

关于天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金变更为天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合 同的公告

天弘基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金于 2015 年 6 月 17 日获得中国证监会准予注册的批复（证监许可【2015】1278 号）。《天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2015 年 7 月 16 日正式生效。《基金合同》约定：“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），则基金管理人有权决定本基金是否采取 ETF 联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，如决定以 ETF 联接基金模式运作，则届时无须召开基金份额持有人大会……”同时，《基金合同》约定：“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：……（4）若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金（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；（5）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；（6）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；……”

本公司旗下天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金已于 2024 年 9 月 4 日正式成立。为更好的满足投资者的投资需求，本公司经与基金托管人广发证券股份有限公司协商一致，决定于 2024 年 9 月 9 日起，将天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金变更为天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A 类份额基金代码：001548，C 类份额基金代码：001549），引入侧袋机制，并根据法律法规更新、基金管理人及基金托管人信息更新以及本基金实际运作情况对《基金合同》作出修改。根据法律法规及《基金合同》的有关规定，已对《基金合同》、《天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金托管协议》、《天弘上证 50 指数

型发起式证券投资基金招募说明书》等法律文件进行相应的修订和补充。《基金合同》的修订内容详见附件《<天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金基金合同>修订前后对照表》。

届时，天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金 A 类基金份额”变更为“天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 A 类基金份额”，将“天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金 C 类基金份额”变更为“天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 类基金份额”。前述变更不影响各类基金份额净值的计算。

基金变更后，各类基金份额的申购费率及赎回费率保持不变。

重要提示

1、修订后的《天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》、《天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》等法律文件自 2024 年 9 月 9 日起生效。

2、变更后的天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 C 类基金份额继续参与销售服务费优惠活动，优惠后的销售服务费年费率为 0.20%。

3、投资者可登录本公司网站(www.thfund.com.cn)查阅修订后的法律文件，或拨打客户服务电话(95046)获取相关信息。

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。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。

特此公告。

天弘基金管理有限公司
二〇二四年九月六日

附件：《天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金基金合同》

修订前后对照表

所在部分	修订前	修订后
封面	天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金基金合同	天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同 (由天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金变更而来)
全文	天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金 指定媒介 指定网站 指定报刊 15 年以上 具有证券、期货相关业务资格的	天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 规定媒介 规定网站 规定报刊 不少于法定最低期限 符合《中华人民共和国证券法》规定的
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)、《证券投资基金管理暂行办法》、《证券投资基金销售管	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、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》”)、《公开募集证券投资基金基

	<p>理办法》(以下简称“《销售办法”》)、《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》(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、天弘上证50指类型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>	<p>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、天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金由天弘上证50指类型发起式证券投资基金变更而来，天弘上证50指类型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《天弘上证50指类型发起式证券投资基金基金合同》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>中国证监会对天弘上证50指</p>
--	--	--

	<p>型发起式证券投资基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性的判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p> <p>增加：</p> <p>四、本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股，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、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p> <p>删除。</p> <p>增加：</p> <p>七、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基</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、成份股停牌或退市等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p> <p>八、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</p>

	施之日起一年后开始执行。	基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回等业务。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。 删除。
第二部分 释义	1、基金或本基金：指天弘上证50指数型发起式证券投资基金	1、基金或本基金：指天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金，由天弘上证50指数型发起式证券投资基金变更而来
第二部分 释义	4、基金合同或本基金合同：指《天弘上证50指数型发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充	4、基金合同或本基金合同：指《天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
第二部分 释义	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天弘上证50指数型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
第二部分 释义	6、招募说明书：指《天弘上证50指数型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新	6、招募说明书：指《天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及

		其更新
第二部分 释义	7、基金份额发售公告：指《天弘上证50指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》	删除。
第二部分 释义	8、基金产品资料概要：指《天弘上证50指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新	7、基金产品资料概要：指《天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》及其更新
第二部分 释义	<p>10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《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</p>	<p>9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>10、《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管理机构监督管理办</p>

	<p>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《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</p>	<p>法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《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</p>
第二部分 释义	<p>17、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</p>	删除。
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>16、ETF联接基金、联接基金：指将绝大部分基金财产投资于目标ETF，与目标ETF的投资目标类似，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用契约型开放式运作方式的基金</p> <p>17、目标ETF：指另一只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“该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</p>

