

万家基金管理有限公司

关于万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更为万家 国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 并修订基金合同与托管协议的公告

万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2023 年 4 月 27 日成立。基金管理人为万家基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”），基金托管人为恒丰银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定：“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会，在履行适当程序后及时公告。”

本公司旗下万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金已于 2026 年 2 月 4 日成立。本公司根据《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》和《基金合同》的有关规定，经与本基金基金托管人协商一致，决定于 2026 年 2 月 13 日起，将万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更为万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并相应修改《基金合同》和《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）中相关条款。现将具体事宜公告如下：

一、基金份额的变更登记

本基金变更为万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金后，基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金 A 类基金份额”变更为“万家国证新能源车电池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”，“万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金 C 类基金份额”变更为“万家国证新能源车电池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”。本基金的基金简称分别由“万家国证新能源车电池指数发起式 A”变更为“万家国证新能源车电池 ETF 发起式联接 A”，基金代码“018379”不变；“万家国证

新能源车电池指数发起式 C” 变更为“万家国证新能源车电池 ETF 发起式联接 C”，基金代码“018380”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、销售服务费率及申购、赎回相关业务规则均保持不变（销售机构对费率实施优惠的，从其规定）。

二、《基金合同》与《托管协议》的修订

本公司经与基金托管人协商一致，对本基金《基金合同》、《托管协议》中涉及基金变更相关内容进行修改，并对本基金《托管协议》中涉及基金实际运作相关内容进行修改，以上修改属于《基金合同》约定的无需召开基金份额持有人大会的情形。修订后的《万家国证新能源车电池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》、《万家国证新能源车电池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》自 2026 年 2 月 13 日起生效，原《基金合同》和《托管协议》同日起失效。

本基金管理人将于公告当日将修改后的《万家国证新能源车电池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》和《万家国证新能源车电池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》登载于规定网站。本基金招募说明书及基金产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，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。

三、其他需要提示的事项

1、本公告仅对万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更为万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改《基金合同》和《托管协议》事项予以说明，最终解释权归本公司。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》等相关法律文件。本基金管理人可以在法律法规和《基金合同》规定范围内调整上述有关内容。

2、投资者可登录本基金管理人网站 www.wjasset.com 或拨打客户服务电话 400-888-0800 咨询相关事宜。

特此公告。

风险提示：本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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金管理人管理的基金及其投资人员的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件及关注基金特有风险，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

万家基金管理有限公司

2026年2月12日

万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金

《基金合同》、《托管协议》修订对照表

一、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》修订对照表

章节	原基金合同表述	修订后基金合同表述
全文	万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金	万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
第一部分前言	<p>一、订立基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金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>三、万家国证新能源车电池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>一、订立基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金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、万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）由万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更而来，万家国证新能源车电池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>中国证监会对万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金募集的注册，并不表明其对该基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于该基金没有风险。</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、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”部分。</p> <p>.....</p>	<p>七、本基金为ETF联接基金，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“风险揭示”部分。</p> <p>.....</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1、基金或本基金：指万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金</p> <p>.....</p> <p>8、基金份额发售公告：指《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》</p> <p>.....</p> <p>17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会</p> <p>.....</p> <p>24、基金销售业务：指为投资人开立基金交易账户，宣传推介基金，办理基金份额发售、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等活动</p> <p>.....</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认购、申购、赎回、转换、转托管</p>	<p>1、基金或本基金：指万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，本基金由万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更而来</p> <p>.....</p> <p>16、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等对银行业金融机构进行监督和管理的机构</p> <p>17、标的指数：指深圳证券信息有限公司编制并发布的国证新能源车电池指数及其未来可能发生的变更</p> <p>18、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。本基金的目标ETF指万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金</p> <p>19、ETF联接基金：指将绝大部分基金财产投资于目标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>.....</p> <p>26、基金销售业务：指为投资人开立基金交易账户，宣传推介基金，办理基金份额申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等活动</p> <p>.....</p> <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办理申购、赎回、转换、转托管及定期</p>

<p>及定期定额投资计划等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>30、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>.....</p> <p>32、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>33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p> <p>.....</p> <p>40、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</p> <p>.....</p> <p>43、标的指数：指深圳证券信息有限公司编制并发布的国证新能源车电池指数及其未来可能发生的变更</p> <p>.....</p> <p>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</p> <p>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、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>.....</p> <p>62、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等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于 3 年，法律法规、中国证监会另有规定的除外</p> <p>63、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</p>	<p>定额投资计划等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>32、基金合同生效日：指《万家国证新能源车电池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》生效日，原《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》自同一日起失效</p> <p>.....</p> <p>34、存续期：指《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》生效至本基金基金合同终止之间的不定期期限</p> <p>.....</p> <p>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 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>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、基金应收款项及其他资产的价值总和</p> <p>.....</p> <p>61、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等人员的资金。发起资金认购万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金的金额不低于 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于 3 年，法律法规、中国证监会另有规定的除外</p> <p>62、发起资金提供方：指以发起资金认购万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金且承诺以发起资金认</p>
---	--

	<p>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</p>	<p>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</p>
<p>第三部分 基金的基本情况</p>	<p>二、基金的类别 股票型证券投资基金</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。</p>	<p>二、基金的类别 ETF 联接基金</p> <p>四、基金的投资目标 本基金通过主要投资于目标 ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>五、目标 ETF 万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金</p> <p>六、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。 本基金与目标 ETF 之间的联系: (1) 两只基金的投资目标均为紧密跟踪业绩比较基准; (2) 两只基金具有相似的风险收益特征; (3) 目标 ETF 是本基金的主要投资对象。 本基金与目标 ETF 之间的区别: (1) 在基金的投资方法方面,目标 ETF 主要采用完全复制法,直接投资于标的指数成份股、备选成份股;而本基金通过主要投资于目标 ETF,间接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买卖目标 ETF 的基金份额,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,投资者可以通过基金管理人及非直销销售机构,按“未知价”法以现金方式进行申购与赎回。(3) 在价格揭示机制方面,目标 ETF 有实时市场交易价格和每日基金份额净值;而本基金只有每日基金份额净值。 本基金与目标 ETF 业绩表现仍可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括: (1) 法规对投资比例的要求。目</p>

