

# 景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金变更为景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改法律文件的公告

景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2024】747号文准予募集注册，《景顺长城上证科创板50成份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2024年6月6日生效。基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》约定：“若基金管理人注册并成立追踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在该ETF上市后，在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该ETF的联接基金且无需召开基金份额持有人大会。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议”。

本公司旗下的景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金已于2025年1月15日成立，并于2025年1月24日正式在上海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，并报监管机构备案，决定将景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金变更为景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，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

景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金变更为景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金后，本基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金A类基金份额”变更为“景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金A类基金份额”、“景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金C类基金份额”变更为“景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金C类基金份额”。

本基金的基金简称变更情况如下，各类基金份额对应的基金代码保持不变。

基金代码	基金简称（转型前）	基金简称（转型后）
021484	景顺长城上证科创板50成份指数	景顺长城上证科创板50成份ETF联接
021484	景顺长城上证科创板50成份指数A	景顺长城上证科创板50成份ETF联接A
021485	景顺长城上证科创板50成份指数C	景顺长城上证科创板50成份ETF联接C

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《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式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。上述修改事项已向监管机构履行备案手续，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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

修订后的《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》和《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》自2025年2月14日起生效，原《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》、《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金托管协议》和《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式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，请登录基金管理人网站（[www.igwfm.com](http://www.igwfm.com)）查询或拨打本公司客户服务电话400-8888-606（免长话费）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。

景顺长城基金管理有限公司

2025年2月13日

附件 1: 《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》修

订对照表

修改章节	修改前	修改后
第一部分 前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》(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销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》(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》”)、<b>《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》</b>、《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>
第一部分 前言	<p>三、景顺长城上证科创板50成份指数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。</p> <p>中国证监会对<b>本基金</b>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>三、<b>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b>由景顺长城<b>上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</b>转型而来。景顺长城上证科创板50成份指数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。</p> <p>中国证监会对<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</b>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>第一部分 前言</p>	<p>(删除)</p> <p>六、本基金单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外）持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	
<p>第一部分 前言</p>	<p>八、本基金为股票型指数基金，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、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p>	<p>七、本基金为股票型指数基金，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、成份股停牌或违约等潜在风险，具体风险详见招募说明书。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1、基金或本基金：指景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</p>	<p>1、基金或本基金：指景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</p>
<p>第二部分 释义</p>		<p>(新增)</p> <p>2、目标ETF：指另一获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“ETF”），该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同，并且，该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金以景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF</p> <p>3、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，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，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>4、基金合同或本基金合同：指《景顺长城上证科创板50成份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</p>	<p>6、基金合同或本基金合同：指《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p>

	<p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《景顺长城上证科创板50成份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</p> <p>6、招募说明书：指《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新</p>	<p>7、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>8、招募说明书：指《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新</p> <p>9、基金产品资料概要：指《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要》及其更新</p>
第二部分释义	18、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银保监会	20、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局
第二部分释义	31、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期	33、基金合同生效日：指景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资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、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限	36、存续期：指《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》生效至《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》终止之间的不定期期限
第二部分释义	50、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	52、基金资产总值：指基金拥有的目标ETF份额、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
第三部分基金的基本情况	<p>一、基金名称</p> <p>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</p> <p>二、基金的类别</p> <p>股票型证券投资基金、指数基金</p>	<p>一、基金名称</p> <p>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</p> <p>二、基金的类别</p> <p>股票型证券投资基金、ETF联接基金</p>
第三部分基金的基	四、基金的投资目标	四、基金的投资目标
	紧密跟踪标的指数，追求跟踪	本基金主要通过投资于目标

<p>本情况</p>	<p>偏离度及跟踪误差的最小化。</p> <p>五、基金的标的指数 上证科创板50成份指数</p>	<p>ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。</p> <p>五、基金的标的指数 本基金的标的指数为目标ETF的标的指数，即上证科创板50成份指数</p> <p>六、目标ETF 本基金目标ETF为景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金。</p>
<p>第三部分 基金的基本 本情况</p>	<p>十、若基金管理人注册并成立追踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在该ETF上市后，在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该ETF的联接基金且无需召开基金份额持有人大会。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。</p>	<p>十二、本基金与目标ETF的联系与区别 本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：</p> <p>（1）在投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股及其备选成份股；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，实现对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>（2）在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，申购或赎回目标ETF，申购赎回均以份额申报；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”原则进行申购与赎回，以金额申购、份额赎回。</p> <p>（3）基金是否挂牌交易不同：目标ETF在上海证券交易所挂牌交易；而本基金则不上市交易。本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：</p> <p>（1）法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，本基金保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在</p>

