

# 于华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金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”）旗下的华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华宝兴业沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2663 号）注册募集，《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2016 年 12 月 9 日正式生效。

根据《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增强策略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》“第八部分 基金份额持有人大会”同时约定：“2、在法律法规和《基金合同》规定的范围内并在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增强策略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》；……。”

本公司旗下华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：沪深 300 指增 ETF，基金代码：562070）已于 2025 年 12 月 17 日成立，并于 2025 年 12 月 25 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中国农业银行股份有限公司协商一致，决定于 2026 年 1 月 9 日起，将华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，降低本基金的管理费和托管费，根据法律法规变动及实际运作删除权证、中小板的相关内容，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

华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深 300 增强策略交易型开

放式指数证券投资基金发起式联接基金，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》、《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》和《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》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“华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 A 类基金份额”变更为“华宝沪深 300 增强策略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”，基金简称由“华宝沪深 300 增强”变更为“华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 A”，基金代码不变；“华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 C 类基金份额”变更为“华宝沪深 300 增强策略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”，基金简称由“华宝沪深 300 增强 C”变更为“华宝沪深 300 增强策略 ETF 发起式联接 C”，基金代码不变。

前述变更不影响各类基金份额净值的计算，各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率均保持不变（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、托管费率调整

- 1、基金管理费率由 1.00%/年降低至 0.80%/年。
- 2、基金托管费率由 0.15%/年降低至 0.10%/年。

三、修订后的《华宝沪深 300 增强策略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》、《华宝沪深 300 增强策略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《华宝沪深 300 增强策略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 2026 年 1 月 9 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审议的事项，其余修改对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会。本公司已就修订内容履行了规定的程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

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

3、《华宝沪深 300 增强策略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》生效后进入调仓期，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 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、本公告仅对华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金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](http://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](http://www.fsfund.com)）或拨打公司客户服务电话（400-700-5588、400-820-5050）咨询相关情况。

#### 6、风险提示

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等基金法律文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华宝基金管理有限公司  
2026 年 1 月 8 日

附件：《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》修改如下：

基金合同涉及修改章节	原表述	修订后表述
封面	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同	<u>华宝沪深300增强策略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</u> （由华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金变更而来）
全文	华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金	<u>华宝沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</u> 删除“募集”、“认购”、“发售”及类似表述
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）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》、<u>基金合同</u>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>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》</u>（以下简称“《指数基金指引》”）、<u>《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》</u>和其他有关法律法规。</p> <p>三、<u>华宝沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</u>（以下简称“本基金”）由华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金变更而来，<u>华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金</u>由基金管理人依照《基金法》、<u>《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金</u></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>六、本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p>	<p><u>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。</u></p> <p>中国证监会对<u>华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金</u>募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。</p> <p>六、本基金主要投资于目标ETF，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1、基金或本基金：指<u>华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金</u></p> <p><del>8、基金份额发售公告：指《华宝兴业沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告》</del></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、转托管及定期定额投资等业务</p> <p><del>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</del></p> <p>33、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>34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p> <p>41、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</p>	<p>1、基金或本基金：指<u>华宝沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，由华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金变更而来</u></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、转托管及定期定额投资等业务</p> <p>32、基金合同生效日：指《<u>华宝沪深300增强策略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</u>》生效日，原《<u>华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同</u>》同日起失效</p> <p>34、存续期：指《<u>华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同</u>》生效至本基金合同终止之间的不定期期限</p>

买基金份额的行为

49、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

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

57、发起资金：指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等人员参与认购本基金的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 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低于三年

58、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发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股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

48、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

49、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

56、发起资金：指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等人员参与认购华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的资金。发起资金认购华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限自《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效日起不低于三年

57、发起资金提供方：指以发起资金认购华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金且承诺以发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股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员

新增：

15、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。本基金以华宝沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF

16、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于

		<p><u>跟踪同一标的指数的目标ETF，与目标ETF的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金</u></p>
<p>第三部分 基金的基本情况</p>	<p>二、基金的类别</p> <p><del>股票型证券投资基金</del></p> <p>四、基金的投资目标</p> <p><del>本基金为沪深 300 指数增强型基金，在实现对沪深 300 指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。</del></p> <p>六、基金的最低募集份额总额</p> <p><del>本基金为发起式基金，发起资金提供方认购本基金的金额不少于 1000 万元人民币，且持有认购份额的期限自基金合同生效日起不少于 3 年，期间份额不能赎回。认购份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内离职的，其持有期限的承诺不受影响。</del></p> <p>七、基金份额发售面值和认购费用</p> <p><del>本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</del></p> <p><del>本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。</del></p>	<p>二、基金的类别</p> <p><u>ETF 联接基金</u></p> <p>四、基金的投资目标</p> <p><u>本基金主要通过投资于目标 ETF，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。</u></p> <p>新增：</p> <p><u>八、目标ETF</u></p> <p><u>华宝沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金。</u></p>

