p>	<p><u>(三) 收益分配原则</u></p> <p><u>2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式</u></p>

	<p>分红方式为现金红利；<u>如基金份额持有人在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；</u></p> <p>5、收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同。<u>美元收益分配金额按除权前一日中国人民银行最新公布的人民币对美元汇率中间价折算为相应的美元金额；</u></p>	<p>为现金红利；</p> <p>5、收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同。<u>美元现汇基金份额的每份额分配金额根据人民币份额的每份额分配数额按照除权日美元对人民币汇率进行折算；</u></p>
<p>二十、基金的信息披露</p>	<p>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。</p> <p>本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。</p> <p><u>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。</u></p> <p>（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……</p> <p><u>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三日前，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指定报刊上，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</u></p>	<p>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。</p> <p>本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。</p> <p><u>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”）及规定互联网网站（以下简称“规定网站”或“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。规定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。规定网站应当无偿向投资者提供基金信息披露服务。</u></p> <p>（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……</p>

	<p><u>金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并将基金产品资料概要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网站上。</u></p> <p><u>（二）基金份额发售公告</u> 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报刊和网站上。</p> <p><u>（三）基金合同生效公告</u> 基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒介和网站上登载基金合同生效公告。（删除，序号依次调整）</p> <p><u>（六）临时报告与公告</u> <u>8、基金募集期延长或提前结束募集；（删除，序号依次调整）</u></p>	<p><u>（四）临时报告与公告</u> <u>28、本基金变更目标 ETF；（新增）</u></p>
二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 <u>十五</u> 以上。	7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 <u>二十年</u> 以上。
二十四、基金合同的效力	<u>（一）本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件，应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立，于基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。</u>	<u>（一）本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向中国证监会备案。本基金合同由《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》修订而成。自 2022 年 4 月 1 日起，本基金合同生效，原《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》失效。</u>
二十五、基金合同摘要	根据以上内容对应修改。	根据以上内容对应修改。

附件 2：《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）托管协议》修订对照表

章节	广发纳斯达克 100 指数证券投资基金托管协议	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）托管协议
全文	广发纳斯达克 100 指数证券投资基金	广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）
全文	指定媒介	规定媒介
全文	指定报刊	规定报刊
全文	指定网站	规定网站
一、基金托管协议当事人	<p>（一）基金管理人 名称：广发基金管理有限公司 住所：<u>广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-49848（集中办公区）</u></p> <p>（二）基金托管人 名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”） 住所：北京市复兴门内大街 1 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼 法定代表人：刘连舸 成立时间：1983 年 10 月 31 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 联系人：王徽 联系电话：010-66594905 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。</p>	<p>（一）基金管理人 名称：广发基金管理有限公司 住所：<u>广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2608 室</u></p> <p>（二）基金托管人 名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”） 住所：北京市复兴门内大街 1 号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼 法定代表人：刘连舸 成立时间：1983 年 10 月 31 日 组织形式：股份有限公司 注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整 存续期间：持续经营 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号 经营范围：<u>吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；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</u></p>

		<p>买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。</p>
二、基金托管协议的依据、目的和原则	<p>（一）订立托管协议的依据</p> <p>本协议依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》、《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》）及其他有关法律法规与《广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>	<p>（一）订立托管协议的依据</p> <p>本协议依据《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信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》、《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》）及其他有关法律法规与《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）订立。</p>
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金投资范围为美国证券市场中的纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股、以纳斯达克 100 指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等，其中，对纳斯达克 100 指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的 85%，对纳斯达克 100 指数备选成份股及以纳斯达克 100</p>	<p>（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF（广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金）、美国证券市场中的纳斯达克 100 指数成份股、备选成份股、以纳斯达克 100 指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等，其中，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，现金或者到期</p>

<p>指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）的投资比例不高于基金资产净值的 10%，现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、公募基金、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>基金管理人应将拟投资的股票库、纳斯达克 100 指数成份股股票库、备选成份股股票库、以纳斯达克 100 指数为投资标的的 ETF 等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p><u>（1）投资组合限制</u></p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p><u>（2）金融衍生品投资</u></p> <p>本基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理，不得用于投机或放大交易，同时应当严格遵守下列规定：</p> <p>1) 本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。</p> <p>2) 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。</p>	<p>日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、公募基金、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。</p> <p>基金管理人应将拟投资的股票库、纳斯达克 100 指数成份股股票库、备选成份股股票库、以纳斯达克 100 指数为投资标的的 ETF 等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>2) 现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；（新增，序号依次调整）</p>
---	---

	<p><u>3) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：</u></p> <p><u>①所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。</u></p> <p><u>②交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。</u></p> <p><u>③任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。</u></p> <p><u>4) 基金管理人应当在本基金会计年度结束后 60 个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。</u></p> <p><u>5) 本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。</u></p> <p><u>（3）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：</u></p> <p><u>1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。</u></p> <p><u>2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。</u></p> <p><u>3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。</u></p> <p><u>4) 除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：</u></p> <p><u>①现金；</u></p> <p><u>②存款证明；</u></p> <p><u>③商业票据；</u></p> <p><u>④政府债券；</u></p> <p><u>⑤中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。</u></p> <p><u>5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出</u></p>	
--	---	--

