

关于华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）变更为华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）并 修订基金合同等法律文件的公告

华宝基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）旗下的华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金(LOF)经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】258 号文注册，进行募集。《华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效。根据基金管理人发布《华宝基金管理有限公司关于华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金(LOF)更名并修订基金合同等法律文件的公告》，华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）自 2025 年 6 月 9 日起更名为华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）。

根据《华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定：“若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。”《基金合同》“第九部分 基金份额持有人大会”同时约定：“在不违背法律法规规定和《基金合同》约定且对现有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：……（3）若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》；”

本公司旗下华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：香港大盘 30ETF，基金代码：520560）已于 2025 年 9 月 24 日成立，并于 2025 年 10 月 13 日起在上海证券交易所上市交易。为更好地满足广大投资者的投资理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规规定和《基金合同》的相关约定，本公司经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，决定于 2025 年 11 月 12 日起，将华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金

(LOF) 变更为华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)，并相应修订《基金合同》等法律文件相关条款。现将具体事宜公告如下：

一、变更为联接基金

华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)变更为华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)，根据《基金合同》的上述约定，无须召开基金份额持有人大会。《基金合同》、《华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)托管协议》和《华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)招募说明书》将进行相应修订和补充。登记机构将进行基金份额变更登记，即“华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)A类基金份额”变更为“华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)A类基金份额”，A类基金份额简称由“华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数”变更为“华宝港股通恒生中国(香港上市)30ETF联接(LOF)A”，A类基金份额场内简称“香港大盘LOF”不变，基金代码不变；“华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)C类基金份额”变更为“华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)C类基金份额”，C类基金份额简称由“华宝香港大盘C”变更为“华宝港股通恒生中国(香港上市)30ETF联接(LOF)C”，基金代码不变。

转型变更后的A类基金份额将继续在上海证券交易所上市交易。

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、赎回费率保持不变（销售机构对费率实施优惠的，从其规定）。

二、转型变更后的基金管理费率、托管费率、C类基金份额销售服务费率调整

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

三、修订后的《华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》、《华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》和《华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放

式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书》自 2025 年 11 月 12 日起生效。

四、重要提示

1、本次《基金合同》的修订系根据《基金合同》约定变更为 ETF 联接基金而作出，属于《基金合同》约定的不需召开基金份额持有人大会的事项，转型变更后的费率调整对基金份额持有人利益无实质性不利影响，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

2、本公司于公告当日在网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议、招募说明书及产品资料概要。

3、《华宝港股通恒生中国(香港上市)30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》生效后将进入调仓期，基金管理人将通过二级市场交易、申购赎回 ETF 份额等方式逐步调整持仓结构，将现有组合资产转换为目标 ETF 份额等法律法规允许的其他资产。调仓期间港股及 ETF 标的指数可能出现短期价格波动，调仓期间的买卖操作或加剧基金净值波动。基金管理人将综合考虑市场流动性、交易成本等因素分阶段实施。

4、本公告仅对华宝港股通恒生中国(香港上市)30 指数证券投资基金(LOF)变更有关事项予以说明。投资者欲了解基金的详细情况，可登录本公司网站（www.fsfund.com）查阅基金合同、招募说明书、产品资料概要等法律文件，以及相关业务公告。

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

特此公告。

华宝基金管理有限公司
2025 年 11 月 11 日

附件：《华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）基金合同》修改如下：

基金合同涉及修改章节	原表述	修订后表述
封面	华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）基金合同	华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同 (由华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）变更而来)
全文	华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）	华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF） 删除“认购”、“场内认购”“发售”及类似表述
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集证券投资基金参与沪港通交易指引》、《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“《流动性规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。</p> <p>三、本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并</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》”)、《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》”)、《公开募集证券投资基金参与沪港通交易指引》、《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》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》和其他有关法律法规。</p> <p>三、华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）</p>