		<p style="text-align: center;"><u>九、本基金与目标ETF的联系与区别</u></p> <p><u>本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别：</u></p> <p><u>（1）在投资方法方面，目标ETF直接投资于标的指数的成份股和备选成分股等，跟踪标的指数的表现；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，实现对标的指数的有效跟踪。</u></p> <p><u>（2）在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，申赎目标ETF；而本基金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。</u></p> <p><u>本基金与目标ETF业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括：</u></p> <p><u>（1）法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，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、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。</u></p> <p><u>（2）申购赎回的影响。目标ETF采取按照最小申购、赎回单位和申购、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。</u></p>
<p>第四部分基金的历史沿革</p>	<p><del>第四部分 基金份额的发售</del></p> <p><del>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</del></p> <p><del>1、发售时间</del></p>	<p><u>第四部分 基金的历史沿革</u></p> <p><u>华宝沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金变更而来。</u></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。~~

## ~~2、发售方式~~

~~通过各销售机构的基金销售网点或其指定的其他方式公开发售，各销售机构的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。~~

## ~~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~~

~~认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分舍去，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。~~

华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金经中国证监会《关于准予华宝兴业沪深300指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2663号）注册募集。基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2016年12月9日正式生效。

2025年12月17日，基金管理人管理的华宝沪深300增强策略交易型开放式指数证券投资基金成立。根据《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的约定，“若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的增强策略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，决定将华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金变更为华宝沪深300增强策略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《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》。自2026年1月9日起，《华宝沪深300增强策略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《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

	<p><del>5、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以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。</del></p> <p><del>三、基金份额认购金额的限制</del></p> <p><del>1、投资者认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>四、发起资金的认购</del></p> <p><del>本基金发起资金认购的金额不少于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。</del></p> <p><del>本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。</del></p>	
<p>第五部分 基金的 存续</p>	<p><del>第五部分 基金备案</del></p> <p><del>一、基金备案的条件</del></p> <p><del>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基金的金额不少于1000万元人民币,且承诺持有期限自基金合同生效日起不少于3年的,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</del></p>	<p><u>第五部分 基金的存续</u></p> <p><u>一、基金份额的变更登记</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</u></p> <p><u>《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资</u></p>

机构验资，验资机构需在验资报告中对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。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。

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。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

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：

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日内退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。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

基金合同》生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效三年后本基金继续存续的，基金存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

	<p>基金合同生效后三年后继续存续的，基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>	
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、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><del>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持有基金份额数的比例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。</del></p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、<del>9</del>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照<u>基金份额登记</u>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><u>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。</u></p> <p><u>8、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。</u></p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、<u>7、8、10</u> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>增加：</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p><u>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。</u></p>

		<p><u>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。</u></p>
<p>第七部分 基金合同 当事人及 权利 义务</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：<u>黄孔威</u></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>(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、赎回和登记事宜</u>；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额<u>认购、申购、赎回和注销价格</u>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<u>申购、赎回</u>的价格；</p> <p><del>-(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；-</del></p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及</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：<u>夏雪松</u></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>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金<u>申购、赎回、转换和非交易过户</u>等业务规则；</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>申购、赎回和登记事宜</u>；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额<u>申购、赎回和注销价格</u>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<u>申购、赎回</u>的价格；</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</p>

	<p>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) <del>缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;</del></p> <p>(9)发起资金提供方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;</p>	<p>关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:</p> <p>(4)缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;</p> <p>(9)发起资金提供方认购的基金份额持有期限自<u>《华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》</u>生效日起不少于3年;</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><u>(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;</u></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><u>(9)出席或者委派代表出席目标ETF的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;</u></p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</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>(8)变更基金投资目标、范围或策略;</p> <p>2、在法律法规和《基金合同》规定的范围内并在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增强策略交易型开放式指</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>(8)变更基金投资目标、范围或策略,<u>但《基金合同》另有约定的除外;</u></p> <p>2、在法律法规和《基金合同》规定的范围内并在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)<u>由于目标ETF变更标的指数、变更交易方式、</u></p>

	<p>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><u>终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略:</u></p> <p>新增:</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权,但可接受本基金的基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的,须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标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。</u></p>
第十二部	一、投资目标	一、投资目标

分  
基  
金  
的  
投  
资

本基金为沪深300指数增强型基金，~~在实现对沪深300指数有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合配置和管理，力争实现稳定的优于标的指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。~~