	<p>的证券。</p> <p><u>6) 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。</u></p> <p><u>(4) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：</u></p> <p><u>1) 所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。</u></p> <p><u>2) 参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。</u></p> <p><u>3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。</u></p> <p><u>4) 参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。</u></p> <p><u>5) 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。</u></p> <p><u>(5) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。</u></p> <p><u>3、对基金投资禁止行为进行监督。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：</u></p> <p><u>(1) 购买不动产；</u></p> <p><u>(2) 购买房地产抵押按揭；</u></p> <p><u>(3) 购买贵金属或代表贵金属</u></p>	
--	---	--

	<p>的凭证；</p> <p><u>(4) 购买实物商品；</u></p> <p><u>(5) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%；</u></p> <p><u>(6) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；</u></p> <p><u>(7) 参与未持有基础资产的卖空交易；</u></p> <p><u>(8) 从事证券承销业务；</u></p> <p><u>(9) 向他人贷款或者提供担保；</u></p> <p><u>(10) 从事承担无限责任的投资；</u></p> <p><u>(11) 买卖其他基金份额，但是监管部门另有规定的除外；</u></p> <p><u>(12) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</u></p> <p><u>(13) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；</u></p> <p><u>(14) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</u></p> <p><u>(15) 不公平对待不同客户或不同投资组合；</u></p> <p><u>(16) 除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料；</u></p> <p><u>(17) 依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。</u></p> <p><u>为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；(删除，序号依次调整)</u></p>	
<p>四、基金管理人 对基金 托管人的 业务 核查</p>	<p>(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规</p>	<p>(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时</p>

	<p>定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人报告中国证监会。</p>	<p>以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应<u>按照法律法规的规定报告中国证监会。</u></p>
五、基金托管人承担的受托人职责和托管职责	<p>(一) 基金托管人应当按照有关法律法规履行下列受托人职责： 2、<u>安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；</u></p>	<p>(一) 基金托管人应当按照有关法律法规履行下列受托人职责： 2、<u>安全保护基金财产，按本协议约定将公司行为信息通知基金管理人；</u></p>
六、基金财产的保管	<p>(一) 基金财产保管的原则 <u>1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。</u></p> <p><u>4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。</u></p> <p><u>8、除非基金合同、托管协议另有规定或根据基金管理人书面同意，基金托管人自身，并应尽商业上的合理努力确保境外托管人不得在任何基金资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押、留置等，但根据有关适用法律的规定而产生的担保权利除外。</u></p>	<p>(一) 基金财产保管的原则 <u>1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、境外托管代理人的固有财产，但上述资产不包括：(1) 由基金托管人或境外托管代理人在清算机构或其他证券集中处理系统中持有的证券；(2) 在过户代理人处保存的集合投资工具中的无凭证份额或其他权益。基金托管人及其境外托管代理人不对证券托管机构负责。</u></p> <p><u>4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。如果本基金投资的境外市场的某些货币同类存款的通行利率为负值，境外托管人可能会对境外托管账户中的现金收取利息或相应费用。</u></p> <p><u>8、基金托管人在因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告清盘或破产等原因进行终止清算时，不得将任何证券、非现金资产及其收益归入其清算财产；境外托管代理人因上述同样原因进行终止清算时，基金托管人应当要求境外托管代理人不得将证券、非现金资产及其收益归入其清算财产，但当地的法律、法规和市场惯例不允许托管证券独立于清算财产的情况除外。基金托管人应当确保自身及境外托管代理人采取商业上的合理行动以保证证券、非现金资产的任何部分不会在其进行清算时，作为可分配财产</u></p>

	<p><u>(二) 基金募集期间及募集资金的验资</u></p> <p><u>1、基金募集期间的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人以基金管理人的名义开立并管理。</u></p> <p><u>2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合基金合同及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。验资完成后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立并指定的基金托管银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。</u></p> <p><u>3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同及其他有关规定的生效条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。(删除)</u></p>	<p><u>分配给其债权人。当基金托管人知道托管资产的任何一部份将被视为托管人的清算财产时，托管人应尽快通知基金管理人。双方理解在全球托管模式下，现金存入现金账户时构成境外托管代理人的等额债务，除非法律法规及撤销或清盘程序明文规定该等现金不归于清算财产外。</u></p> <p><u>(二) 实物证券保管</u></p> <p><u>基金托管人可在以下情况下同意就在境外发行的实物证券（以下简称“实物证券”）提供保管服务，但需取决于该市场上是否有此类服务：</u></p> <p><u>(1) 基金管理人应在实物证券交付之前将相关证券的价值、到期日、要素等其他基金托管人需要的信息告知基金托管人。基金托管人不负责为证券从对方运送至基金托管人的途中安排保险或运输。如基金管理人确需基金托管人安排保险或运输时，双方可另行协商。当基金托管人被要求交付此类证券时，基金托管人会安排适当的运输。经基金管理人申请，基金托管人可安排适当保险。在实物证券交付过程中产生的保险费（如有）、运输费及其他合理费用将由基金管理人支付。</u></p> <p><u>(2) 双方同意，如果实物证券在由基金托管人交付给运输服务提供商的过程中发生丢失或损坏，托管人只对因自身过失或过错造成的直接损失负责，但托管人应协助管理人从运输服务提供商处或保险公司处追回损失。</u></p> <p><u>(3) 对于不以托管人名义持有的受限实物证券，有关公司行动的信息可能会被延误或不能从普遍认可的行业信息来源处获得，托管人不能保证此等信息的完整性和准确性，与此证券有关的支付可能会被延迟。相应地，托管人将与受限实物证券有关的、及时代收支付款并将完整准确的公司行动信息转达给管理人的能力是受到与此类证券有关的行业和市场惯例制约的。托管人仅在实际收到有关此类公</u></p>
--	--	--