		目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金选择天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF
第二部分 释义	21、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及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	21、合格境外投资者：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》(包括其不时修订)及相关法律法规规定，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者
第二部分 释义	22、发起资金：指用于认购发起式基金且来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可包括基金经理之外公司投研人员）等人员的资金 23、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发	删除。

	<p>起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员工中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也可包括基金经理之外公司投研人员）等人员</p>	
第二部分 释义	<p>24、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及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人的合称</p>	<p>22、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外投资者以及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人的合称</p>
第二部分 释义	<p>26、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p>	<p>24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p>
第二部分 释义	<p>31、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户</p>	<p>29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p>
第二部分 释义	<p>32、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金</p>	<p>30、基金合同生效日：指天弘上证50指数量型发起式证券投资</p>

	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	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
第二部分 释义	34、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月	删除。
第二部分 释义	35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限	32、存续期：指《天弘上证50指数型发起式证券投资基金基金合同》生效至《天弘上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》终止之间的不定期期限
第二部分 释义	42、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为	删除。
第二部分 释义	48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%	44、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的10%
第二部分	51、A类基金份额：指在投资人	47、A类基金份额：指在投资人

释义	认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额	申购、赎回基金时收取申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
第二部分 释义	52、C类基金份额：指在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额	48、C类基金份额：指在投资人申购基金时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
第二部分 释义	55、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和	51、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、目标ETF份额、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
第二部分 释义		<p>增加：</p> <p>57、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> <p>58、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按</p>

		摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产
第二部分 释义	61、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	59、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网站（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

<p>第三部分</p> <p>基金的基本情况</p>	<p>一、基金名称 天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金</p> <p>二、基金的类别 股票型证券投资基金</p> <p>三、基金的运作方式 契约型开放式、发起式</p> <p>四、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的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。</p> <p>五、基金的最低募集金额 本基金为发起式基金，基金的最低募集金额为 1000 万元人民币。发起式基金是指，基金管理人在募集基金时，使用公司股东资金、公司固有资金、公司高级管理人员或者基金经理等人员资金认购基金的金额不少于一千万元人民币，且持有期限不少于三年。发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止。</p> <p>六、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人</p>	<p>一、基金名称 天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金</p> <p>二、基金的类别 ETF 联接基金</p> <p>三、基金的运作方式 契约型开放式</p> <p>四、基金的投资目标 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的最小化。</p> <p>五、基金存续期限 不定期</p> <p>基金合同生效后，连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，本基金合同应当终止，并按照本基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。</p>
--	---	---

	<p><u>人民币 1.00 元。</u></p> <p><u>本基金 A 类基金份额的认购费率按招募说明书的规定执行。C 类基金份额不收取认购费。</u></p> <p>七、基金存续期限</p> <p>不定期</p> <p><u>基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同应当自动终止。《基金合同》生效三年后继续存续的，连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千元情形的，本基金合同应当终止，并按照本基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。</u></p> <p>八、基金份额类别</p> <p>本基金根据所收取<u>认购/申购费用</u>、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中：</p> <p>1、在投资人认购/申购、赎回基金时收取<u>认购/申购费用</u>、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。</p> <p>2、在投资人申购时不收取申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。</p> <p>本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公布</p>	<p>六、基金份额类别</p> <p>本基金根据所收取申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中：</p> <p>1、在投资人申购、赎回基金时收取申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。</p> <p>2、在投资人申购时不收取申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。</p> <p>本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公布</p>
--	--	---

	<p>2、在投资人认购/申购时不收取认购/申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。</p> <p>本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。</p> <p>有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。基金管理人可在法律法规和基金合同规定的范围内在不损害基金份额持有人利益的情况下，在履行适当的程序后，增加新的基金份额类别或者停止现有基金份额类别的销售等，无需召开基金份额持有人大会。但调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。</p>	<p>基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>投资人可自行选择申购的基金份额类别。</p> <p>有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。基金管理人可在法律法规和基金合同规定的范围内、在不损害基金份额持有人利益的情况下，在履行适当的程序后，增加新的基金份额类别或者停止现有基金份额类别的销售等，无需召开基金份额持有人大会。</p>
--	---	--