	<p>五、发起资金的认购金额下限、持有期限下限</p> <p>认购本基金的发起资金金额不少于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、中国证监会另有规定的除外。</p> <p>.....</p> <p>六、基金份额发售面值和认购费用</p> <p>本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。</p> <p>本基金A类基金份额的认购费率按招募说明书及基金产品资料概要等文件的规定执行。本基金C类基金份额不收取认购费用。</p> <p>.....</p> <p>八、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为国证新能源车电池指数。</p> <p>九、基金份额的类别</p> <p>本基金将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，但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；从本类别基金资产中计提销售服务费，但不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。相关费率</p>	<p>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票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。（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资产净值产生一定影响。</p> <p>七、发起资金的认购金额下限、持有期限下限</p> <p>认购万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金的发起资金金额不少于1000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限自《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日起不少于3年，法律法规、中国证监会另有规定的除外。</p> <p>.....</p> <p>十、基金份额的类别</p> <p>本基金将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用，但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；从本类别基金资产中计提销售服务费，但不收取申购费用的基金份额，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。</p>
--	---	---

	<p>的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。</p> <p>……</p> <p>投资者在认购/申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见招募说明书或相关公告。</p> <p>……</p> <p>十、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同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会，在履行适当程序后及时公告。</p>	<p>……</p> <p>投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见招募说明书或相关公告。</p> <p>……</p>
<p>第四部分 基金的历史沿革</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>通过各销售机构网站或营业网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。基金管理人可根据情况调整销售机构。</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、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>本基金 A 类基金份额在认购时收取认购费用，C 类基金份额不收取认购费用。</p>	<p>万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更而来。</p> <p>万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金于 2023 年 4 月 11 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2023]781 号文准予注册，《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 27 日生效。基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。</p> <p>根据《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定：“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会，在履行适当程序后及时公告。”，故万家国证新能源车电池指数型发起式证券</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等文件中列示。基金认购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 认购份额余额的处理方式在招募说明书中列示。</p> <p>5、认购申请的确认 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的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的任何损失由投资者自行承担。</p> <p>三、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、投资者在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,但已受理的认购申请不允许撤销。</p>	<p>投资基金变更为万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金无需召开基金份额持有人大会,可经基金管理人与基金托管人协商一致后修改基金合同。</p> <p>经基金管理人与基金托管人协商一致,决定将万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更为万家国证新能源车电池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《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》。自 2026 年 2 月 13 日起,《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》失效,《万家国证新能源车电池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。基金合同当事人将按照《万家国证新能源车电池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》享有相应权利并承担有关义务。</p>
<p>第五部分 基金的存续</p>	<p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起 3 个月内,在发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元人民币且承诺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</p>	

<p>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,验资机构应在验资报告中对发起资金的持有人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。</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>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。 <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 3 年后的年度对应日,若基金资产净值低于 2 亿元的,《基金合同》自动终止,不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时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,则本基金可以参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》生效满 3 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</p>	<p>《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起 3 年后的年度对应日,若基金资产净值低于 2 亿元的,《基金合同》自动终止,不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时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,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《万家国证新能源车电池指数型发起</p>
---	---

	<p>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的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。</p> <p>法律法规、中国证监会或基金合同另有规定时，从其规定。</p>	<p>式证券投资基金基金合同》生效满 3 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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。</p> <p>法律法规、中国证监会或基金合同另有规定时，从其规定。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>.....</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>.....</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。基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将指示基金托管人在法律法规规定的期限内支付赎回款项。如遇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，则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同约定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基金合同有关条款处理。</p> <p>.....</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金分为 A 类和 C 类基金份额，各类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告。遇</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>.....</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>.....</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。基金份额持有人赎回申请生效后，基金管理人将指示基金托管人在法律法规规定的期限内支付赎回款项。如遇目标 ETF 的投资市场休市、目标 ETF 暂停交易或赎回、目标 ETF 延迟支付赎回对价或延迟交收、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，则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回或基金合同约定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基金合同有关条款处理。</p> <p>.....</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金分为 A 类和 C 类基金份额，各类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当</p>

	<p>特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</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%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形时。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、9、10项情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上进行公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p>	<p>延迟计算或公告。未来若市场情况发生变化，或目标ETF净值计算和发布时间发生变化，或因实际需要，经履行适当程序，本基金可相应调整基金份额净值计算和公告时间或频率并提前公告。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>.....</p> <p>7、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。</p> <p>8、目标ETF暂停申购、暂停上市或目标ETF停牌，或达到、接近申购上限，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的。</p> <p>.....</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、7、8、10、11项情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上进行公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>.....</p> <p>5、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。</p> <p>6、目标ETF暂停赎回、暂停上市或目标ETF停牌，或延缓支付赎回对价时，或达到、接近赎回上限时，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。</p> <p>.....</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>（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>.....</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认购、申购、赎回、</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>.....</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、</p>

<p>转换、定期定额投资计划、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；</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办理基金份额的发售、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认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《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>（24）基金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>二、基金托管人 （一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：陈颖</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：</p> <p>（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>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</p>	<p>定期定额投资计划、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；</p> <p>（19）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> <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>二、基金托管人 （一）基金托管人简况</p> <p>法定代表人：辛树人</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：</p> <p>（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 的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</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</p>
--	--