	<p>经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p> <p>七、本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p>	<p>(以下简称“本基金”)由华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)变更而来，华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)由基金管理人依照《基金法》、《华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)基金合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p> <p>七、本基金主要投资于目标ETF，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p>
第二部分释义	<p>1、基金或本基金：指华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)</p> <p>25、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、定期定额投资及交易等业务</p> <p>40、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> <p>43、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p>	<p>1、基金或本基金：指华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)，由华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)变更而来</p> <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，销售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及交易等业务</p> <p>41、基金合同生效日：指《华宝港股通恒生中国(香港上市)30交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》生效日，原《华宝港股通恒生中国(香港上市)30指数证券投资基金(LOF)基金合同》同日起失效</p> <p>43、存续期：指《华宝港股通恒生中国(香港上市)25指数证券投资基金(LOF)基金合同》生</p>

	<p>61、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>62、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</p>	<p>效至本基金合同终止之间的不定期期限</p> <p>60、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、投资目标ETF基金份额所得收益、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约</p> <p>61、基金资产总值：指基金拥有的目标 ETF 基金份额、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</p> <p>新增：</p> <p>16、目标ETF：指另一获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“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目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金以华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF</p> <p>17、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，与目标ETF的投资目标类似，紧密跟踪标的指数，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</p> <p>删除：</p> <p>7、基金份额发售公告：指《华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》</p> <p>42、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</p> <p>50、认购：指在基金募集期内，投资者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</p>
第三部分 基金	二、基金的类别 股票型证券投资基金	二、基金的类别 ETF 联接基金

的基本情况	<p>四、基金的投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。</p>	<p>四、基金的投资目标</p> <p>本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>新增：</p> <p>九、目标ETF</p> <p>华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>十、本基金与目标ETF的联系与区别</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> <p>（1）在投资方法方面，目标ETF采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>（2）在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标 ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，申赎目标ETF；而本基金则与其他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> <p>本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括：</p> <p>（1）法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，仍需保留不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保</p>
-------	---	--

	<p>证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>(2) 申购赎回的影响。目标ETF采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。</p>
第四部分 基金的历 史沿革	<p>删除：</p> <p>五、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为2亿份。</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民币1.00元。</p> <p>本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。</p> <p>第四部分 基金的份额的发售</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 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 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。场外通过各销售机构的基金销售网点或以销售机构提供的其他方式公开发售，具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。场内通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位发售，尚未取得</p> <p>第四部分 基金的历史沿革 华宝港股通恒生中国（香港上市）30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）由华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）变更而来。 原华宝港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）经中国证监会《关于准予华宝兴业港股通恒生中国（香港上市）25 指数证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可【2017】258 号）注册募集。基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。《华宝兴业港股通恒生中国(香港上市)25 指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效。自 2025 年 6 月</p>

基金销售业务资格、但属于上海证券交易所会员单位的其他机构，可在基金份额上市后，代理投资者通过上海证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。

3、发售对象

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者。

二、基金份额的认购

1、认购费用

本基金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。

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，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

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。

4、认购份额余额的处理方式

基金认购份额余额具体的计算方法在招募说明书中列示。

5、认购申请的确认

基金销售机构对认购申请的受理并不

9日起，华宝港股通恒生中国（香港上市）25指数证券投资基金（LOF）更名为华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）。

2025年9月24日，基金管理人管理的华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金成立。根据《华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）基金合同》的约定，“若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。”

基金管理人经与基金托管人协商一致后，决定将华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）变更为华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF），并据此修订《华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）基金合同》。自2025年11月12日起，《华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效，原《华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。

	<p>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。</p> <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资者认购时，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者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、投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不得撤销。</p>	
第五部分 基金的存续	<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 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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》</p>	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>一、基金份额的变更登记</p> <p>基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要信息的变更。</p>

	<p>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>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 日内返还投资者已缴纳的款项，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。 	
第六部分 基金份额的上市交易	<p>三、上市交易的时间</p> <p>基金合同生效后，本基金 A 类基金份额将申请在上海证券交易所上市交易。</p> <p>在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。</p>	<p>二、上市交易的时间</p> <p>基金管理人已于 2017 年 5 月 3 日在指定媒介刊登上市交易公告书，原华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额已于 2017 年 5 月 8 日上市交易。</p> <p>基金合同生效后，华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）的登记机构将进行基金份额变更登记，将华宝港股通恒生中国（香港上市）30 指数证券投资基金（LOF）A 类基金份额调整为本基金 A 类基金份额，基</p>