		<p>一年以内的政府债券。</p> <p>(2) 申购赎回的影响。目标ETF采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申购与赎回的方式，申购、赎回对基金净值影响相对较小；而本基金采取按照未知价法进行申购、赎回的方式，大额申购、赎回可能会对基金净值产生一定冲击。</p>
<p>第四部分 基金份额 的发售</p>	<p>第四部分 基金份额的发售</p> <p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间</p> <p>自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、发售方式</p> <p>通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金管理人披露的基金销售机构名录。</p> <p>3、发售对象</p> <p>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、合格境外投资者、发起资金提供方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。</p> <p>二、发起资金认购</p> <p>本基金发起资金认购本基金的金额不少于1000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年，法律法规或中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本基金发起资金的认购情况详见基金管理人届时发布的公告。</p> <p>三、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。C类基金份额不收取认购费用。基金认购费用主要用于</p>	<p>第四部分 基金份额的历史沿革</p> <p>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金转型而来。景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金经中国证监会证监许可【2024】747号文准予募集注册，基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金于2024年6月4日完成募集，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，《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》于2024年6月6日生效。</p> <p>根据《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定：“若基金管理人注册并成立追踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在该ETF上市后，在不改变本基金投资目标的前提下，本基金可变更为该ETF的联接基金且无需召开基金份额持有人大会。该联接基金将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。该联接基金具体投资范围及比例等将依据届时有效的法律法规或监管机构要求确定。</p>

	<p>本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金财产。</p> <p>2、募集期利息的处理方式 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，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2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。</p> <p>5、认购申请的确认 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。认购申请的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。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。</p> <p>四、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>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或相关公告。</p> <p>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或相关公告。</p> <p>4、投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购费用按每笔认购申请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。</p> <p>5、如本基金单个投资人（基金管理人、基金管理人高级管理</p>	<p>以上变更需经基金管理人和基金托管人协商一致后修改基金合同，但不需召开基金份额持有人大会审议。”基金管理人经与基金托管人协商一致并向监管机构备案后，决定将景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金转型为景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并据此修订《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》。</p> <p>自2025年2月14日起，景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金正式转型为景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效，原《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》同日失效。</p>
--	---	---

	<p>人员或基金经理作为发起资金提供方除外) 累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。</p>	
<p>第五部分 基金备案</p>	<p>第五部分 基金备案</p> <p>一、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，在发起资金认购本基金的金额不少于1000万元且发起资金提供方承诺其认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年的条件下，基金募集期届满或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，会计师事务所提交的验资报告需对发起资金提供方及其持有基金份额进行专门说明。基金管理人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的处理方式</p>	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于2亿元，本基金合同自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。如届时有有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充的，则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》生效三年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</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"> <li>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</li> <li>2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；</li> <li>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。</li> </ol> <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>基金合同生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于2亿元，本基金合同自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。如届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充的，则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>基金合同生效三年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、<b>开放日及开放时间</b></p> <p>投资人在开放日办理基金份额</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交</p>

	<p>的申购和赎回，具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，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在招募说明书或相关公告中载明。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p><b>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</b></p> <p>基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。</p>	<p>易所的正常交易日的交易时间，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在招募说明书或相关公告中载明。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。</p>
第六部分 基金份额 的申购与	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>投资人申购基金份额时，必须全</p>

<p>赎回</p>	<p>全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p>	<p>额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、<b>目标ETF的投资市场休市、暂停交易或延迟交收、目标ETF暂停交易或赎回、目标ETF延迟支付赎回对价、交易清算规则发生较大变化</b>或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制<b>或新增基金规模控制措施</b>。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>(删除)</p> <p><b>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(基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为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；</b></p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>……</p> <p>(新增)</p> <p><b>10、本基金的目标ETF暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</b></p> <p><b>11、本基金的目标ETF暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌。</b></p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、7、9、10、11、12项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受</p>