	<p>包括但不限于：</p> <p>(4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> <p>(9) 发起资金提供方使用发起资金认购本基金基金份额的金额不少于 1000 万元，且持有认购的基金份额的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>包括但不限于：</p> <p>(4) 交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) 发起资金提供方使用发起资金认购万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金份额的金额不少于 1000 万元，且持有认购的基金份额的期限自《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》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>第八部分 基金份额持有人大会</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每一基金份额拥有平等的投票权。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。 本基金份额持有人大会暂不设日常机构。</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每一基金份额拥有平等的投票权。 鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金基金份额参加或者委派代表参加目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，本基金基金份额持有人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 基金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。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。 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</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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：</p> <p>2、在不违反法律法规规定和《基金合同》约定，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>（5）基金管理人、基金登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、定期定额投资计划、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押、收益分配等业务规则；</p> <p>（8）本基金变更为同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金并相应修改《基金合同》；</p>	<p>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的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的基金份额持有人大会的，由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的基金份额持有人大会。</p> <p>本基金份额持有人大会暂不设日常机构。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。</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，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：</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基金份额持有人大会：</p> <p>2、在不违反法律法规规定和《基金合同》约定，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>（5）基金管理人、基金登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、定期定额投资计划、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押、收益分配等业务规则；</p> <p>（8）由于目标ETF变更标的指数、变更交易方式、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略；</p>
--	--	--

<p>第十二部分 基金的投资</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的最小化。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债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）。</p> <p>.....</p> <p>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90%，投资于标的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票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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>三、投资策略</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债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）。</p> <p>.....</p> <p>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%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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>三、投资策略</p> <p>本基金为目标ETF的联接基金，以目标ETF作为其主要投资标的，方便投资人通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证），其中，投资于目标ETF的比例不低于基</p>
---------------------------	---	--

<p>资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于: (1) 法律法规的限制; (2) 标的指数成份股流动性严重不足; (3) 标的指数的成份股票长期停牌; (4) 标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并; (5) 标的指数成份股派发现金股息; (6) 指数成份股定期或临时调整; (7) 标的指数编制方法发生变化; (8) 其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。</p> <p>在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求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%。如因标的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>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风险,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。</p> <p>.....</p>	<p>金资产净值的 90%。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份股、债券、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债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。</p> <p>本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产在各类资产上的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下,本基金力争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 0.35%, 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>2、目标 ETF 投资策略</p> <p>本基金投资目标 ETF 的两种方式如下:</p> <p>(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。</p> <p>(2) 二级市场方式: 在二级市场进行目标 ETF 基金份额的交易。</p> <p>在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,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,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>本基金可以直接投资本基金标的指数的成份股及备选成份股,以更好地跟踪业绩比较基准。该部分股票资产投资原则上主要采用完全复制法,即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。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,</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 90%，投资于标的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>.....</p> <p>（10）本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>.....</p> <p>除上述（2）、（8）、（14）、（15）、（16）情形外，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及法律法规另有规定的除外。</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>本基金以“紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标，在投资中将不低于非现金基金资产的 80%的资产投资于标的指数成</p>	<p>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>.....</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>.....</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（1）、（2）、（8）、（13）、（14）、（15）情形外，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及法律法规另有规定的除外。</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>.....</p> <p>本基金以“通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标，投资于目标 ETF 的比例不低于基金</p>
--	---	--

<p>份股及备选成份股,且每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,因此选取“国证新能源车电池指数收益率\times95%+银行活期存款利率(税后)\times5%”作为业绩比较基准,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法律法规及监管要求(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的情形除外)、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,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。若基金标的指数发生变更(包括但不限于指数编制单位更名、指数更名等事项),基金业绩比较基准随之变更,基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据投资情况和市场惯例在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪国证新能源车电池指数,其风</p>	<p>资产净值的 90%,且每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,因此选取“国证新能源车电池指数收益率\times95%+银行活期存款利率(税后)\times5%”作为业绩比较基准,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法律法规及监管要求(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的情形除外)、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,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。若基金标的指数发生变更(包括但不限于指数编制单位更名、指数更名等事项),基金业绩比较基准随之变更,基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据投资情况和市场惯例在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为 ETF 联接基金,所跟踪的目标 ETF 为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p>
--	--

	<p>险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p> <p>.....</p>	<p>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,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</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,本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金,无需召开基金份额持有人大会;若届时本基金管理人已有跟踪该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删除关于目标 ETF 的表述部分,或变更标的指数,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;</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p> <p>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 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的,本基金在履行适当程序后,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>.....</p>
<p>第十三部分 基金的财产</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。</p> <p>.....</p>	<p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指基金拥有的目标 ETF 基金份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。</p> <p>.....</p>

<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>二、估值对象 基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值 ……</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净价进行估值;</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净价或推荐估值净价进行估值;</p> <p>(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;</p> <p>(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券, 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>(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券, 对存在活跃市场的情况下, 应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值; 对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下, 应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值; 对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下, 应采用估值技术确定其公允价值。</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>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股, 按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值; 该日无交易的, 以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票和债券, 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>二、估值对象 基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>四、估值方法</p> <p>1、目标 ETF 估值方法 对持有的目标 ETF 基金, 按估值日目标 ETF 基金的份额净值估值。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。</p> <p>2、证券交易所上市的有价证券的估值 ……</p> <p>(2) 交易所已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种, 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进行估值;</p> <p>(3) 交易所已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种, 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进行估值;</p> <p>(4) 交易所已上市或已挂牌转让的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进行估值, 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>(5) 交易所上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券, 实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价; 实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价;</p> <p>(6) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值;</p> <p>(7) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收</p>
----------------------------	--	--

<p>(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</p> <p>5、期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>6、本基金投资股票期权合约，按照相关法律法规和监管部门的规定估值。</p> <p>.....</p>	<p>益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</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>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>（3）首次公开发行未上市的债券，采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值；</p> <p>（4）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>4、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照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估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照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估值。对于含投资人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估值，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。对银行间市场未上市且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</p> <p>5、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其他可</p>
--	--