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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、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、分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、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%，其中投资于沪深 300 指数成分股及备选成分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%。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。~~

三、投资策略

本基金主要通过投资于目标ETF，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。

二、投资范围

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、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、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、分离交易可转债、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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）。

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，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%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

三、投资策略

本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目

本基金在复制标的指数的基础上通过数量化模型优化投资组合，力求在控制与业绩比较基准偏离度前提下获得超越标的指数的投资收益。

#### 1、资产配置策略

本基金主要投资于沪深300指数成分股及备选股票。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。

#### 2、股票投资策略

本基金主要采用量化行业配置模型和量化Alpha选股模型构建指数增强股票组合，在控制跟踪偏离度的前提下力争实现超额表现。

##### （1）量化行业配置模型

在跟踪偏离风险可控的前提下，结合行业景气度、投资时钟、行业动量和行业超跌偏离度等基本面和技术面模型，在标的指数行业权重的基础上进行优化。

##### （2）量化Alpha选股模型

本基金采用的是基金管理人量化团队经过对中国证券市场运行特征的长期研究和检验后自主开发的量化Alpha选股模型。该模型主要选取估值、成长、盈利质量、市场预期等基本面因子以及股权激励、并购、重要股东投资行为、业绩超预期等事件驱动因子，通过实证分析确定各因子的权重，对股票池中的股票进行综合

标ETF，在力求有效跟踪标的指数基础上，力争获取超越指数表现的投资收益。本基金的风险控制目标为力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

#### 1、资产配置策略

本基金主要投资于目标ETF。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。同时，基于流动性管理及策略性投资的需要，本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。

#### 2、目标ETF投资策略

##### 1) 投资组合的投资方式

本基金可以通过申购赎回代理券商以成份股实物形式申购及赎回目标ETF基金份额，也可以通过券商在二级市场上买卖目标ETF基金份额。本基金将根据开放日申购赎回情况、综合考虑流动性、成本、效率等因素，决定目标ETF的投资方式。通常情况下，本基金以申购和赎回为主：当收到净申购时，本基金构建股票组合、申购目标ETF；当收到净赎回时，本基金赎回目标ETF、卖出股票组合。对于股票停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的剩余成份股，本基金将选择作为后续实物申购目标ETF的基础证券或者择机在二级市场卖出。本基金在二级市场上买卖目标ETF基金份额是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的。

##### 2) 投资组合的调整

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

#### 3、股票投资策略

根据对中国证券市场运行特征的长期研究、

打分后,构建股票投资组合。在此基础上,本基金进一步根据个股价格波动、风险收益变化、特殊事件等实际情况,对行业内的个股权重进行动态调整,以保证股票组合的跟踪误差处于可控范围内。股票池包括标的指数的成分股及各选股、预计指数定期调整中即将被调入的股票、非成分股中流动性良好、基本面优质及与成分股相关度高的股票。

#### —(3) 投资组合调整与风险控制

本基金将定期调整投资组合,并会对标的指数成分股保持密切跟踪。在出现因增发、送配、长期停牌后复牌等对成分股在标的指数中权重有影响的情况,或者成分股临时调入调出、成分股出现黑天鹅事件等情况时,本基金将及时对投资组合进行调整。

本基金将通过风险评估模型控制投资组合的跟踪偏离风险。本基金主要采用“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。

本基金的风险控制目标为力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。

#### —(4) 模型的动态调整

基金管理人量化团队会根据市场变化趋势,定期对量化模型进行动态调整,不断改进量化模型的有效性。

#### 7、其他金融工具投资策略

在法律法规许可的前提下,本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以期更好

投研团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验,选取对股票超额收益具有较强解释度的指标构建量化Alpha选股模型。主要考虑估值、成长、盈利质量、市场预期、机构持仓等基本面因子以及量价、资金流等技术面因子,以基本面因子为主,技术面因子为辅,通过实证分析和动态跟踪,以超额收益的水平和稳定性为目标确定各因子的优化权重,根据该模型的综合评分结果,在各行业中选择得分较高的股票构建股票投资组合。整体的选股思路运用GARP的指导思想,注重因子的逻辑性和有效性,注重股票的性价比以及风格的均衡。所选股具备较高的市场认可度、成长水平、盈利质量等,具备对优质大盘龙头股票的综合表征能力。

地实现本基金的投资目标。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

~~（1）本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；~~

~~（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；~~

~~（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；~~

~~（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；~~

~~（18）本基金参与股指期货交易后，依据下列标准建构组合：~~

3) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

除上述第（2）、（9）、（10）、（15）条外，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。

##### 8、其他金融工具投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以期更好地实现本基金的投资目标。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（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%；