	<p>金代码不变。</p>	
	<p>删除：</p> <p>一、上市交易的基金份额</p> <p>基金合同生效后，在本基金符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请本基金 A 类基金份额上市交易。</p> <p>四、上市交易的条件</p> <p>基金合同生效后具备下列条件，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请本基金 A 类基金份额上市：</p> <ul style="list-style-type: none"> 1、募集金额不少于 2 亿元人民币； 2、基金份额持有人不少于 1000 人； 3、上海证券交易所规定的其他条件。 <p>基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。</p>	
第七部分 基金份额的申购与赎回	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、7、8、11项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、7、8、9、10、12项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况</p>

<p>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>十三、基金份额的登记和转托管</p> <p>1、基金份额的登记</p> <p>(2) 登记在证券登记系统中的A类基金份额，可以直接申请场内赎回或在本基金上市后在上海证券交易所上市交易。</p> <p>2、基金份额的转托管</p> <p>(4) 本基金上市前、权益分派期间、上海证券交易所规定相应停牌日期、基金份额处于质押、冻结状态或出现上海证券交易所、登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。</p>	<p>消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>十三、基金份额的登记和转托管</p> <p>1、基金份额的登记</p> <p>(2) 登记在证券登记系统中的A类基金份额，可以直接申请场内赎回或在上海证券交易所上市交易。</p> <p>2、基金份额的转托管</p> <p>(4) 本基金权益分派期间、上海证券交易所规定相应停牌日期、基金份额处于质押、冻结状态或出现上海证券交易所、登记机构规定的其他情形时，不得办理跨系统转托管。</p> <p>新增：</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>9、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>10、目标 ETF 暂停申购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。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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。</p> <p>7、目标ETF暂停赎回或延缓支付赎回对价或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回或延缓支付赎回款项的情形。</p> <p>删除：</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>9、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持有基金份额数的比例</p>
--	--

		<p>达到或者超过基金份额总数的 50%, 或者变相规避 50%集中度的情形时。</p> <p>十三、基金份额的登记和转托管</p> <p>3) 募集期内不得办理系统内转托管。</p>
第八部分 基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：黃孔威</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(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发售、申购、赎回和登记事宜；</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：人民币66.99亿元</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：夏雪松</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(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>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>注册资本：人民币869,652.6806万元</p> <p>新增：</p> <p>一、基金管理人</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>(17) 与基金托管人协商一致，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；</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>(9) 出席或者委派代表出席目标ETF的基</p>

	<p>基金份额持有人大会，对目标ETF的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p> <p>删除：</p> <p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(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>
第九部分 基金份额 持有人 大会	<p>一、召开事由</p> <p>(8)变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>新增：</p> <p>鉴于本基金和目标ETF的相关性，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金的基金份额直接出席目标ETF的基金份额持有人大会或者委派代表出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会基金份额和表决票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会基金份额数和表决票数为：在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标ETF份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金折算为目标ETF后的每一参会份额和目标ETF的每一参会份额拥有平等的投票权。</p> <p>本基金的基金管理人不应以本基金的名义</p>

	<p>代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。</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>
第十三部分 基金的投资	<p>删除：</p> <p>一、 召开事由</p> <p>2、 在不违背法律法规规定和《基金合同》约定且对现有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>(3) 若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)，则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》；</p> <p>一、 投资目标</p> <p>紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。</p> <p>二、 投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标ETF基金份额、标</p>

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票（包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的股票）、债券（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、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

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：

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

三、投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当

的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于依法发行上市的非成份股（包括港股通标的股票和中国证监会核准或注册发行上市的股票）、债券（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、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

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的资产比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

三、投资策略

本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。正常情

的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。

1、组合复制策略

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

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

2、替代性策略

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

况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。

1、资产配置策略

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

2、目标 ETF 投资策略

1) 投资组合的投资方式

本基金可以申购及赎回目标 ETF 基金份额，也可以在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标 ETF 的投资方式。本基金在二级市场上买卖目标 ETF 基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成