	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>十、特殊情况的处理 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>	<p>靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。</p> <p>6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</p> <p>7、期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>8、本基金投资股票期权合约，按照相关法律法规和监管部门的规定估值。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>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；</p> <p>十、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 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>第十五部分 基金费用与税收</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>10、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、申赎费用等）；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分（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： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费</p>

	<p>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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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</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 下列费用不列入基金费用：</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用； 4、标的指数许可使用费，本基金标的指数许可使用费由基金管理人承担；</p>	<p>E为前一日的基金资产净值扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取0）</p> <p>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扣除前一日基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分（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： $H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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基金财产中目标ETF基金份额所对应资产净值后剩余部分（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 下列费用不列入基金费用：</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用根据《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行；</p>
<p>第十七部分 基金的会计与审计</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>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；</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；</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 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、基金份额发售公告</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</p>

	<p>.....</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。</p> <p>.....</p> <p>5、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。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,将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在规定报刊上,将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上,其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点;基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。</p> <p>(二) 《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规定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>(三) 基金净值信息 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>.....</p> <p>(六) 临时报告</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集;</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。</p> <p>.....</p> <p>(二) 基金净值信息 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>.....</p> <p>(五) 临时报告</p> <p>25、本基金变更目标 ETF;</p> <p>(十四)基金投资目标 ETF 的相关公告</p>
--	---	--

		<p>本基金在定期报告和招募说明书（更新）中应设立专门章节披露所持目标ETF的相关情况并揭示相关风险：</p> <p>1、投资政策、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，在招募说明书（更新）中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>.....</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》的终止事由有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：</p> <p>.....</p> <p>3、未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（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的情形除外）、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>4、《基金合同》生效之日起3年后的年度对应日，若基金资产净值低于2亿元的，《基金合同》自动终止；</p> <p>.....</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>.....</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。</p> <p>.....</p>	<p>二、《基金合同》的终止事由有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：</p> <p>.....</p> <p>3、未来若出现标的指数不符合法律法规及监管要求（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的情形除外）、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，但基金合同另有约定除外；</p> <p>4、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起3年后的年度对应日，若基金资产净值低于2亿元的，《基金合同》自动终止；</p> <p>.....</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>.....</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持基金、证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。</p> <p>.....</p>
第二十二部分 基金合	<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盖章并在募集结束</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盖章，于2026年2</p>

同的效力	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。	月 13 日生效,原《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》失效。
------	--	--

二、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金托管协议》修订对照表

章节	原托管协议表述	修订后托管协议表述
全文	万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金	万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
(前言)	鉴于万家基金管理有限公司系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,拟募集发行万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金;	鉴于万家基金管理有限公司系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,拟将万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金变更为万家国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金;
一、基金托管协议当事人	(二) 基金托管人 法定代表人: 陈颖 经营范围:吸收人民币存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算、票据贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券;同业拆借;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保险箱服务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇款;外币兑换;国际结算;同业外汇拆借;外汇票据的承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;结汇、售汇;发行和代理发行股票以外的外币有价证券;买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券;自营外汇买卖;代客外汇买卖;资信调查、咨询、见证业务。	(二) 基金托管人 法定代表人: 辛树人
二、基金托管协议的依据、目的、原则和解释	(一) 订立托管协议的依据 根据《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》、《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	(一) 订立托管协议的依据 根据《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》、《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

	<p>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》、《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关规定订立本托管协议。</p>	<p>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 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》、《万家国证新能源车电池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》（以下简称“基金合同”）、《商业银行托管业务监督管理办法（试行）》及其他有关规定订立本托管协议。</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）……</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债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）。</p> <p>……</p> <p>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 90%，投资于标的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票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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>本基金的投资组合遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数</p>	<p>（一）……</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债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）。</p> <p>……</p> <p>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%；本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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>本基金的投资组合遵循以下限制：</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>……</p>

	<p>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>(10)本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>除上述（2）、（8）、（14）、（15）、（16）情形外，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及法律法规另有规定的除外。</p> <p>.....</p> <p>(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。(如有)</p> <p>基金管理人应对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，应及时通知基金托管人，新名单自基金托管人确认后生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人确认，双方共同协商解决。如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人，经提醒后基金管理人仍未改正的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。</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（1）、（2）、（8）、（13）、（14）、（15）情形外，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及法律法规另有规定的除外。</p> <p>(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。（如有）</p> <p>基金管理人应对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，应及时通知基金托管人，新名单自基金托管人确认后生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人确认，双方共同协商解决。如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人，经提醒后基金管理人仍未改正的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。如基金管理人在基金首次投资银行间债券市场之前仍未向基金托管人提供银行间债券市场交易对手名单</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,对基金管理人选择存款银行进行监督。 基金投资银行存款的,基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定,确定符合条件的所有存款银行的名单,并在基金投资存款之前及时提供给基金托管人,基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督,如基金管理人未按要求提供存款银行名单,导致基金托管人无法有效履行监督职责,由此造成的损失和责任均由基金管理人承担。</p> <p>(六)基金托管人对基金投资流通受限证券的监督(如有)</p> <p>2、流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p>	<p>的,视为基金管理人认可全市场交易对手。</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,对基金管理人选择存款银行进行监督。 基金投资银行存款的,基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定,确定符合条件的所有存款银行的名单,并在基金投资存款之前及时提供给基金托管人,基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督,如基金管理人未按要求提供存款银行名单,导致基金托管人无法有效履行监督职责,由此造成的损失和责任均由基金管理人承担。如基金管理人在基金首次投资银行存款之前仍未向基金托管人提供存款名单的,视为基金管理人认可所有银行。</p> <p>(六)基金托管人对基金投资流通受限证券的监督(如有)</p> <p>2、流通受限证券,包括由《上市公司证券发行注册管理办法》规范的在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。</p> <p>(十)基金托管人发现托管产品违反法律法规或合同约定进行投资的,应当拒绝执行;按照交易程序已经达成交易的或无法拒绝执行的,应当及时提示基金管理人等相关方。</p>
<p>五、基金财产的保管</p>	<p>(一)基金财产保管的原则</p> <p>6、对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、申购过程中产生的应收资产,如基金托管人无法从公开信息或基金管理人提供的书面资料中获取到账日期信息的,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托</p>	<p>(一)基金财产保管的原则</p> <p>6、对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产,如基金托管人无法从公开信息或基金管理人提供的书面资料中获取到账日期信息的,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托</p>