	<p>8、10、11项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应在规定期限内在规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>投资人申购申请时，基金管理人应在规定期限内在规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>
第六部分 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 ..... (新增) 7、本基金的目标ETF暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 8、本基金的目标ETF暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌。</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务		<p>一、基金管理人 (二) 基金管理人的权利与义务 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： ..... (新增) (17) 代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标ETF所产生的权利，基金合同另有约定的除外；</p>
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于： (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p>	<p>三、基金份额持有人 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于： (5) 出席或者委派代表出席本基金或目标ETF的基金份额持有人大会，对本基金或目标ETF基金份额持有人大会审议事项行使表决权。本基金参会份额和票数按权益登记日本基金所持有的目标ETF份额占本基金资产的比例折算；</p>
第八部分 基金份额	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有</p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的</p>

<p>持有人大会</p>	<p>人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的同一类别的每一基金份额拥有平等的投票权。 本基金份额持有人大会不设日常机构。</p>	<p>合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的同一类别的每一基金份额拥有平等的投票权。 本基金份额持有人大会不设日常机构。</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。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。</p> <p>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。</p> <p>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本</p>
--------------	--	--

		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。
第八部分 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，法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外： .....</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： .....</p> <p>(删除)</p> <p>(8) 若基金管理人注册并成立追踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），在该ETF上市后，在不改变本基金投资目标的前提下，经基金管理人与基金托管协商一致，本基金依据基金合同约定变更为ETF联接基金；</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，法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外： .....</p> <p>(新增)</p> <p>(13) 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； .....</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p>
第十二部 分基金的 投资	<p>一、投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。</p>
第十二部 分基金的 投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金以景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金（目标ETF）基金份额、标</p>

地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: **本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%**。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

的指数成份股及备选成份股(含存托凭证,下同) **为主要投资对象**,此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: **本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%**。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人将在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

第十二部  
分基金的  
投资

三、投资策略

本基金采用完全复制被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或者因法律法规限制时，或其他原因导致无法有效负责和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合管理进行适当性变更和调整，力争降低跟踪误差。在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的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%。

(一) 资产配置策略

本基金管理人主要按照标的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。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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。

(二) 股票（含存托凭证）投资策略

(1) 股票投资组合构建

本基金原则上将采用完全复制

三、投资策略

本基金为景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或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，基金管理人将尽快对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的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%。

1、资产配置策略

本基金主要通过投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股来进行被动式指数化投资，达到跟踪标的指数的目标。因此，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

2、目标ETF投资策略

本基金投资目标ETF的两种方式如下：

(1) 申购和赎回：以申购/赎回对价进行申购赎回目标ETF或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购赎回目标ETF。

(2) 二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成

	<p>法构建股票投资组合，以拟合、跟踪标的指数的收益表现。</p> <p>(2) 股票投资组合调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合原则上根据标的指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行实时调整。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使得本基金的股票投资组合比例符合《基金合同》的约定。</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。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，对股票投资组合进行相应调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>①当上市公司发生增发、配股等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>②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>③根据法律、法规的规定，成份股在标的指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。</p> <p>(3) 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时</p>	<p>本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标ETF。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，在履行适当程序后，本基金也将作相应的变更或调整。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。</p> <p>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，但并不保证能因此避免该成份证券对本基金基金财产的影响。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的。</p> <p>5、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>6、可转换债券和可交换公司债投资策略</p>
--	--	--

对相关成份股进行调整。

(4) 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### (三) 债券投资策略

出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。

### (四) 可转换债券和可交换公司债投资策略

(1) 相对价值分析：基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券、可交换公司债股性和债性的相对价值。通过对可转换债券、可交换公司债转股溢价率和Delta系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。

(2) 基本面研究：基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库

(SRD)对可转换债券、可交换公司债标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。

(3) 估值分析：在基本面分析的基础上，运用PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG等相对估值指标以及DCF、DDM等绝对估值方法对标的公司的股

(1) 相对价值分析：基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券、可交换公司债股性和债性的相对价值。通过对可转换债券、可交换公司债转股溢价率和Delta系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。

(2) 基本面研究：基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库(SRD)对可转换债券、可交换公司债标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。

(3) 估值分析：在基本面分析的基础上，运用PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG等相对估值指标以及DCF、DDM等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估，并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券、可交换公司债当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。

### 7、股指期货投资策略

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

(1) 时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

(2) 套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

(3) 合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持

票价值进行评估，并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券、可交换公司债当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。

#### **(五) 股指期货投资策略**

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

(1) 时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

(2) 套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

(3) 合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约作为交易标的。

#### **(六) 国债期货投资策略**

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

#### **(七) 股票期权投资策略**

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股

仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约作为交易标的。

#### **8、国债期货投资策略**

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

#### **9、股票期权投资策略**

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他股票期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

