西藏东财基金管理有限公司关于西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金转型为西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、降低管理费率和托管费率并修改基金合同及托管协议的公告

西藏东财基金管理有限公司(以下简称“本公司”或“基金管理人”)旗下的西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金(基金简称“东财沪港深互联网指数”或“本基金”)于2021年4月27日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可[2021]1553号)，《西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于2021年6月1日正式生效。为了更好满足广大投资者的需求，本公司根据《基金合同》的约定，经与基金托管人广发证券股份有限公司协商一致，决定于2025年6月20日起，将东财沪港深互联网指数转型为西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、降低管理费率和托管费率，并相应修改《基金合同》等法律文件的相关条款。现将具体事宜公告如下：

一、本基金转型为西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本公司旗下的西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金于2023年8月17日获得中国证监会准予注册的批复(证监许可[2023]1824号)，并获得中国证监会证券基金机构监管部关于同意延期募集备案的回函(机构司函[2025]719号)，于2025年6月18日正式成立，与本基金使用同一标的指数。根据《基金合同》第八部分“基金份额持有人大会”第一条“一、召开事由”第2款“在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会”中约定：“若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)，则基金管理人有权决定本基金是否采取ETF联接基金模式运作并相应修改《基金合同》，如决定以ETF联接基金模式运作，则届时无需召开基金份额持有人大会，但须报中国证监会备案并提前公告。本公司决定于2025年6月20日起，将东财沪港深互联网指数转型为西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(基金简称“东财中证沪港深互联网ETF发起式联接”，A类基金份额代码：012371，C类基金份额代码：012372；E类基金份额代码：021358)。

届时，东财沪港深互联网指数的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“东财沪港深互联网指数A类基金份额”变更为“东财中证沪港深互联网ETF发起式联接A类基金份额”，将“东财沪港深互联网指数C类基金份额”变更为“东财中证沪港深互联网ETF发起式联接C类基金份额”，将“东财沪港深互联网指数E类基金份额”变更为“东财中证沪港深互联网ETF发起式联接E类基金份额”。前述变更不影响各类基金份额净值的计算。

基金转型后，各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费优惠活动保持不变，且《基金合同》关于发起式基金提供方及发起资金认购份额的规定继续有效。

二、降低管理费率和托管费率

根据《基金合同》的约定，东财沪港深互联网指数的管理费约定为“本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提”，托管费约定为“本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提”。

经调整后，西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的管理费约定为“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前一日所持有目标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”，托管费约定为“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前一日所持有目标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0.05%的年费率计提”。

三、重要提示：

1.本次修改内容为因转型为联接基金、降低管理费率和托管费率而对法律文件进行修改，同时因基金实际运作、基金管理人和基金托管人信息更新对法律文件进行修改。上述事项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一致后修改。(《基金合同》的具体修改内容详见附件。

2.修改后的《西藏东财中证沪港深互联网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》、《西藏东财中证沪港深互联网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》、《西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》自2025年6月20日起生效，原《西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》、《西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金托管协议》、《西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金招募说明书》于当日失效。

3.投资者可登录本公司网站(www.dongcaijijin.com)查阅修改后的法律文件，或拨打客户服务电话(400-9210-107)获取相关信息。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件和信息披露文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

特此公告。

西藏东财基金管理有限公司

2025年6月19日

附件：《西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》与《西藏东财中证沪港深互联网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》对照表