<p>管人,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知并配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对此不承担任何责任。</p> <p>.....</p> <p>(二)基金募集期间及募集资金的验资</p> <p>1、基金募集期间募集的资金应存于基金管理人开设的基金募集专户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折算为基金份额,归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以登记机构的记录为准。</p> <p>2、基金募集期满或基金提前结束募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金银行账户,基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件,基金管理人在规定时间内,聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资,出具验资报告,验资报告中需对基金募集的资金进行确认,并对发起资金的持有人及其持有份额进行专门说明。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。</p> <p>3、若基金募集期限届满,未能达到基金备案条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜,基金托管人应提供充分协助。</p> <p>(三)基金银行账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过本基金的银行账户进行。</p>	<p>管人,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知并配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对此不承担任何责任。</p> <p>.....</p> <p>(二)基金银行账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>2、基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户,基金银行账户的账户名称原则上应当包含开户主体和产品名称字样,具体以实际开立账户为准。并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴根据托管人有关要求执行,由基金托管人保管和使用。</p>
--	---

	<p>.....</p> <p>(四)基金证券交收账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户，账户名称以实际开立为准。</p> <p>.....</p> <p>3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。</p> <p>.....</p> <p>(七)基金财产投资的有关有价凭证等的保管</p> <p>基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有，其中实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间因基金托管人未尽保管责任导致的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券及其他基金财产不承担保管责任。</p>	<p>本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。</p> <p>.....</p> <p>(三)基金证券交收账户和结算备付金账户的开立和管理</p> <p>1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司为基金开立基金托管人与本基金联名的证券账户，账户名称以实际开立为准。</p> <p>.....</p> <p>3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。</p> <p>.....</p> <p>(六)基金财产投资的有关有价凭证等的保管</p> <p>基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有，其中实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间因基金托管人未尽保管责任导致的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券及其他基金财产不承担保管责任。基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴应至少预留一枚基金托管人指定印章。对于任何的定期存款投资，基金管理人都应与存款机构签订定期存款协议，约</p>
--	--	---

		<p>定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书。本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户，不得划入其他任何账户。”如存款协议中未体现前述条款，基金托管人有权拒绝存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，基金托管人保管证实书正本。基金托管人取得存款证实书原件后，仅负责对存款证实书原件进行保管，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全。存款行对所开立的存款证实书的真实性负责。</p>
<p>六、指令的发送、确认及执行</p>	<p>……</p> <p>电子指令包括基金管理人发送的电子指令(采用深证通金融数据交换平台发送的电子指令、通过托管网银发送的电子指令)、自动产生的电子指令(托管业务系统通过预先设定的业务规则自动产生的电子指令)。电子指令一经发出即被视为合法有效指令。基金管理人通过深证通金融数据交换平台和托管网银发送的电子指令,基金托管人根据 User ID 唯一识别基金管理人身份,基金管理人应妥善保管 User ID,基金托管人身份识别后对于执行该电子指令造成的任何损失基金托管人不承担责任。</p> <p>(一)基金管理人纸质指令发送人员的书面授权</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、基金管理人应指定专人向基金托管人发送指令。 2、基金管理人应向基金托管人提供书面授权文件,内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签章样本,授权文件应注明被授权人相应的权限。 3、基金托管人在收到授权文件原件并向基金管理人电话确认后,授权文件即生效。如果授权文件中载明具体生效时间的,该生效时间不得早于基金托管人收到授权文件并经电话确认的时点,如早于,则以基金托管人收到授权文件并 	<p>……</p> <p>电子指令包括基金管理人发送的电子指令(采用深证通金融数据交换平台发送的电子指令、通过托管网银发送的电子指令)、自动产生的电子指令(托管业务系统通过预先设定的业务规则自动产生的电子指令)。电子指令一经发出即被视为合法有效指令。基金管理人通过深证通金融数据交换平台和托管网银发送的电子指令,基金托管人根据 User ID 唯一识别基金管理人身份,基金管理人应妥善保管 User ID,基金托管人身份识别后对于执行该电子指令造成的任何损失基金托管人不承担责任。管理人、托管人双方应遵守电子直连协议的具体操作要求。若管理人已与托管人建立深证通指令直连或其他以电子形式发送的指令,管理人应优先以电子指令形式向托管人发送指令,以传真或电子邮件作为应急方式备用。若管理人未与托管人建立深证通指令直连或其他电子形式的,指令由管理人用传真方式或电子邮件或其他托管人和管理人认可的纸质指令方式向托管人发送。</p> <p>纸质指令包括管理人以传真、电子邮件发送扫描件或者纸质原件形式向托管人发送的指令。</p>