	<p>(三) 基金银行账户的开立和管理</p> <p><u>2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。</u></p> <p><u>3、本基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。</u></p> <p><u>4、基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。</u></p> <p><u>(四) 基金证券账户的开立和管理</u></p> <p><u>4、除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）。</u></p> <p><u>5、基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。</u></p>	<p><u>司行动信息，且没有因发行方及其顾问或其他有关各方所设的限定条件而被阻止参与此类公司行动的情况下，才为受限实物证券服务。在不违反此款规定的前提下，托管人仍应尽合理努力获取该类信息。（新增）</u></p> <p>(三) 基金银行账户的开立和管理</p> <p><u>2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。</u></p> <p><u>3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。</u></p> <p><u>4、基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区法律法规及监管机构的有关规定。</u></p> <p><u>(四) 基金进行定期存款投资的账户开设和管理</u></p> <p><u>基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。（新增，序号依次调整）</u></p> <p><u>(五) 基金证券账户的开立和管理</u></p> <p><u>4、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。</u></p> <p><u>5、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务</u></p>
--	--	--

	<p><u>(七) 与基金财产有关的重大合同的保管</u></p> <p>基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。</p>	<p>的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。</p> <p>(新增，序号依次调整)</p> <p><u>(八) 与基金财产有关的重大合同的保管</u></p> <p>基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证<u>基金乙方</u>有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。</p> <p><u>(九) 公司行动</u></p> <p><u>基金托管人收到与证券账户中持有的证券相关的公司行动信息后，应在合理时间内将公司行动及回复的截止日期以合适的方式通知基金管理人。若基金管理人没有在回复截止日期前发出有关公司行动的指令，基金托管人将按照默认的公司行动指令行事。若无事先约定，基金托管人有权出于基金利益考虑按照商业上合理的方式自行决定采取或不采取行动，而不承担任何责任。如果境外托管人对其在履职过程中是否应采取相应行动存在疑问，境外托管人可以获取法律顾问或相应机构的建议，托管人不承担境外托管人按照该建议行事的责任。</u>(新增)</p> <p><u>(十) 备用信贷服务</u></p> <p><u>为应付交易清算等临时用途，经基金管理人申请，基金托管人可代为向境外托管代理人申请不超过基金净值 10% 的授信垫款。基金管理人应按时返还境外托管代理人垫付的欠款，支付约定的利息和其他费用。</u></p>
--	---	---

		<p><u>基金托管人(或授权境外托管代理人)可从该基金开立于托管人或境外托管代理人处的开立的任何现金账户直接扣除因使用上述垫款而给基金托管人及境外托管代理人产生的负债(包括基金托管人及境外托管代理人垫付的现金、以约定利率计算的利息以及相关合理费用,以下统称“负债”)。若现金账户余额不足以完全偿付该负债,托管人及境外托管代理人将通知管理人补足相应款项;若在基金托管人和境外托管人规定的工作日内仍未补足,则基金托管人有权(或授权境外托管代理人)留置该基金项下资产,并从本基金证券账户中直接处置价值相当的证券以归还剩余负债。如发生采取以上措施仍不能偿还负债的极端情况时,管理人有责任采取其他措施,使上述负债得到全额偿付。(新增)</u></p>
七、指令的发送、确认及执行	<p>基金管理人或其委托的第三方机构在运用基金财产时向基金托管人或境外托管人发送包括但不限于资金划拨和交易清算交收指令,基金托管人执行基金管理人或其委托的第三方机构的指令、办理基金的资金往来等有关事项。</p>	<p>基金管理人或其委托的第三方机构在运用基金财产时向基金托管人或境外托管人发送包括但不限于资金划拨和交易清算交收指令,基金托管人执行基金管理人或其委托的第三方机构的指令、办理基金的资金往来等有关事项。</p> <p><u>基金管理人(含其委托的第三方机构)发送的指令包括电子指令和纸质指令。每一笔跨境资金汇出,管理人需确保资金净汇出金额不超过管理人从监管机构处获批的投资额度。</u></p> <p><u>电子指令包括基金管理人发送的电子指令(采用深证通金融数据交换平台发送的电子指令、采用 SWIFT 电子报文发送的电子指令、通过中国银行托管网银发送的电子指令)、自动产生的电子指令(基金托管人的全球托管系统根据基金管理人的授权通过预先设定的业务规则自动产生的电子指令)。</u></p> <p><u>电子指令一经发出即被视为合法有效指令,传真纸质指令作为应急方式备用。基金管理人通过深证通金融数据交换平台发送的电子指令,基金托管人根据 USER ID 和 APP ID 唯一识别基</u></p>