#### **10、资产支持证券投资策略**

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他股票期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

#### **(八) 资产支持证券投资策略**

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### **(九) 参与融资及转融通证券出借业务的投资策略**

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。

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

为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动

#### **11、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略**

本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。

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

为更好实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

	<p>性等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>	
<p>第十二部分 基金的投资</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) 本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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>.....</p> <p>因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前述第(17)所规定比例限制的，基金管理人不得新增转融通证券出借业务；</p> <p>(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述(2)、(7)、(9)、(10)、(17)情形之外，因证</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的比例不低于基金资产净值的90%；</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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>.....</p> <p>(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第(1)项规定投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，对于除第(1)、(2)、(7)、(9)、(10)、(17)项以外的其他情</p>

	<p>券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，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>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，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；</p>	<p>形，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、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第(17)项规定的，基金管理人不得新增转融通证券出借业务。法律法规另有规定时，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自转换为联接基金之日起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>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) 买卖除目标ETF基金份额外其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；</p>
第十二部分 基金的投资	<p>五、业绩比较基准和标的指数</p> <p>1、本基金的业绩比较基准：  <math>\text{上证科创板50成份指数收益率} \times 95\% + \text{商业银行活期存款利率(税后)} \times 5\%</math></p> <p>2、标的指数</p> <p>上证科创板50成份指数由上海证券交易科创板中市值大、流动性好的50只证券组成，反映最具市场代表性的一批科创企业的整体表现。</p> <p>采用该业绩比较基准主要基于如下考虑：本基金为完全复制策略的股票指数基金，标的指数上证科创板50成份指数。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现</p>	<p>五、业绩比较基准和标的指数</p> <p>本基金的业绩比较基准：  <math>\text{上证科创板50成份指数收益率} \times 95\% + \text{商业银行活期存款利率(税后)} \times 5\%</math></p> <p>本基金是ETF联接基金，追求对标的指数的有效跟踪，因此采用以标的指数为主要构成部分的业绩比较基准较为合理。</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，如转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合</p>

	<p>金基金资产的80%。该业绩比较基准能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。</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。</p> <p>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</p> <p>法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>	<p>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发生相关变更情形的处理方式”另有约定的除外。</p> <p>自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。</p> <p>法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>
第十二部分 基金的投资	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金是一只股票指数基金，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。同时，本基金为指数型基金，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型指数基金，因此本基金为股票型指数基金，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，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>
第十二部分 基金的投资		<p>(新增)</p> <p>七、目标ETF发生相关变更情形的处理方式</p> <p>目标ETF出现下述情形之一的，本基金可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，不需召开基金份额持有人大</p>

		<p>会。相应地，基金合同中删除关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <p>1、目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现。</p> <p>2、目标ETF终止上市。</p> <p>3、目标ETF基金合同终止。</p> <p>4、目标ETF与其他基金进行合并。</p> <p>5、目标ETF的基金管理人发生变更，(但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外)。</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p>
第十三部分 基金的财产	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指<b>购买的各类证券</b>及票据价值、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和。</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指<b>基金拥有的目标ETF份额、各类有价证券</b>及票据价值、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、资产支持证券、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的<b>目标ETF基金份额</b>、股票、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、资产支持证券、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>
第十四部分 基金资产估值		<p>四、估值方法</p> <p>(新增)</p> <p>1、目标ETF的估值</p> <p>本基金持有的目标ETF基金份额按估值日目标ETF的基金份额净值估值。如该日目标ETF未公布净值，则按该日目标ETF最近公布的净值估值。</p> <p>.....</p>
第十四部分 基金资产估值		<p>七、暂停估值的情形</p> <p>.....</p> <p>(新增)</p> <p>4、基金所投资的目标ETF暂停估值或暂停公告基金份额净值时；</p>

第十四部分 基金资产估值	<p>十、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>十、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>
第十五部分 基金费用与税收		<p>一、基金费用的种类</p> <p>.....</p> <p>(新增)</p> <p>7、基金投资目标ETF的相关费用(包括但不限于目标ETF的交易费用、申购赎回费用等);</p> <p>.....</p> <p>11、基金财产投资运营过程中的增值税;</p>
第十五部分 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0.15%的年费率计提。管理费的计算方法如下：  <math>H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}</math>  H为每日应计提的基金管理费  E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</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0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：  <math>H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}</math>  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</p> <p>基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支</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基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：  <math>H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}</math>  H为每日应计提的基金管理费  E为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</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基金资产中目标ETF份额</p>