第三部分 基金的基本情况	<p><u>九、未来条件许可情况下的基金模式转换</u></p> <p><u>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)，则基金管理人有权决定本基金是否采取 ETF 联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，如决定以 ETF 联接基金模式运作，则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。</u></p>	<p><u>七、本基金与目标 ETF 的联系与区别</u></p> <p>本基金为目标 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 2、在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标 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；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。 <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> <ol style="list-style-type: none"> 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
-----------------	---	--

		<p>现；而本基金作为普通的开放式基金，本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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</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，大额申赎可能对基金净值产生一定冲击。</p>
第四部分 基金的历史沿革与 存续	<p>第四部分 基金份额的发售</p> <p><u>二、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</u></p> <p><u>1、发售时间</u> <u>自基金份额发售之日起最长不得</u> <u>得超过 3 个月，具体发售时间见</u> <u>基金份额发售公告。</u></p> <p><u>2、发售方式</u> <u>通过各销售机构的基金销售网</u> <u>点或其指定的其他方式公开发</u> <u>售，各销售机构的具体名单见基</u> <u>金份额发售公告以及基金管理</u></p>	<p>第四部分 基金的历史沿革与 存续</p> <p><u>一、历史沿革</u> 天弘上证 50 交易型开放式指数 证券投资基金联接基金由天弘 上证 50 指数型发起式证券投资 基金变更而来。天弘上证 50 指 数型发起式证券投资基金经中 国证监会《关于准予天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金 注册的批复》（证监许可 [2015]1278 号）准予募集注册，</p>

	<p><u>人届时发布的调整销售机构的相关公告。</u></p> <p>3、发售对象</p> <p><u>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及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人。</u></p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p><u>本基金分为 A 类和 C 类基金份额。投资人在认购 A 类基金份额支付认购费用，认购 C 类基金份额不支付认购费用。</u></p> <p><u>本基金 A 类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。</u></p> <p>2、募集期利息的处理方式</p> <p><u>有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。</u></p> <p>3、基金认购份额的计算</p> <p><u>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</u></p>	<p>基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金于 2015 年 7 月 15 日公开募集，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，《天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 16 日生效。</p> <p>2024 年 9 月 4 日，基金管理人管理的天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金正式成立。基金管理人根据《天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定，决定将天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金变更为天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，即本基金。</p> <p>自 2024 年 9 月 9 日起，天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。</p> <p>二、基金的存续</p> <p>《基金合同》生效后，连续二十</p>
--	--	--

	<p><u>4、认购份额余额的处理方式</u> <u>认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</u></p> <p><u>5、认购申请的确认</u> <u>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。</u></p> <p><u>三、基金份额认购金额的限制</u></p> <p><u>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</u></p> <p><u>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。</u></p> <p><u>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。</u></p> <p><u>4、基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。认购</u></p>	<p>个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，本基金合同应当终止，并按照本基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>
--	---	---

	<p>申请一经受理不得撤销。</p>	
第五部分 基金备案	<p>第五部分 基金备案</p> <p>二、基金备案的条件</p> <p>本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于 1000 万元，发起资金的提供方承诺持有期限不少于三年的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人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。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金</p>	删除。

	<p>金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <ol style="list-style-type: none">1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于 2 亿元的，本基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照本基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。</p> <p>《基金合同》生效三年后继续存续的，连续二十个工作日出现基</p>	
--	--	--

	<p>金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，本基金合同应当终止，并按照本基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>	
第五部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者（发起资金提供方除外）持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形。法律法规或中国证监会另有规定的除外。</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8 项</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>删除。</p> <p>增加：</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时。</p> <p>8、目标 ETF 暂停申购、暂停上市或目标 ETF 停牌等基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。</p> <p>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、</p>

	<p>暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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>8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，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。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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>
第五部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 增加： 6、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时。 7、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或目标 ETF 停牌等基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形。</p>
第五部分 基金份额 的申购与 赎回	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 1、巨额赎回的认定 若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式 1、巨额赎回的认定 若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作</p>

	<p>日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2)部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提</p>	<p>日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(2)部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提</p>
--	--	--

	<p>交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>(3)当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过上一开放日基金总份额10%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，具体参照上述(2)方式处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。而对该单个基金份额持有人10%以内(含10%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述(1)、(2)方式处理，具体见相关公告。</p>	<p>交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>(3)当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过上一工作日基金总份额10%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，具体参照上述(2)方式处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。而对该单个基金份额持有人10%以内(含10%)的赎回申请与其他投资者的赎回申请按上述(1)、(2)方式处理，具体见相关公告。</p>
--	---	---