	<p>(一) 基金管理人对于指令有关的书面授权</p> <p><u>2、基金管理人向基金托管人发出的授权通知应加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。基金托管人在收到授权通知后以电话确认，授权于通知载明的时间生效。基金管理人对于授权通知应当以传真的形式发送给基金托管人，同时电话通知基金托管人，基金托管人收到通知后应向基金管理人电话确认，授权于通知载明的时间生效。基金管理人此后3个工作日内将授权通知文件原件送交基金托管人。</u></p> <p>4、基金管理人和基金托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。</p> <p><u>(二) 指令的内容</u></p> <p>1、指令是基金管理人在运作基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨及投资指令。包括但不限于各类资金划拨指令(含赎回、分红付款指令)、交易清算交收指令、实物证券出入库指令等。</p> <p>(三) 指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1、指令的发送</p> <p>指令由基金管理人用传真或其他双方确认的方式向基金托管人或境外托管人发送。对于符合授权通知及约定程序的指令，基金管理人不得否认其效力。但如果基金管理人已经撤销或更改授权通知，并且基金托管人根据本协议确认后，则对于此后原交易指令发送人员或机构无</p>	<p>金管理人身份，基金管理人应妥善保管 USER ID 和 APP ID, 基金托管人身份识别后对于执行该电子指令造成的任何损失基金托管人不承担责任。</p> <p>(一) 基金管理人对于指令有关的书面授权</p> <p><u>2、基金管理人向基金托管人发出的授权通知应加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。基金管理人向基金托管人以传真的形式发送授权通知后同时电话通知基金托管人。授权通知自基金托管人接到基金管理人的电话确认后于通知载明的生效时间起生效。通知载明的生效时间不得早于电话确认时间。基金管理人此后3个工作日内将授权通知原件送交基金托管人。</u></p> <p>4、基金管理人和基金托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露，法律法规规定或有权机关、审计机构要求的除外。</p> <p><u>(二) 指令的内容</u></p> <p>1、指令是基金管理人在运作基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨及投资指令。包括但不限于各类资金划拨指令(含赎回、分红付款指令)、交易清算交收指令、实物证券出入库指令等。<u>相关登记结算公司向基金托管人发送的结算通知视为基金管理人向基金托管人发出的指令。</u></p> <p>(三) 指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1、指令的发送</p> <p>指令由基金管理人用传真或其他双方确认的方式向基金托管人或境外托管人发送。对于符合授权通知及约定程序的指令，基金管理人不得否认其效力。但如果基金管理人已经撤销或更改授权通知，并且基金托管人根据本协议确认后，则对于此后原交易指令发送人员或机构无权发送的指令，或</p>
--	---	---

	<p>权发送的指令，或超权限发送的指令，基金管理人不承担责任，授权已更改但未通知基金托管人的情况除外。</p> <p>基金管理人委托第三方机构向基金托管人发送指令的，基金管理人应对其委托的第三方机构发送的指令负责。</p> <p>指令发出后，基金管理人应及时向基金托管人或境外托管人确认。</p> <p>基金管理人和基金托管人将另行约定某些指令的接收截止时间，基金管理人应在接收截止时间前向基金托管人发出指令并与基金托管人或境外托管人确认。指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，致使资金未能及时到账、证券清算交收延误所造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金的银行存款账户有足够的资金余额，确保基金的证券账户有足够的证券余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，基金托管人可不予执行，但应立即通知基金管理人，由此造成的损失，由基金管理人承担。</p>	<p>超权限发送的指令，基金管理人不承担责任，授权已更改但未通知基金托管人的情况除外。</p> <p><u>基金管理人应按照《基金合同》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，基金管理人应及时电话通知基金托管人或境外资产托管人。基金管理人委托第三方机构向基金托管人发送指令的，基金管理人应对其委托的第三方机构发送的指令负责。</u></p> <p>指令发出后，基金管理人应及时向基金托管人或境外托管人确认。</p> <p>基金管理人和基金托管人将另行约定某些指令的接收截止时间，基金管理人应在接收截止时间前向基金托管人发出指令并与基金托管人或境外托管人确认。指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，致使资金未能及时到账、证券清算交收延误所造成的损失由基金管理人承担。</p> <p>基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金的银行存款账户有足够的资金余额，确保基金的证券账户有足够的证券余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，基金托管人可不予执行，但应立即通知基金管理人，由此造成的损失，由基金管理人承担。</p> <p><u>（四）基金管理人发送错误指令的情形和处理程序</u></p> <p><u>基金管理人发送错误指令的情形主要包括：指令要素错误、无投资行为的指令、预留印鉴错误等情形。</u></p> <p><u>基金托管人发现基金管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。对基金管理人更正并重新发送后的指令经基金托管人核对确认后方能执行。（新增，序号依次调整）</u></p> <p><u>（五）基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</u></p> <p><u>基金托管人发现基金管理人的指令违</u></p>
--	--	--