	<p>经电话确认的时点为授权文件的生效时间。</p> <p>……</p> <p>(三)指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1、指令的发送</p> <p>基金管理人发送指令应采用电子指令或传真方式或其他基金管理人和基金托管人双方共同确认的方式。</p> <p>基金管理人应按照法律法规和基金合同的规定,在其合法的经营权限和交易权限内发送指令;被授权人应严格按照其授权权限发送指令。对于被授权人依约定程序发出的指令,基金管理人不得否认其效力。但如果基金管理人已经撤销或更改对交易指令发送人员的授权,并且基金托管人根据本协议确认后,则对于此后该交易指令发送人员无权发送的指令,或超权限发送的指令,基金管理人不承担责任,授权已更改但未通知基金托管人及未经基金托管人确认的情况除外。</p> <p>指令发出后,基金管理人应及时以电话方式向基金托管人确认。</p> <p>对于银行间同业市场债券交易,如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止,基金管理人应书面通知基金托管人。</p> <p>基金管理人应于划款前一日向基金托管人发送投资划款指令并电话确认,如需划款当日下达投资划款指令,在发送指令时,应为基金托管人留出执行指令所必需的时间,指令一般应在指定到账时点前2个工作小时发送(T+0 交收的指令发送截止时间为当日15:00),并进行电话确认。对于在上交所固定收益平台和在深交所综合协议交易平台交易的、实行“实时逐笔全额结算”和“T+0 逐笔全额非担保交收的业务,基金管理人应在交易日14:00前将划款指令发送至基金托管人,对于基金管理人在指令发送截止时点之后发送的指令,基金托管人不保证当日执行完毕并不承担责任。由于基金管理人</p>	<p>(一)基金管理人对于纸质指令发送人员的书面授权</p> <p>1、基金管理人应指定专人向基金托管人发送指令。</p> <p>2、基金管理人应向基金托管人提供书面授权文件,内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签章样本,授权文件应注明被授权人相应的权限。</p> <p>3、基金管理人发出授权通知后,有义务及时通知基金托管人,授权通知自其上面注明的启用日期开始生效。如果授权文件中载明具体生效时间的,该生效时间不得早于基金托管人收到授权文件的时点,如早于,则以基金托管人收到授权文件的时点为授权文件的生效时间。基金管理人应在此后三个工作日内将授权通知的正本送交基金托管人。基金托管人收到的授权通知传真件、扫描件与原件不一致的,以传真件、扫描件为准。逾期未交付原件,亦以传真件或扫描件的内容为准。</p> <p>……</p> <p>(三)指令的发送、确认及执行的程序和程序</p> <p>1、指令的发送</p> <p>基金管理人发送指令应采用电子指令或传真方式或电子邮件或其他基金管理人和基金托管人双方共同确认的方式。</p> <p>基金管理人应按照法律法规和基金合同的规定,在其合法的经营权限和交易权限内发送指令;被授权人应严格按照其授权权限发送指令。对于被授权人依约定程序发出的指令,基金管理人不得否认其效力。</p> <p>对于银行间同业市场债券交易,如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止,基金管理人应书面通知基金托管人。</p> <p>基金管理人应于划款前一日向基金托管人发送投资划款指令并有义务及时电话通知,如需划款当日下达投资划款指令,在发送指令时,应为基金托管人留出执行指令所必需的时间,指令</p>
--	--	--

	<p>的原因造成指令传输不及时、未能留出足够的划款时间,致使资金未能及时到账所造成的损失不由基金托管人承担。</p> <p>2、指令的确认</p> <p>基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令,预先通知基金管理人其名单,并与基金管理人商定指令发送和接收方式。指令到达基金托管人后,基金托管人应指定专人立即审慎验证有关内容,纸质指令还需验证印鉴和签名,如有疑问必须及时通知基金管理人。基金托管人对划款指令仅进行形式审核。</p> <p>.....</p> <p>(五)基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>若基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当视情况暂缓或拒绝执行,立即通知基金管理人,并在托管人执行原指令之前送达托管人。</p> <p>若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人。</p> <p>.....</p>	<p>一般应在指定到账时点前 2 个工作小时发送 (T+0 交收的指令发送截止时间为当日 15:00)。对于在上交所固定收益平台和在深交所综合协议交易平台交易的、实行“实时逐笔全额结算”和“T+0 逐笔全额非担保交收的业务,基金管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至基金托管人,对于基金管理人在指令发送截止时点之后发送的指令,基金托管人不保证当日执行完毕并不承担责任。由于基金管理人的原因造成指令传输不及时、未能留出足够的划款时间,致使资金未能及时到账所造成的损失不由基金托管人承担。本基金财产运用和处分过程中产生的银行汇划费和其它手续费,按实际发生额从本计划财产中直接扣除,无须管理人向托管人发出划款指令。</p> <p>2、指令的确认</p> <p>基金托管人应指定专用邮箱接收基金管理人的指令,预先通知基金管理人其联系方式,并与基金管理人商定指令发送和接收方式。指令到达基金托管人后,基金托管人应指定专人及时审慎验证有关内容,纸质指令还需验证印鉴和签名,如有疑问必须及时通知基金管理人。基金托管人对划款指令仅进行形式审核。</p> <p>.....</p> <p>(五)基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>若基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当视情况暂缓或拒绝执行,及时通知基金管理人,并在托管人执行原指令之前送达托管人。</p> <p>若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人。</p> <p>.....</p>
--	--	---