第五部分 基金份额 的申购与 赎回		<p>增加：</p> <p>十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</p> <p>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</p>
第六部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人</p> <p>名称：天弘基金管理有限公司</p> <p><u>注册地址：天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号</u></p> <p><u>办公地址：天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层</u></p> <p><u>邮政编码：300203</u></p> <p>法定代表人：<u>胡晓明</u></p> <p>成立日期：2004年11月8日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号： 中国证监会证监基金字[2004]164号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：人民币5.143亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p><u>经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、从事特定客户资产管理业务、中国证监会许可的其他</u></p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人</p> <p>名称：天弘基金管理有限公司</p> <p>住所：天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层</p> <p>法定代表人：韩歆毅</p> <p>成立日期：2004年11月8日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号： 中国证监会证监基金字[2004]164号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：人民币5.143亿元</p> <p>存续期间：持续经营</p> <p>联系电话：(022) 83310208</p>

	<p><u>业务。</u></p> <p>联系电话：(022) 83310208</p>	
<p>第六部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(1)依法募集资金，办理基金份额的<u>发售和登记</u>事宜；</p> <p>(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货<u>证券</u>经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>(16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金<u>认购、申购、赎回、转换和非交易过户</u>等的业务规则；</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>(1)依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的<u>发售、申购、赎回和登记</u>事宜；</p> <p>(8)采取适当合理的措施使计算基金份额<u>认购、申购、赎回和注销</u>价格的方法符合《基金合</p>	<p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(1)依法募集资金，办理基金份额的登记事宜；</p> <p>(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>(16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则；</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>(1)依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；</p> <p>(8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价</p>

	<p>同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；</p>	<p>格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>删除。</p>
<p>第六部分 基金合同 当事人及 权利义务</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简介</p> <p>名称：广发证券股份有限公司 注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼 法定代表人：<u>孙树明</u> 成立时间：1994 年 01 月 21 日 批准设立机关和批准设立文号： 中国人民银行广东省分行粤银管字【1991】第 133 号 组织形式：股份有限公司 注 册 资 本：人 民 币 7,621,087,664.00 元</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简介</p> <p>名称：广发证券股份有限公司 注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼 法定代表人：<u>林传辉</u> 成立时间：1994 年 01 月 21 日 批准设立机关和批准设立文号： 中国人民银行广东省分行粤银管字【1991】第 133 号 组织形式：股份有限公司 注 册 资 本：人 民 币 7,621,087,664.00 元</p>

	<p>存续期间：长期</p> <p>基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510号</p>	<p>存续期间：长期</p> <p>基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510号</p>
第六部分 基金合同 当事人及 权利义务	<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>(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；</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>(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会，并通知基金管理人；</p>
第六部分 基金合同 当事人及 权利义务	<p>三、基金份额持有人</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>(4) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>(4) 交纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p>
第七部分 基金份额 持有人大 会		<p>增加：</p> <p>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直接参加或者委派代表参加目标 ETF 的基金份额持有人</p>

大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，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。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标 ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭借持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标 ETF 基金份额持有人大会并表决。

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参加目标 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《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。
第七部分 基金份额 持有人大 会	<p>一、 召开事由</p> <p>1、 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>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：</p> <p>(4) 若将来本基金管理人推出投资同一标的指数的交易型开放式指数证券投资基金(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；</p> <p>(7) 基金管理人、登记机构、基</p>	<p>一、 召开事由</p> <p>1、 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>增加：</p> <p>(11)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 份额持有人大会；</p> <p>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：</p> <p>删除。</p> <p>(6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定</p>

	<p>金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内，且在对现有基金份额持有人无实质性不利影响的前提下调整有关<u>认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；</u></p>	<p>或中国证监会许可的范围内，且在对现有基金份额持有人无实质性不利影响的前提下调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；</p>
第七部分 基金份额 持有人大 会		<p>增加：</p> <p>九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>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：</p> <p>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%）；</p> <p>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</p>

	<p>额的二分之一(含二分之一);</p> <p>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少于在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);</p> <p>4、在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;</p> <p>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;</p> <p>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</p>
--	--