	<p><u>(五) 更换授权通知的程序</u></p> <p>基金管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改），应当至少提前 1 个工作日通知基金托管人；修改授权通知的文件应由基金管理人加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。基金管理人<u>对授权通知的修改应当以传真的形式发送给基金托管人，同时电话通知基金托管人，基金托管人收到变更通知后应向基金管理人电话确认。</u>基金管理人<u>对授权通知的内容的修改经基金托管人确认后于通知载明的生效时间生效。</u>基金管理人<u>在此后 3 个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交基金托管人。</u></p>	<p><u>反法律法规规定或者《基金合同》约定，应当不予执行，并及时通知基金管理人要求其变更或撤销相关指令，若基金管理人在基金托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，基金托管人应当拒绝执行，并向中国证监会报告。（新增，序号依次调整）</u></p> <p><u>(七) 更换授权通知的程序</u></p> <p>基金管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改），应当至少提前 1 个工作日通知基金托管人；修改授权通知的文件应由基金管理人加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。基金管理人<u>对授权通知的修改应当以传真的形式发送给基金托管人，同时电话通知基金托管人。</u>基金管理人<u>对授权通知的内容的修改经基金托管人确认后于通知载明的生效时间生效。</u><u>通知载明的生效时间不得早于电话确认时间。</u>基金管理人<u>在此后 3 个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交基金托管人。</u></p>
<p>八、交易及清算交收安排</p>		<p><u>(一) 基金管理人负责选择代理本基金证券、期货买卖的证券经营机构、期货经纪机构</u></p> <p><u>1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：</u></p> <p><u>(1) 资金雄厚，信誉良好。</u></p> <p><u>(2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。</u></p> <p><u>(3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。</u></p> <p><u>(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。</u></p> <p><u>(5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、</u></p>

	<p><u>（一）基金投资证券后的清算交收安排</u></p> <p><u>1、清算与交割</u></p> <p><u>基金托管人负责基金买卖证券的清算交收。资金汇划由基金托管人根据基金管理人的交易成交结果和交易成交形式具体办理。</u></p> <p><u>如果因为基金托管人、境外托管人过错在清算上造成基金财产的损失，应由基金托管人负责赔偿基金所遭受的直接损失；如果由于基金管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖等原因造成基金投资清算困难和风险的，基金托管人发现后应立即通知基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基金造成的直接损失由基金管理人承担。</u></p>	<p><u>全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。</u></p> <p><u>2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</u></p> <p><u>基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议，并按照法律法规的规定向中国证监会报告。基金管理人应将委托协议（或交易单元租用协议）的原件及时送交基金托管人。</u></p> <p><u>3、基金管理人选择期货经纪机构，选择代理本基金期货交易的期货经纪机构的标准由其制定及变更。基金管理人选择期货经纪机构的程序比照前款进行。</u></p> <p><u>4、相关信息的通知</u></p> <p><u>基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人基金交易单元的号码、券商名称、佣金费率等基金基本信息以及变更情况，其中交易单元租用应至少在首次进行交易的 10 个工作日前通知基金托管人，交易单元退租应在次日内通知到基金托管人。（新增，序号依次调整）</u></p> <p><u>（二）基金投资证券后的清算交收安排</u></p> <p><u>1、清算与交割</u></p> <p><u>因本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交收，由基金托管人负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。如果因为基金托管人过错在清算上造成基金财产的损失，应由基金托管人负责赔偿基金所遭受的直接损失；如果由于基金管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖等原因造成基金投资清算困难和风险的，基金托管人发现后应立即通知基金管理人，由基金管理人负责解决，由此给基金造成的直接损失由基金管理人承担。</u></p> <p><u>由于基金管理人或基金托管人原因导</u></p>
--	---	---

	<p><u>基金管理人应采取合理措施，确保在资金结算前有足够的资金头寸用于交易资金结算。</u></p> <p>基金管理人授权基金托管人及其境外托管人，但基金托管人及其境外托管人没有义务，在账户现金不足的情况下垫付完成交易所需现金。基金管理人认可除非基金管理人及时支付，基金托管人及其境外托管人所垫付的现金及相关的合理费用应从基金财产中支付。基金管理人认可，基金托管人及其境外托管人有权直接从基金财产的现金账户中扣除其所垫付的现金及相关的合理费用。若相应现金账户中的金额不足，基金管理人应当按照基金托管人及其境外托管人的书面通知，向基金托管人及其境外托管人补足所需现金缺额，否则，基金托管人及其境外托管人对与已垫付现金和相关合理费用额度相当的基金财产按照本款第 2、3 项约定享有抵销或留置权。</p> <p><u>(三) 申购、赎回和基金转换的资金清算</u></p>	<p><u>致基金无法按时支付清算款时，责任方应对由此给基金财产造成的损失承担相应的赔偿责任。</u></p> <p><u>基金管理人应保证在基金托管人及境外托管人根据市场规则所要求的时间前基金银行账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算，如基金的资金头寸不足则基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。</u></p> <p><u>基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的划款指令时，基金银行账户或资金交收账户上有充足的资金。基金的资金头寸不足时，基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令，由此造成的损失，由基金管理人负责赔偿。基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间。对于要求当天到账的境内划款指令，应在当天 15:00 前发送；对于要求当天某一时点到账的境内划款指令，则指令需提前 2 个工作小时发送，并相关付款条件已经具备。</u></p> <p>基金管理人授权基金托管人及其境外托管人，但基金托管人及其境外托管人没有义务，在账户现金不足的情况下垫付完成交易所需现金。基金管理人认可除非基金管理人及时支付，基金托管人及其境外托管人所垫付的现金及相关的合理费用应从基金财产中支付。基金管理人认可，基金托管人及其境外托管人有权直接从基金财产的现金账户中扣除其所垫付的现金及相关的合理费用。若相应现金账户中的金额不足，基金管理人应当按照基金托管人及其境外托管人的书面通知，向基金托管人及其境外托管人补足所需现金缺额，否则，基金托管人及其境外托管人对与已垫付现金和相关合理费用额度相当的基金财产按照本款第 2、3 项约定享有抵销或留置权。</p> <p><u>(四) 申购、赎回和基金转换的资金清算</u></p>
--	---	---