	<p>(七) 更换被授权人员的程序</p> <p>基金管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权,应当至少提前一个工作日通知基金托管人,同时基金管理人向基金托管人传真或通过电子邮件发送新的被授权人的姓名、权限、预留印鉴和签字样本,并及时通过电话确认,确保基金托管人收到后,授权文件即生效。基金管理人在此后三个工作日内将授权变更通知原件寄送至基金托管人,原件内容应与传真件或电子邮件发送的扫描件内容完全一致,若有不一致的,以传真件或扫描件为准。</p> <p>被授权人变更通知生效前,基金托管人仍应按原约定执行指令,基金管理人不得否认其效力。</p> <p>基金托管人更换接收基金管理人指令的人员,应至少提前一个工作日及时通知基金管理人。</p> <p>(八) 其他事项</p> <p>1、基金托管人在接收指令时,应对指令的要素是否齐全、印鉴与被授权人与预留的授权文件内容表面一致性进行检查,如发现问题,应及时报告基金管理人。</p> <p>如果基金管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权,并且已通知基金托管人并经基金托管人电话确认,则对于在变更通知的启用日期后该指令发送人员无权发送的指令,或超权限发送的指令,基金管理人不承担责任。</p> <p>2、基金托管人在履行监督责任后,对执行基金管理人的合法指令对基金财产造成的损失不承担赔偿责任。</p>	<p>(七) 更换被授权人员的程序</p> <p>基金管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权,应当至少提前一个工作日通知基金托管人,同时基金管理人向基金托管人传真或通过电子邮件发送新的被授权人的姓名、权限、预留印鉴和签字样本,并及时通过电话确认,确保基金托管人收到后,授权文件即生效。如果授权文件中载明具体生效时间的,该生效时间不得早于基金托管人收到授权文件的时点,如早于,则以基金托管人收到授权文件的时点为授权文件的生效时间。基金管理人在此后三个工作日内将授权变更通知原件寄送至基金托管人,原件内容应与传真件或电子邮件发送的扫描件内容完全一致,若有不一致的,以传真件或扫描件为准。逾期未交付原件,亦以传真件或扫描件的内容为准。</p> <p>被授权人变更通知生效前,基金托管人仍应按原约定执行指令,基金管理人不得否认其效力。</p> <p>基金托管人更换接收基金管理人指令的指令邮箱,应至少提前一个工作日及时通知基金管理人。</p> <p>(八) 其他事项</p> <p>1、基金托管人在接收指令时,应对指令的要素是否齐全、印鉴与被授权人与预留的授权文件内容表面一致性进行检查,如发现问题,应及时报告基金管理人。</p> <p>2、基金托管人在履行监督责任后,对执行基金管理人的合法指令对基金财产造成的损失不承担赔偿责任。</p>
七、交易及清算	<p>.....</p> <p>(二)基金投资证券后的清算交收安排</p>	<p>.....</p> <p>(二) 基金投资证券后的清算交收安排</p>

<p>交收安排</p>	<p>基金管理人与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则, 签订《托管银行证券资金结算协议》和《证券交易资金前端风险控制协议》, 用以具体明确基金管理人与基金托管人在证券交易资金结算业务中的程序与责任。</p> <p>1、清算与交割</p> <p>根据《中国证券登记结算有限责任公司结算备付金管理办法》和《证券结算保证金管理办法》, 在每月前6个工作日内, 中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国证券登记结算公司”) 对结算参与人的最低结算备付金和结算保证金限额进行重新核算、调整。基金托管人在中国证券登记结算公司调整最低结算备付金和结算保证金当日, 在资金调节表中反映调整后的最低备付金和结算保证金。基金管理人应预留最低备付金和结算保证金, 并根据中国证券登记结算公司确定的实际最低备付金和结算保证金数据为依据安排资金运作, 调整所需的现金头寸。</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应采取合理措施, 确保在 T+1 日上午 10:00 前有足够的资金头寸, 用于当日中国证券登记结算公司上海分公司和深圳分公司的资金结算。</p> <p>.....</p> <p>(三)基金申购和赎回业务处理的基本规定</p> <p>.....</p> <p>7、对于基金申购过程中产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 到账日基金财产没有到达基金账户的, 基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收, 由此给基金造成损失的, 基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。</p>	<p>基金管理人与基金托管人应根据有关法律法规及相关业务规则, 签订《托管银行证券资金结算协议》和《证券交易资金前端风险控制协议》(具体名称以实际签署为准), 用以具体明确基金管理人与基金托管人在证券交易资金结算业务中的程序与责任。</p> <p>1、清算与交割</p> <p>根据中国证券登记结算有限责任公司发布的《结算备付金管理办法》和《证券结算保证金管理办法》, 在每月前6个工作日内, 中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国证券登记结算公司”) 对结算参与人的最低结算备付金和结算保证金限额进行重新核算、调整。基金托管人在中国证券登记结算公司调整最低结算备付金和结算保证金当日, 在资金调节表中反映调整后的最低备付金和结算保证金。基金管理人应预留最低备付金和结算保证金, 并根据中国证券登记结算公司确定的实际最低备付金和结算保证金数据为依据安排资金运作, 调整所需的现金头寸。</p> <p>.....</p> <p>基金管理人应采取合理措施, 确保在 T+1 日上午 10:00 前有足够的资金头寸, 用于当日中国证券登记结算公司的资金结算。</p> <p>.....</p> <p>(三)基金申购和赎回业务处理的基本规定</p> <p>.....</p> <p>7、对于基金申购过程中产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 基金管理人可开通网银查询或者咨询基金托管人资金是否到账, 到账日基金财产没有到达基金账户的, 基金管理人应及时采取措施进行催收, 由此给基金造成损失的, 基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。</p>
<p>八、基金资产净</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>	<p>(二)基金资产估值方法和特殊情形的处理</p>

<p>值 计 算 和 会 计 核 算</p>	<p>1、估值对象 基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>2、估值方法 (1) 证券交易所上市的有价证券的估值 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且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； 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净价进行估值； 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净价或推荐估值净价进行估值； 4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价； 5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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； 6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市</p>	<p>1、估值对象 基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、资产支持证券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>2、估值方法 (1) 目标 ETF 估值方法 对持有的目标 ETF 基金，按估值日目标 ETF 基金的份额净值估值。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。 (2) 证券交易所上市的有价证券的估值 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且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； 2) 交易所已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，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进行估值； 3) 交易所已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，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进行估值； 4) 交易所已上市或已挂牌转让的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进行估值，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>场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。</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>1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>2) 首次公开发行未上市的股票和债券,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>3) 在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,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。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。</p> <p>(4) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。</p> <p>(5) 期货合约以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。</p> <p>(6) 本基金投资股票期权合约,按照相关法律法规和监管部门的规定估值。</p>	<p>5) 交易所上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券,实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价;</p> <p>6) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值;</p> <p>7) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</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>1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>2) 首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值;</p> <p>3) 首次公开发行未上市的债券,采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值;</p> <p>4) 在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>(4) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照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估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照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估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,行使回</p>
--	--