	<p>本、降低跟踪误差的目的。</p> <p>2) 投资组合的调整</p> <p>本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。</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，但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。</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) 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；</p> <p>除上述第(2)、(6)、(7)、(12)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，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>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>因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第(1)项规定投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整。除上述第(1)、(2)、(6)、(7)、(12)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、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</p>

	<p>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>
2、禁止行为	<p>2、禁止行为</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>(4) 买卖除目标ETF以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p>
五、标的指数与业绩比较基准	<p>五、标的指数与业绩比较基准</p> <p>由于本基金为目标ETF的联接基金，与目标ETF具有相似的投资目标，因此本基金采用上述业绩比较基准能够较好地反映本基金的投资策略，能够较为客观地反映本基金的风险收益特征。</p>
六、风险收益特征	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，并且具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金及目标ETF将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> <p>新增：</p> <p>七、目标ETF发生相关变更情形时的处理</p> <p>目标ETF出现下述情形之一的，本基金将在履行适当程序后由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，与该指数基金合并。相应地，基金合同中将删除关于目标ETF的表</p>

		<p>述部分，届时将由基金管理人另行公告。</p> <p>(1) 目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</p> <p>(2) 目标ETF终止上市；</p> <p>(3) 目标ETF基金合同终止；</p> <p>(4) 目标ETF的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外）；</p> <p>(5) 目标ETF与其他基金合并；</p> <p>(6) 中国证监会规定的其他情形。</p> <p>删除：</p> <p>七、未来条件许可情况下的基金模式转换</p> <p>若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。</p>
第十四部分 基金的财产	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、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。</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买的目标ETF基金份额、各类证券及票据价值、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。</p>
第十五部分 基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标ETF基金份额、股票、权证、债券、股指期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第8项进行估值时，所造成的误差不作为基</p>

	<p>不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>金资产估值错误处理。</p> <p>新增：</p> <p>三、估值方法</p> <p>1、目标ETF的估值</p> <p>本基金投资的目标ETF基金份额以目标ETF估值日基金份额净值估值，若当日无目标ETF基金份额净值的，以目标ETF最近公布的基金份额净值估值。</p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</p>
第十六部分 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0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值</p> <p>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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <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</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0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值（若为负数，则取0）</p> <p>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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如</p>

		下:
	3、销售服务费 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。 本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下： $H = E \times 0.40\% \div \text{当年实际天数}$ H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值 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。	$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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） 3、销售服务费 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。 本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.30%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下： $H = E \times 0.30\% \div \text{当年实际天数}$ H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值 上述“一、基金费用的种类”中第4—13项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
	三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用；	三、不列入基金费用的项目 3、《华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效前的相关费用；
		新增： 一、基金费用的种类 12、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）；

第十九部分 基金的信 息披露	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(八) 临时报告</p> <p>22、本基金变更标的指数;</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(五) 临时报告</p> <p>21、本基金变更目标 ETF 或变更标的指数;</p> <p>新增:</p> <p>本基金在招募说明书（更新）及定期报告等文件中应当设立专门章节披露所持目标ETF以下情况，并揭示相关风险：</p> <p>1、投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；</p> <p>2、交易及持有目标ETF产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等，招募说明书（更新）中应当列明计算方法并举例说明；</p> <p>3、持有的目标ETF发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；</p> <p>4、本基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。</p> <p>删除:</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</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>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、《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》、</p>

	<p>基金托管协议登载在网站上。</p> <p>(二) 基金份额发售公告</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>(四) 基金份额上市交易公告书</p> <p>本基金获准在上海证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易前至少3个工作日将基金份额上市交易公告书登载于指定媒介上。</p> <p>(七) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p> <p>(八) 临时报告</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集；</p>	
第二十三部分 基金合同的效力	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或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>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章，自2025年11月12日起，《华宝港股通恒生中国（香港上市）30交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效，原《华宝港股通恒生中国（香港上市）30指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。</p>