	<p>1、T+2 日 15:00 前，注册登记机构根据 T 日基金份额净值计算基金投资者申购、赎回和转换基金的份额，并将清算确认的有效数据和资金数据汇总传输给基金托管人。基金管理人和基金托管人据此进行申购、赎回和转换的基金会计处理。</p>	<p>1、T+2 日 15:00 前，<u>基金管理人或其委托的</u>注册登记机构根据 T 日基金份额净值计算基金投资者申购、赎回和转换基金的份额，并将清算确认的有效数据和资金数据汇总传输给基金托管人。基金管理人和基金托管人据此进行申购、赎回和转换的基金会计处理。</p> <p><u>4、基金管理人未能按上款约定将托管账户净应收额全额、及时汇至基金托管账户，由此产生的责任应由该基金管理人承担；基金托管人未能按上款约定将托管账户净应付额全额、及时汇至“基金清算账户”，由此产生的责任应由基金托管人承担(不可抗力或基金托管人无过错的情况除外)。</u>（新增）</p> <p><u>5、基金管理人应将每个开放日的申购、赎回、转换开放式基金的数据传递给基金托管人。基金管理人应对传递的申购、赎回、转换开放式基金的数据真实性负责。基金托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据基金管理人指令及时划付赎回款项。</u>（新增）</p>
<p>九、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>（二）基金资产净值的计算和复核</p> <p>1、基金资产净值</p> <p><u>基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后的价值。</u></p> <p>2、复核程序</p> <p><u>基金管理人每个工作日对基金进行估值，估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。每个工作日下午 15: 00 之前，基金管理人将前一日的基金估值结果以双方确认的形式报送基金托管人。基金托管人应在收到上述估值结果后进行复核，并以双方确认的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人定期对外公布。基金月末、</u></p>	<p>（二）基金资产净值的计算和复核</p> <p>1、基金资产净值</p> <p><u>基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后的价值。国家法律法规另有规定的，从其规定。</u></p> <p>2、复核程序</p> <p><u>基金管理人每个工作日对基金财产估值，但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。每个工作日基金管理人将前一工作日的基金估值结果以双方确认的形式报送基金托管人。基金托管人应在收到上述估值结果后进行</u></p>

<p><u>年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</u></p> <p>3、<u>当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</u></p> <p>5、<u>当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当估值错误达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人并向中国证监会备案；当估值错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。</u></p> <p>7、<u>由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人及基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。</u></p>	<p><u>复核，并以双方确认的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人定期对外公布。基金月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</u></p> <p>3、<u>当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</u></p> <p>5、<u>当基金资产的估值导致任一类基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到该类基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通知基金托管人并向中国证监会备案；当计价错误达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当通知基金托管人，并报中国证监会备案的同时及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。</u></p> <p>7、<u>当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：</u></p> <p>①<u>本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。</u></p> <p>②<u>若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金</u></p>
---	---

	<p>9、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。</p> <p>(三) 基金会计核算</p> <p>3、基金财务报表和定期报告的编制和复核</p> <p>基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报</p>	<p>份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，基金管理人和基金托管人分别承担相应赔偿责任。</p> <p>③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。</p> <p>④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。</p> <p>9、基金管理人所投资品种，应提前与基金托管人沟通，确保拟投资品种在双方业务系统支持范围内。对于不在基金托管人业务系统支持范围内的新投资品种，基金管理人应为基金托管人预留足够的系统准备时间，并在必要时与基金托管人进行系统联合测试。同时基金管理人需提供该投资品种的会计核算方法，并与基金托管人协商一致，基金托管人以该会计核算方法为依据进行相关业务系统的准备工作。</p> <p>10、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基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>11、全球投资涉及不同市场及时区，由于时差、通讯或其他非可控的客观原因，在基金管理人和基金托管人协商一致的时间点前无法确认的交易，导致的对基金资产净值的影响，不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>(三) 基金会计核算</p> <p>3、基金财务报表和定期报告的编制和复核</p> <p>基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的</p>
--	---	--

	<p>表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。</p> <p><u>《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书，并登载在指定网站上；发生其他变更的，基金管理人至少每年更新一次基金招募说明书。</u></p> <p><u>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，并将年度报告正文登载于指定网站上，将年度报告提示性公告摘要登载在指定报刊媒介上。基金年度报告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。基金管理人应当在上半年结束之日起二个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告正文登载在指定网站上，将中期报告提示性公告摘要登载在指定媒介报刊上。基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上并将季度报告登载在指定媒介上。《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、半年度报告或者年度报告。</u></p>	<p>编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。</p> <p><u>《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书，并登载在指定网站上；发生其他变更的，基金管理人至少每年更新一次基金招募说明书。基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书及基金产品资料概要。</u></p> <p><u>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，并将年度报告正文登载于规定网站上，将年度报告提示性公告摘要登载在指定报刊媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。基金管理人应当在上半年结束之日起二个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告正文登载在指定网站上，将中期报告提示性公告摘要登载在指定媒介报刊上。基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定媒介上。《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、半年度报告或者年度报告。</u></p>
<p>十、基金收益分配</p>	<p>(二) 基金收益分配的时间和程序</p> <p>2、基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，由基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告；如果基金管理人于基金托管人不能于收益分配日之前就收益分配方案达成一致，基金托管人有义务将收益分</p>	<p>(二) 基金收益分配的时间和程序</p> <p>2、基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，由基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。</p>