	<p>(7) 本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>.....</p> <p>3、特殊情形的处理</p> <p>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，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。</p> <p>.....</p> <p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>.....</p> <p>(七)基金财务报表与报告的编制和复核</p>	<p>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估值，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。对银行间市场未上市且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</p> <p>(5) 对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。</p> <p>(6) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</p> <p>(7) 期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>(8) 本基金投资股票期权合约，按照相关法律法规和监管部门的规定估值。</p> <p>.....</p> <p>3、特殊情形的处理</p> <p>基金管理人或基金托管人按估值方法的第(11)项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。</p> <p>.....</p> <p>(四) 暂停估值的情形</p> <p>.....</p> <p>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；</p>
--	--	--

	<p>.....</p> <p>2、报表复核</p> <p>基金管理人在月度报表完成当日,将报表盖章后提供给基金托管人复核;基金托管人在收到后应在 3 个工作日内进行复核。基金管理人在季度报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核。基金管理人在中期报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 30 日内完成复核。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人应在收到后 45 日内完成复核。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。</p>	<p>.....</p> <p>(七) 基金财务报表与报告的编制和复核</p> <p>.....</p> <p>2、报表复核</p> <p>基金管理人在月度报表完成当日,将报表盖章后提供给基金托管人复核;基金托管人在收到后应在 3 个工作日内进行复核。基金管理人在季度报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核。基金管理人在中期报告完成当日,将有关报告提供给基金托管人复核,基金托管人应在收到后 30 日内完成复核。基金管理人在年度报告完成当日,将有关报告提供基金托管人复核,基金托管人应在收到后 45 日内完成复核。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或电子邮件或双方商定的其他方式进行。</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(包括年度报告、中期报告和季度报告)、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、实施侧袋机制期间的信息披露、清算报告、参与股指期货交易情况公告、参与国债期货交易情况公告、股票期权投资情况公告、资产支持证券投资情况公告、融资和转融通证券出借业务参与情况公告以及中国证监会规定的其他信息。本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>.....</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、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告(包括年度报告、中期报告和季度报告)、临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告、参与股指期货交易情况公告、参与国债期货交易情况公告、股票期权投资情况公告、资产支持证券投资情况公告、融资和转融通证券出借业务参与情况公告、基金投资目标 ETF 的相关公告、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。本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>.....</p>
十一、基金费用	<p>(一) 基金管理人的管理费</p>	<p>(一) 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 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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 </p> <p>(二) 基金托管人的托管费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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 </p> <p>(五)基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费/律师费/仲裁费/诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券/期货/期权交易费用、基金银行汇划费用、基金的开户费用/账户维护费用以及按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。</p> <p>(六) 不列入基金费用的项目 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用、标的指数许可使用费、《基金合同》生效前的相关费用和其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不</p>	<p>本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分(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： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ 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前一日基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0) </p> <p>(二) 基金托管人的托管费 本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分(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： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ 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基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0) </p> <p>(五) 基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费/律师费/仲裁费/诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券/期货/期权交易费用、基金银行汇划费用、基金的开户费用/账户维护费用、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、申赎费用等)以及按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入或摊入当期基金费用。</p> <p>(六) 不列入基金费用的项目 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生</p>
---	--

	得列入基金费用的项目,不得从基金财产中列支。	的费用、《基金合同》生效前的相关费用根据《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行和其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目,不得从基金财产中列支。
十五、禁止行为	……	…… (十一)基金托管人不承担以下职责: 1、承担托管产品财产的信用风险、市场风险等; 2、为托管产品提供直接或间接、显性或隐性担保,包括承诺本金或保证收益; 3、为托管产品垫付资金、提供流动性支持或融资承诺等; 4、参与投资者适当性管理; 5、保证投资项目及交易信息真实性; 6、保证托管产品资金来源的合法合规性; 7、对已划出托管账户以及处于商业银行实际控制之外的资产承担保管责任; 8、参与产品管理人对托管产品的投资决策; 9、违规代替产品管理人向其他机构或者个人进行托管产品信息披露或提供相关数据信息; 10、产品管理人未接受商业银行的复核意见进行信息披露产生的相应责任; 11、负责未兑付产品的资金追偿、财产保全、诉讼仲裁、债务重组和破产程序等,法律另有规定的除外; 12、因不可抗力,以及非本机构履职错误或过失造成的托管资产损失; 13、国务院金融监管部门规定的不属于商业银行托管业务范围的其他职责。
十六、托管协议的变更、终止与基金财	…… (三)基金财产的清算 5、基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。	…… (三)基金财产的清算 5、基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持基金、证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。

产的清算
十九、托管协议的效力	<p>双方对托管协议的效力约定如下：</p> <p>（一）基金管理人在向中国证监会申请基金募集注册时提交的托管协议草案，应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签名（章），协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会注册的文本为正式文本。</p> <p>（二）托管协议自基金合同成立之日起成立，自基金合同生效之日起生效。托管协议的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>	<p>双方对托管协议的效力约定如下：</p> <p>（一）托管协议应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签名（章）。</p> <p>（二）托管协议自基金合同成立之日起成立，自基金合同生效之日起生效。本托管协议生效之日起，原《万家国证新能源车电池指数型发起式证券投资基金托管协议》失效。托管协议的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>