所在部份	西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金合同	西藏东财中证沪港深互联网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
全文	西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金	西藏东财中证沪港深互联网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	三、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金合同(以下简称“《基金合同》”)是为了规范基金运作，保护基金当事人的权益，根据《中华人民共国证券投资基金法》(以下简称“《证券投资基金法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露管理办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售管理办法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作管理办法》”)、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——定期报告》(以下简称“《XBRL模板第3号》”)、《证券投资基金信息披露XBRL模板第5号——基金合同》(以下简称“《XBRL模板第5号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号——招募说明书的内容与格式》(以下简称“《招募说明书内容与格式准则》”)、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——基金合同的内容与格式》(以下简称“《基金合同内容与格式准则》”)、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号——托管协议的内容与格式》(以下简称“《托管协议内容与格式准则》”)、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号——招募说明书的更新部分的内容与格式》(以下简称“《招募说明书更新内容与格式准则》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第6号——基金份额净值》(以下简称“《XBRL模板第6号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第7号——基金份额发售公告》(以下简称“《XBRL模板第7号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第8号——基金份额发售结果公告》(以下简称“《XBRL模板第8号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第9号——基金份额变动公告》(以下简称“《XBRL模板第9号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第10号——基金份额持有人大会决议公告》(以下简称“《XBRL模板第10号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第11号——基金份额拆分与折算公告》(以下简称“《XBRL模板第11号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第12号——基金份额持有人大会代表决定公告》(以下简称“《XBRL模板第12号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第13号——基金份额登记业务信息》(以下简称“《XBRL模板第13号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第14号——基金份额持有人大会决议公告》(以下简称“《XBRL模板第14号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第15号——基金份额持有人大会代表决定公告》(以下简称“《XBRL模板第15号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第16号——基金份额变动公告》(以下简称“《XBRL模板第16号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第17号——基金份额发售公告》(以下简称“《XBRL模板第17号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第18号——基金份额发售结果公告》(以下简称“《XBRL模板第18号》”)、《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第19号——基金份额拆分与折算公告》(以下简称“《XBRL模板第19号》”)等有关法律、法规、其他有关规定及中国证监会不时颁布的有关规定(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	三、本基金由西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金转型而来。西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《信息披露管理办法》、《销售管理办法》、《运作管理办法》、《XBRL模板第3号》、《XBRL模板第5号》、《XBRL模板第6号》、《XBRL模板第7号》、《XBRL模板第8号》、《XBRL模板第9号》、《XBRL模板第10号》、《XBRL模板第11号》、《XBRL模板第12号》、《XBRL模板第13号》、《XBRL模板第14号》、《XBRL模板第15号》、《XBRL模板第16号》、《XBRL模板第17号》、《XBRL模板第18号》、《XBRL模板第19号》等有关法律、法规、其他有关规定及中国证监会不时颁布的有关规定(以下简称“中国证监会”)注册。 中国证监会对西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金合同的注册，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。
第一部分 前言	四、本基金在募集过程中(指本基金募集完成进行验资时)及成立运作后，单一投资者持有的基金份额占本基金总份额的比例不得达到或超过50%(运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外)，基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额达到或超过基金总份额50%的，不受此限制。	四、本基金在募集过程中(指本基金募集完成进行验资时)及成立运作后，单一投资者持有的基金份额占本基金总份额的比例不得达到或超过50%(运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外)，基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资认购的基金份额达到或超过基金总份额50%的，不受此限制。
第二部分 释义	1.基金或本基金：指西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金	1.基金或本基金：指西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，本基金由西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金转型而来
第二部分 释义	10.基金份额发售公告：指《西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》	17.联接基金：指将绝大多数基金财产投资于目标ETF，与目标ETF的投资目标和类似，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用契约型开放式运作方式的基金 18.目标ETF：指另一只获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该ETF”)，该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金选择西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF 19.标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的中证沪港深互联网指数及其未来可能发生的变更
第二部分 释义	26.基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务	28.基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金、办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
第二部分 释义	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认购、申购、赎回、转换、转托管等交易引起份额变动等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户	33.基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
第二部分 释义	32.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	34.基金合同生效日：指西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
第二部分 释义	34.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	
第二部分 释义	35.存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限	36.存续期：指《西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金合同》生效至《西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》终止之间的不定期期限
第二部分 释义	43.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	
第二部分 释义	52.基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、期货合约、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和	52.基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、目标ETF份额、期货合约、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
第二部分 释义	56.基金份额类别：指根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值 57.A类基金份额：指在投资者认购/申购时收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 58.C类基金份额：指在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额	56.基金份额类别：指根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值 57.A类基金份额：指在投资者申购时收取申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 58.C类基金份额：指在投资者申购时不收取申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
第二部分 释义	62.发起资金：指用于认购/发起式基金且来源于基金管理人股东资金、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1000万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年 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	62.发起资金：指用于认购西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金的基金管理人固有资金 63.发起资金提供方：指以发起资金认购西藏东财中证沪港深互联网指数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
第三部分 基金的基本情况	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
第三部分 基金的基本情况	四、基金的投资目标 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的最小化，力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。	四、基金的投资目标 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。