	<p><u>配方案及相关情况的说明提交中国证监会备案并书面通知基金管理人，在上述文件提交完毕之日起基金管理人有权对外公告其拟订的收益分配方案，且基金托管人有义务协助基金管理人实施该收益分配方案，但有证据证明该方案违反法律法规及《基金合同》的除外。</u></p>	
<p>十一、基金信息披露</p>	<p>(一) 保密义务</p> <p>1、除按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、《信息披露办法》及其他有关规定外，基金管理人和基金托管人对基金运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应予保密。基金管理人与基金托管人对本基金的任何信息，不得在其公开披露之前，先行对双方和基金份额持有人大会以外的任何机构、组织和个人泄露。法律法规另有规定的除外。</p> <p>2、基金管理人和基金托管人除为合法履行法律法规、《基金合同》及本协议规定的义务所必要之外，不得为其他目的使用、利用其所知悉的基金的保密信息，并且应当将保密信息限制在为履行前述义务而需要了解该保密信息的职员范围之内。但是，如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务：</p> <p>(1) 非因基金管理人和基金托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；</p> <p>(2) 基金管理人和基金托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开。</p> <p>(二) 基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序</p> <p><u>2、本基金信息披露的所有文件，包括《基金合同》和本协议规定的定期报告、临时报告、基金产品资料</u></p>	<p>(一) 保密义务</p> <p>1、除按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、《信息披露办法》及其他有关规定外，基金管理人和基金托管人对基金运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应予保密。基金管理人与基金托管人对本基金的任何信息，<u>除法律法规规定之外</u>，不得在其公开披露之前，先行对双方和基金份额持有人大会以外的任何机构、组织和个人泄露。法律法规另有规定的除外。</p> <p>2、基金管理人和基金托管人除为合法履行法律法规、《基金合同》及本协议规定的义务所必要之外，不得为其他目的使用、利用其所知悉的基金的保密信息，并且应当将保密信息限制在为履行前述义务而需要了解该保密信息的职员范围之内。但是，如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务：</p> <p>(1) 非因基金管理人和基金托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；</p> <p>(2) 基金管理人和基金托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开。</p> <p><u>(3) 因审计、法律等专业服务向外部专业顾问提供信息，并要求专业顾问遵守保密义务。</u></p> <p>(二) 基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序</p> <p><u>2、本基金信息披露的所有文件，包括《基金合同》和本协议规定的基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、</u></p>

	<p>概要、基金净值信息及其它必要的公告文件，由基金管理人和基金托管人按照有关法律法规的规定予以公布。</p>	<p>澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、定期报告、临时报告、基金产品资料概要、基金净值信息及其它必要的公告文件，由基金管理人和基金托管人按照有关法律法规的规定予以公布。</p>
<p>十二、基金费用</p>	<p><u>（一）基金管理费的计提比例和计提方法</u> <u>基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托境外投资顾问，包括投资顾问费）按基金资产净值的0.80%年费率计提。</u> <u>在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：</u> $H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日应计提的基金管理费</u> <u>E 为前一日基金资产净值</u> <u>基金管理费每日计提，按月支付。</u> <u>由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。</u> <u>（二）基金托管费的计提比例和计提方法</u> <u>基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）按基金资产净值的0.25%年费率计提。</u> <u>在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：</u> $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日应计提的基金托管费</u> <u>E 为前一日的基金资产净值</u> <u>基金托管费每日计提，按月支付。</u> <u>由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。</u> <u>（三）基金的指数使用费</u> <u>本基金作为指数基金，需根据与指数所有人 NASDAQ OMX Group, Inc. 签署的指数使用许可协议的约定向</u></p>	<p><u>（一）基金管理费的计提比例和计提方法</u> <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托境外投资顾问，包括投资顾问费）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（若为负数，则取0）的0.80%年费率计提。</u> <u>计算方法如下：</u> $H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日应计提的基金管理费</u> <u>E 为前一日的基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取0</u> <u>基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。</u> <u>（二）基金托管费的计提比例和计提方法</u> <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）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（若为负数，则取0）的0.25%年费率计提。</u> <u>计算方法如下：</u> $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ <u>H 为每日应计提的基金托管费</u> <u>E 为前一日的基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取0</u> <u>基金托管费每日计提，按月支付。由</u></p>