取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

3、C类基金份额的销售服务费  
 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：  
 $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$   
 H为C类基金份额每日应计提的销售服务费  
 E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：  
 $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$   
 H为每日应计提的基金托管费  
 E为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

3、C类基金份额的销售服务费  
 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：  
 $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$   
 H为C类基金份额每日应计提的销售服务费  
 E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不

		<p>符，应及时联系基金托管人协商解决。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4—12项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>
<p>第十八部分基金的信息披露</p>		<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(七) 临时报告</p> <p>.....</p> <p>(新增)</p> <p>22、变更目标ETF;</p> <p>.....</p> <p>(新增)</p> <p>(十六) 基金投资证券投资基金(目标ETF)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)等文件中披露投资于其他基金(目标ETF)的相关情况,包括(1)投资策略、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,包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等,招募说明书中应当列明计算方法并举例说明;(3)本基金持有的ETF(目标ETF)发生的重大影响事件,如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等。</p>
<p>第十八部分基金的信息披露</p>	<p>八、暂停或延迟披露基金信息的情形</p> <p>当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>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</p>	<p>八、暂停或延迟披露基金信息的情形</p> <p>当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;</p> <p>3、基金所投资的目标ETF暂停估值或暂停公告基金份额净值时;</p>

	<p>金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。</p>	<p>4、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；</p> <p>5、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。</p> <p>(新增)</p> <p>九、法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。</p>
第十九部分 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>.....</p> <p>3、<b>基金合同</b>生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于2亿元的。法律法规或中国证监会另有规定时从其规定；</p> <p>4、<b>基金合同</b>生效三年后继续存续的，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的；</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>.....</p> <p>3、<b>《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》</b>生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于2亿元的。法律法规或中国证监会另有规定时从其规定；</p> <p>4、<b>《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同》</b>生效三年后继续存续的，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的；</p>
第二十四部分 基金合同内容摘要		根据正文修订更新

附件 2：《景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金托管协议》修订对照表

修改章节	修改前	修改后
	<p>鉴于景顺长城基金管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；</p> <p>鉴于兴业银行股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并</p>	<p>鉴于景顺长城基金管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任基金管理人的资格和能力；</p> <p>鉴于兴业银行股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规</p>

	<p>有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任基金托管人的资格和能力；</p> <p>鉴于景顺长城基金管理有限公司拟担任<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</b>的基金管理人，兴业银行股份有限公司拟担任<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</b>的基金托管人；</p> <p>为明确<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</b>基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。</p> <p>除非另有约定，《<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金基金合同</b>》（以下简称“基金合同”）中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义；若有抵触应以基金合同为准，并依其条款解释。</p> <p>若本基金实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见基金合同和招募说明书的规定。</p>	<p>的规定具备担任基金托管人的资格和能力；</p> <p>鉴于景顺长城基金管理有限公司拟担任<b>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b>的基金管理人，兴业银行股份有限公司拟担任<b>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b>的基金托管人；</p> <p>为明确<b>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b>基金管理人和基金托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。</p> <p>除非另有约定，《<b>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同</b>》（以下简称“基金合同”）中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义；若有抵触应以基金合同为准，并依其条款解释。</p> <p>若本基金实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见基金合同和招募说明书的规定。</p>
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</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》（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信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及其他有关法律法规与《<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起</b></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》（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信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《<b>公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引</b>》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及其他有关法律法规与《<b>景</b></p>

	<p>式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)订立。</p> <p>(二) 订立托管协议的目的 订立本协议的目的是明确<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</b>基金托管人和<b>景顺长城上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金</b>基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责, 确保基金财产的安全, 保护基金份额持有人的合法权益。</p>	<p><b>顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b>基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)订立。</p> <p>(二) 订立托管协议的目的 订立本协议的目的是明确<b>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b>基金托管人和<b>景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</b>基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责, 确保基金财产的安全, 保护基金份额持有人的合法权益。</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的, 基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池, 以便基金托管人运用相关技术系统, 对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督, 对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金<b>投资范围主要为</b>标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证, 下同), 此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于部分非成份股(包含科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构</p>	<p>(一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的, 基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池, 以便基金托管人运用相关技术系统, 对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督, 对存在疑义的事项进行核查。</p> <p>本基金<b>以景顺长城上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金(目标ETF)基金份额、标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证, 下同)为主要投资对象</b>, 此外, 为更好地实现投资目标, 本基金可少量投资于部分非成份股(包含科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开</p>