第三部分 基金的基本情况	六、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为1000万份，最低募集金额为1000万元人民币，其中发起资金提供方认购基金的金额不少于1000万元人民币。 发起资金提供方承诺将发起资金认购的基金份额的期限为自基金合同生效日起不少于3年。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(基金合同生效不满三年提前终止的情况除外)。 本基金发起资金的认购情况以基金管理人届时发布的公告。 七、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。 本基金A类基金份额的具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。C类基金份额不收取认购费。	六、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为1000万份，最低募集金额为1000万元人民币，其中发起资金提供方认购基金的金额不少于1000万元人民币。 发起资金提供方承诺将发起资金认购的基金份额的期限为自基金合同生效日起不少于3年。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(基金合同生效不满三年提前终止的情况除外)。 本基金发起资金的认购情况以基金管理人届时发布的公告。 七、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。 本基金A类基金份额的具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。C类基金份额不收取认购费。
第三部分 基金的基本情况	八、基金存续期限 不定期 基金合同生效之日起三年后的对应日(该对应日如为非工作日，则自动顺延至下一个工作日)，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，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期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。	六、基金存续期限 不定期 基金合同生效日起三年后的对应日(该对应日如为非工作日，则自动顺延至下一个工作日)，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，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期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。
第三部分 基金的基本情况	九、基金份额的类别 本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费，称为A类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费，称为C类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费，称为E类基金份额。 本基金A类、C类和E类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类、C类和E类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值=该计算日该类别基金份额的基金资产净值/该计算日该类别基金份额余额总数。 投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。 有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在《招募说明书》中公告。根据基金销售和实际运作情况，基金管理人在不违反法律法规、《基金合同》以及不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，可以增加、减少或调整基金份额类别、调整现有基金份额类别的设置规则和分类方法，或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金份额类别的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式，或者停止基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人需履行适当程序并及时公告。	七、基金份额的类别 本基金根据申购费用、销售服务费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费，称为C类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费，称为E类基金份额。 本基金A类、C类和E类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类、C类和E类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值=该计算日该类别基金份额的基金资产净值/该计算日该类别基金份额余额总数。 投资人可自行选择申购的基金份额类别。 有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在《招募说明书》中公告。根据基金销售和实际运作情况，基金管理人在不违反法律法规、《基金合同》以及不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，可以增加、减少或调整基金份额类别、调整现有基金份额类别的设置规则和分类方法，或者在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金份额类别的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式，或者停止基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人需履行适当程序并及时公告。
第四部分 基金的历史沿革与存续	八、本基金与目标ETF的联系与区别 本基金与目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别： 1.在投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 2.在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购赎回单位和申购赎回清单的要求，申赎目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。 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： 1.法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，本基金每个交易日持在相除股指期货合约指缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 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变动的影响较小；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。	八、本基金与目标ETF的联系与区别 本基金与目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别： 1.在投资方法方面，目标ETF主要采取完全复制法，直接投资于标的指数成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。 2.在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购赎回单位和申购赎回清单的要求，申赎目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，通过基金管理人及销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回。 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： 1.法律法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，本基金每个交易日持在相除股指期货合约指缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
第五部分 基金份额的申购与赎回	第四部分 基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 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。 2.发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。 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、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会另有规定可参与证券投资基金的其他投资人。 二、基金份额的认购 1.认购费用 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。本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。 2.基金份额的计算公式 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位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。 5.认购申请的确认 基金销售机构对认购申请的受理并代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确未接收到认购申请。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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。 三、基金份额认购金额的限制 1.投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。 2.基金管理人可以对每个基金账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参招募说明书相关公告。 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及所持基金份额比例进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4.投资人在募集期内可以多次认购基金份额，本基金份额的认购费用按照单笔认购金额分别计算。认购申请一经受理不得撤销。 5.如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人有权拒绝该投资人的全部或部分认购申请。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。基金管理人使用固有资金、公司高级管理人员或基金经理等人员出资认购的基金份额达到或超过基金总份额50%的，不受上述限制。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。 四、发起资金的认购 本基金发起资金认购的金额不少于1000万元人民币，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(基金合同生效不满三年提前终止的情况除外)。 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。 第五部分 基金备案 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，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，基金备案期满满足基金备案条件，基金管理人应根据法律法规及招募说明书的规定安排上报基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，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。 基金备案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信息进行公告。基金管理人应将基金备案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，基金管理人应当采取下列责任： 1.以其固有财产承担因募集行为而产生的费用和费用； 2.在基金募集期限届满后30天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、基金托管人及销售机构为投资人的利益而产生的费用，由基金管理人、基金托管人和