		<p>表决权的二分之一以上(含二分之一)通过;</p> <p>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。</p> <p>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,同一主侧袋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。</p> <p>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约定。</p>
第十一部分 基金的投资	一、 投资目标 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化, <u>实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。</u>	一、 投资目标 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的最小化。
第十一部分 基金的投资	二、 投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以上证 50 指数的成份股及其备选成份股为	二、 投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以目标 ETF 基金份额、上证 50 指数的成份

	<p>主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，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、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于上证 50 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>	<p>股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，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、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>基金的投资组合比例为：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%；本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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
第十一部分 基金的投资	<p>三、 投资策略</p> <p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。</p>	<p>三、 投资策略</p> <p>本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制</p>

	<p>股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。</p> <p>由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况下导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金管理人主要按照上证 50 指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资</p>	<p>法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。</p> <p>本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，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%。</p> <p>1、目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF 的份额。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标 ETF。因此对标的指数成份股、备选成份股的投资，主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法</p>
--	---	---

	<p>产比例不低于基金资产的 90%，投资于上证 50 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合构建</p> <p>本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于上证 50 指数成份股和备选成份股的资产比例</p>	<p>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。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
--	--	--

	<p>不低于非现金基金资产的 80% 的投资比例限制。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据上证 50 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>A 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合；</p> <p>B 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>C 根据法律法规和基金合同的规</p>
--	--

	<p>定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变更和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 1%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>	
第十一部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于上证 50 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>除上述(2)、(10)、(18)、(19)、(21)情形之外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 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%；</p> <p>除上述(1)、(2)、(10)、(18)、(19)、(21)情形之外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限</p>

	<p>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。因证券市场波动、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不符合第（21）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自<u>基金合同生效</u>之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p>	<p>制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、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不符合第（21）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。因证券市场波动、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、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第（1）项投资比例的，基金管理人应当在 20 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。</p> <p>基金管理人应当自<u>转换为联接基金</u>之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符</p>
--	---	---

	<p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>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以及法律法规、监管机构另有规定的除外）、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。但若标的指数及业绩比较基准变更对基金投资无实质性不利影响（包括但不限于编制机构名称变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，</p>	<p>合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是投资目标 ETF、中国证监会另有规定的除外；</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>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以及法律法规、监管机构另有规定的除外）、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，但下文“目标 ETF发生</p>
--	---	--

	<p>基金管理人可在履行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。</p> <p>六、风险收益特征 本基金为股票型基金，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。</p>	<p>相关变更情形时的处理”另有约定的除外。</p> <p>但若标的指数及业绩比较基准变更对基金投资无实质性不利影响(包括但不限于编制机构名称变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在履行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准并及时公告。</p> <p>六、风险收益特征 本基金为 ETF 联接基金，且目标 ETF 为股票型指数基金，因此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 实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>增加：</p> <p>七、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该标的指数的指数基金；若届时本基金管理人</p>
--	---	---

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，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金《基金合同》中将去掉关于目标 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。

- (1) 目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；
- (2) 目标 ETF 终止上市；
- (3) 目标 ETF 基金合同终止；
- (4) 目标 ETF 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)。

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

	<p>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>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
第十二部分 基金	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买的各类</p>

的财产	证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。	证券及票据价值、目标 ETF 基金份额、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。
第十三部分 基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	二、估值对象 基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、存托凭证、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。
第十三部分 基金资产估值	三、估值方法	三、估值方法 增加： 10、本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日的净值估值，如该日目标 ETF 未公布净值，则按目标 ETF 最近公布的净值估值。
第十三部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形 3、当某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估值；	六、暂停估值的情形 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确认后，基金管理人应当暂停估值； 增加： 4、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；

第十三部分 基金资产估值		<p>增加：</p> <p>九、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>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本净值信息，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。</p>
第十四部分 基金费用与税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>4、标的指数许可使用基点费；</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>删除。</p>
第十四部分 基金费用与税收	<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 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> <p>$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管</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。本基金的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(若为负数，则取 0)的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> <p>$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日的基金资产净值扣</p> <p>除前一日所持有目标 ETF 基金</p>