债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: **本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%**。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

基金管理人应将拟投资的上证科创板50成份指数成份股及备选成份股股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给基金托管人。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,并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: **本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%**。每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

基金管理人应将拟投资的上证科创板50成份指数成份股及备选成份股股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给基金托管人。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,并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资、融资比例进行监督。

基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

(1) 本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;

.....  
因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前述第(17)所规定比例限制的,基金管理人不得新增转融通证券出借业务;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述(2)、(7)、(9)、

(10)、(17)情形之外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,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。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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资、融资比例进行监督。

基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

(1) 本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%;

.....  
(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第(1)项规定投资比例的,基金管理人应当在20个交易日内进行调整,对于除第(1)、(2)、(7)、(9)、

(10)、(17)项以外的其他情形,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、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第

(17)项规定的,基金管理人不得新增转融通证券出借业务。法律法规另有规定时,从其规定。基金管理人应当自转换为联接基金之日起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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

	关限制或按照调整后的规定执行。	
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>.....</p> <p>4、在投资流通受限证券之前, 基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息, 具体应当包括但不限于如下文件(如有):</p> <p>拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。</p>	<p>(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资流通受限证券进行监督。</p> <p>.....</p> <p>4、在投资流通受限证券之前, 基金管理人应提前向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息, 具体应当包括但不限于如下文件(如有):</p> <p>拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。</p>
八、基金资产净值计算和会计核算	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>1、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、资产支持证券、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>2、估值方法</p> <p>3、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法第(9)项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>(二) 基金资产估值方法和特殊情形的处理</p> <p>1、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标ETF基金份额、股票、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、资产支持证券、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>2、估值方法</p> <p>(新增)</p> <p>(1) 目标ETF的估值</p> <p>本基金持有的目标ETF基金份额按估值日目标ETF的基金份额净值估值。如该日目标ETF未公布净值, 则按该日目标ETF最近公布的净值估值。</p> <p>3、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法第(10)项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处</p>

		理。
八、基金资产净值计算和会计核算		<p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>.....</p> <p>(新增)</p> <p><b>4、基金所投资的目标ETF 暂停估值或暂停公告基金份额净值时；</b></p>
十、基金信息披露	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告、《基金合同》生效公告、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、投资股指期货的信息披露、投资国债期货的信息披露、投资资产支持证券的信息披露、投资非公开发行股票的相关公告、投资股票期权的信息披露、参与融资和转融通证券出借业务的相关公告、清算报告、实施侧袋机制期间的信息披露以及中国证监会规定的其他信息。基金年度报告中的财务会计报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p>	<p>(二) 信息披露的内容</p> <p>基金的信息披露内容主要包括基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告、《基金合同》生效公告、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、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）、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、投资股指期货的信息披露、投资国债期货的信息披露、投资资产支持证券的信息披露、投资非公开发行股票的相关公告、投资股票期权的信息披露、参与融资和转融通证券出借业务的相关公告、<b>基金投资证券投资基金（目标ETF）的信息披露</b>、清算报告、实施侧袋机制期间的信息披露以及中国证监会规定的其他信息。基金年度报告中的财务会计报告需经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。</p>
十一、基金费用		<p>(一) 基金费用的种类</p> <p>.....</p> <p>(新增)</p> <p><b>7、基金投资目标ETF的相关费用（包括但不限于目标ETF的交易费用、申购赎回费用等）。</b></p> <p>.....</p> <p><b>11、基金财产投资运营过程中的增值税；</b></p>
十二、基金费用	<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>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>

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。管理费的计算方法如下：  
 $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$   
H为每日应计提的基金管理费  
E为前一日的基金资产净值  
基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费  
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：  
 $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$   
H为每日应计提的基金托管费  
E为前一日的基金资产净值  
基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

3、C类基金份额的销售服务费  
本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。  
销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

**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基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：  
 $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$   
H为每日应计提的基金管理费  
E为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。  
基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费  
**本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。**本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：  
 $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$   
H为每日应计提的基金托管费  
E为前一日的基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则E取0。  
基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

	<p><math>H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}</math>  H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费  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提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4—10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>	<p>费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</p> <p>3、C类基金份额的销售服务费  本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：  <math>H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}</math>  H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费  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提，<b>逐日累计至每月月末</b>，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。</p> <p>上述“(一)基金费用的种类”中第4—12项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>
--	---	--