	<p><u>NASDAQ OMX Group,Inc.支付指数使用费。</u></p> <p><u>通常情况下，基金每日应支付的指数使用费在次日按每日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：</u></p> <p><u>(1) 当 E≤1 亿美元时：</u></p> <p><u>$H=E \times 0.06\% \div 365$</u></p> <p><u>(2) 当 E>1 亿美元时：</u></p> <p><u>$H=1 \text{ 亿美元} \times 0.06\% \div 365 + (E - 1 \text{ 亿美元}) \times 0.04\% \div 365$</u></p> <p><u>H 为每日应当计提且在次日实际计提的指数使用费</u></p> <p><u>E 为每日的基金资产净值</u></p> <p><u>指数使用费收取下限为每年 4 万美元（年度最低指数使用费），即不足 4 万美元时按照 4 万美元收取。</u></p> <p><u>年度最低指数使用费应在基金合同生效日及基金运作每满一整年时支付，每日应支付的指数使用费按季度从当年支付的年度最低指数使用费中抵扣。在指数使用费支付日，基金管理人向基金托管人发送基金指数使用费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</u></p> <p><u>如果指数使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告并通知基金托管人。此项调整无需召开基金份额持有人大会。</u></p>	<p><u>基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。</u></p> <p><u>(三) 销售服务费的计提比例和计提方法</u></p> <p><u>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 类基金份额资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：</u></p> <p><u>$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$</u></p> <p><u>H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费</u></p> <p><u>E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值</u></p> <p><u>基金销售服务费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。</u></p> <p><u>销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。</u></p>
<p>十三、基金份额持有人名册的保管</p>	<p><u>(三) 基金份额持有人名册的保管</u></p> <p><u>基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保管持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。</u></p> <p><u>基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、基金</u></p>	<p><u>(三) 基金份额持有人名册的保管</u></p> <p><u>基金份额持有人名册由基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，基金登记机构保存期不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资</u></p>

	<p>合同和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行基金合同和本协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。</p>	<p>料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。</p>
十六、禁止行为	<p>(一)《基金法》第二十条、<u>第三十一条</u>禁止的行为。</p> <p>(二)《基金法》<u>第五十九条</u>禁止的投资或活动。</p>	<p>(一)《基金法》第二十条、<u>第三十八条</u>禁止的行为。</p> <p>(二)《基金法》<u>第七十三条</u>禁止的投资或活动。</p>
十七、托管协议的修改、终止与基金财产的清算	<p>(一) 托管协议的修改程序</p> <p>本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。</p>	<p>(一) 托管协议的修改程序</p> <p>本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案后生效。</p>
十八、违约责任	<p>(一) 基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规、基金合同或本托管协议约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。</p> <p><u>(二) 当事人违约，给另一方当事人或基金财产造成损失的，应就直接损失进行赔偿；</u> 另一方当事人有权利及义务代表基金向违约方追偿。如发生下列情况，当事人可以免责：</p> <p>(三) 当事人违约，另一方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。</p> <p>(四) 违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，基金管理人和基金托管人应当继续履行本协议。</p> <p>(五) 在基金托管人没有过失、故意或欺诈行为的情况下，因履行本协议而被索赔、诉讼、处罚等而产</p>	<p>(一) 基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规、基金合同或本托管协议约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。<u>对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况，当事人免责：</u></p> <p><u>5、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由证券公司等其他机构负责清算交收的基金资产及其收益不承担任何责任；</u></p> <p><u>6、基金托管人对相关司法管辖区域内的证券登记、清算机构、第三方数据和信息来源机构、根据当地法律法规及市场惯例无法向该服务提供方追偿的其他机构所提供的数据和信息的准确性和完整性所引起的损失不负责任；</u></p> <p><u>7、在谨慎挑选境外托管人的情况下，基金托管人对境外托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因造成的损失不承担责任。</u>(新</p>

	<p>生的损失、费用等(统称“损失”),基金管理人应向基金托管人予以补偿并使基金托管人免受任何损害。</p> <p><u>(五)为明确责任,在不影响本协议本条其他规定的普遍适用性的前提下,基金管理人和基金托管人对由于如下行为造成的损失的责任承担问题,明确如下:</u></p>	<p>增)</p> <p><u>(二)当事人违约,给另一方当事人或基金财产造成损失的,应就直接损失进行赔偿;另一方当事人有权利及义务代表基金向违约方追偿。</u></p> <p><u>(六)为明确责任,在不影响本协议本条其他规定的普遍适用性的前提下,基金管理人和基金托管人对由于如下行为造成的损失的责任承担问题,明确如下:</u></p> <p><u>8、在资金交收日,基金资金账户资金首先用于除新股申购以外的其他资金交收义务,交收完成后资金余额方可用于新股申购。如果因此资金不足造成新股申购失败或者新股申购不足,基金托管人不承担任何责任。如基金份额持有人因此提出赔偿要求,相关法律责任和损失由基金管理人承担。</u></p> <p>(新增)</p> <p><u>(七)因管理人的疏忽、过失等原因导致资产管理计划的证券交易费用及境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用(out-of-pocket fees)发生延迟付款或无法付款等引起的损失,由管理人承担。(新增)</u></p>
<p>二十、托管协议的效力</p>	<p><u>(一)基金管理人在向中国证监会申请发售基金份额时提交的托管协议草案,应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权签字人签字,协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会核准的文本为正式文本。</u></p>	<p><u>(一)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,协议当事人双方可能不时根据中国证监会的意见修改托管协议。托管协议以中国证监会备案的文本为正式文本。</u></p>