	<p>理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。</p> <p>托管费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ <p>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 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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。</p> <p>4、指数许可使用基点费 本基金指数许可使用费分为许</p>	<p>份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的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(若为负数，则取 0)的 0.1%的年费率计提。</p> <p>托管费的计算方法如下：</p> $H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ <p>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非前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则取 0</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金</p>
--	--	--

	<p>可使用固定费和许可使用基点费，其中许可使用基点费由基金财产承担。</p> <p>本基金指数许可使用基点费按前一目的基金资产净值的万分之二（2个基点）的年费率计提。</p> <p>计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一目的基金资产净值。</p> <p>指数许可使用基点费每日计算，逐日累计，按季支付。自基金合同生效日起，基金管理人、基金托管人和指数供应商核对一致后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前 10 个工作日内，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用基点费划款指令，按照确认的金额和指定的账户路径将上一季度的指数许可使用基点费从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 8000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数</p>	<p>管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p> <p>删除。</p>
--	---	---

	<p><u>按比例计算。</u></p> <p><u>基金管理人可根据指数使用许可协议和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数许可使用基点费费率和计费方式，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在指定媒介上刊登公告。</u></p>	
第十四部分 基金费用与税收	<p>上述“一、基金费用的种类中第 5—11 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规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人的指令从基金财产中支付。</p>	<p>上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 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规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人的指令从基金财产中支付。</p>
第十四部分 基金费用与税收	<p>三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、《基金合同》生效前的相关费用；</p>	<p>三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行；</p>
第十四部分 基金费用与税		<p>增加：</p> <p>五、实施侧袋机制期间的基金费用</p>

收		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，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。
第十五部分 基金的收益与分配		增加： 七、实施侧袋机制期间的收益分配 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。
第十六部分 基金的会计与审计	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日； 基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；	一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
第十七部分 基金的信息披露	二、信息披露义务人 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	二、信息披露义务人 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”）等规

	<p>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。</p>	<p>定媒介披露，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。</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 《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；基金招募说明书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。 基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、</p>	<p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、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。《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规定网站上；基金招募说明书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。 删除。</p>

	<p>《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各自网站上。</p>	
第十七部分 基金的信息披露	<p>(二)基金份额发售公告 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。</p> <p>(三)《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。 基金合同生效公告中应说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。</p>	删除。
第十七部分 基金的信息披露	<p>(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 基金管理人应在年度报告、中期报告、季度报告中分别披露基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有基金的份额、期限</p>	删除。

	<u>及期间的变动情况。</u>	
第十七部分 基金的信息披露	<p>(七)临时报告</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集；</p>	<p>(五)临时报告</p> <p>删除。</p> <p>增加：</p> <p>22、本基金变更目标 ETF；</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>(八)澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体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。</p>	<p>(六)澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体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。</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>(十)投资于股指期货的信息</p> <p>基金管理人在季度报告、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<u>投资</u>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<u>投资</u>政策和<u>投资</u>目标。</p>	<p>(八)投资于股指期货的信息披露</p> <p>基金管理人在季度报告、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<u>交易</u>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<u>交易</u>政策和<u>交易</u>目标。</p>

第十七部分 基金的信息披露		<p>增加：</p> <p>(十一)投资基金份额的信息披露</p> <p>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)等文件中披露所持基金的以下相关情况，包括：(1) 投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；(2) 交易及持有基金产生的费用，招募说明书中应当列明计算方法并举例说明；(3) 本基金持有的基金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。</p> <p>(十二)实施侧袋机制期间的信息披露</p> <p>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。</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人应</p>	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金</p>

	<p>当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。</p>	<p>托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。</p>
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金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协商一致后变更并公告，并报中国证监会备案。</p>	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金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协商一致后变更并公告。</p>
第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>3、<u>基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的；或《基金合同》生效三年后继续存续的</u>，连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的；</p> <p>4、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以及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：</p> <p>3、连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的；</p> <p>4、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以及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理</p>

	<p>数不符合要求以及法律法规、监管机构另有规定的除外)、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；</p>	<p>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，但基金合同另有约定的除外；</p>
第二十一部分 基金合同的效力	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章并 在募集结束后经基金管理人向 中国证监会办理基金备案手续， 并经中国证监会书面确认后生 效。</p> <p>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。</p>	<p>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章，修 改后的内容自 2024 年 9 月 9 日 生效。</p> <p>4、《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一式一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律 效力。</p>