（15）本基金参与股指期货交易后，依据下列标准建构组合：

3) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的95%。其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

## 2、禁止行为

(4) 买卖其他基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;

## 五、业绩比较基准

~~本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率\*95%+1.5% (指年收益率, 评价时按期间折算)~~

## 六、风险收益特征

~~本基金为股票型基金, 属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种, 其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。~~

## 七、未来条件许可情况下的基金模式转换

~~若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的增强策略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。~~

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)条外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、目标ETF暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在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。

## 2、禁止行为

(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;

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率(税后)×5%

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> <p><u>本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型指数基金，本基金的预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</u></p> <p>七、目标ETF发生相关变更情形时的处理</p> <p><u>目标ETF出现下述情形之一的，本基金将在履行适当程序后由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有以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的表述部分，届时将由基金管理人另行公告。</u></p> <p><u>(1) 目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</u></p> <p><u>(2) 目标ETF终止上市；</u></p> <p><u>(3) 目标ETF基金合同终止；</u></p> <p><u>(4) 目标ETF的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外）；</u></p> <p><u>(5) 目标ETF与其他基金合并；</u></p> <p><u>(6) 中国证监会规定的其他情形。</u></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<u>目标ETF基金份额</u>、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>
第十四部分 基金	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、股指期货合约、<del>权证</del>、债券、资产支持证券和银行存款本</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的<u>目标ETF基金份额</u>、股票、股指期货合约、债券、资产支持证券和银行存款本息、</p>

<p>资产估值</p>	<p>息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、固定收益品种和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</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6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>应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>三、估值方法</p> <p>2、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1)交易所上市的有价证券(包括股票等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>(2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值；</p> <p>(3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值价格或推荐估值价格进行估值；对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值价格或推荐估值价格，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；</p> <p>3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票和固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估</p>
-------------	--	---

		<p>值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>4、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价；对全国银行间市场上含权的固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价；对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。</p> <p>八、特殊情况的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>新增：</p> <p>三、估值方法</p> <p>1、<u>目标ETF的估值</u></p> <p><u>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。</u></p> <p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、<u>基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</u></p>
第十五部分 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>本基金的管理费按前一日基金资产净值</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><u>本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不</u></p>

<p>与税收</p>	<p>的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$ <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>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</p> <p>E为前一日的基金资产净值</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>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用；</p>	<p><u>收取管理费</u>。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0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$ <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><u>本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费</u>。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下：</p> $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>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>上述“一、基金费用的种类”中第4—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、<u>《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效前的相关费用；</u></p> <p>新增：</p> <p>一、基金费用的种类</p> <p>10、<u>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）；</u></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>(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>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。</p> <p><del>基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人应当在基金份额发售的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》、基金托管协议登载在网站上。</del></p> <p><del>(二) 基金份额发售公告</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>(三) 《基金合同》生效公告</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>(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</del></p> <p><del>《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</del></p>	<p>五、公开披露的基金信息</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>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。</p> <p><u>(四) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</u></p>
--	---	---

~~报告或者年度报告。~~

(七) 临时报告

~~8、基金募集期延长或提前结束募集；~~

23、基金合同生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。在该对应日之前，若本基金资产规模接近2亿元，本基金有可能在对应日终止的，为使投资者在对应日之前谨慎作出投资决策，基金管理人将在对应日之前发布临时公告提示投资者本基金可能终止的风险；

基金管理人应当按照相关法律法规的规定在基金合同生效公告、基金年报、中期报告、季报中分别披露基金管理公司固有资金、基金管理公司高级管理人员、基金经理以及基金管理公司股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

(五) 临时报告

21、本基金变更目标ETF或变更标的指数；

23、《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。在该对应日之前，若本基金资产规模接近2亿元，本基金有可能在对应日终止的，为使投资者在对应日之前谨慎作出投资决策，基金管理人将在对应日之前发布临时公告提示投资者本基金可能终止的风险；

基金管理人应当按照相关法律法规的规定在基金年报、中期报告、季报中分别披露基金管理公司固有资金、基金管理公司高级管理人员、基金经理以及基金管理公司股东持有基金的份额、期限及期间的变动情况。

新增：

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：

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；

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；

4、本基金投资于基金管理人以及基金管理

		<p><u>人关联方所管理基金的情况。</u></p>
<p>第二十二部分基金合同的效力</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章，自2026年1月9日起，<u>《华宝沪深300增强策略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》</u>生效，原<u>《华宝沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金合同》</u>同日起失效。</p>