

# 关于华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝 中证消费龙头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”)旗下的华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)经中国证券监督管理委员会《关于准予华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)注册的批复》(证监许可【2019】654号)注册募集,《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于2019年12月19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:“一、召开事由……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》;……。”

本公司旗下华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金(场内简称:消费龙头ETF,基金代码:516130)已于2021年9月28日成立,并于2021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中国民生银行股份有限公司协商一致,决定于2026年3月27日起,将华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),降低本基金的管理费、增加侧袋机制,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

华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头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》、《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)托管协议》和《华宝中

证消费龙头指数证券投资基金(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“华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)A类基金份额”变更为“华宝中证消费龙头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”,基金简称“消费龙头LOF”不变;“华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)C类基金份额”变更为“华宝中证消费龙头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”,基金简称由“华宝消费龙头C”变更为“华宝中证消费龙头ETF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调整

- 1、基金管理费率由0.75%/年降低至0.50%/年。
- 2、基金托管费率不变。

三、根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》《证券投资基金侧袋机制操作细则(试行)》的有关规定,增加侧袋机制并修订基金合同和托管协议等法律文件的相关条款。

四、修订后的《华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》、《华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)托管协议》和《华宝中证消费龙头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2026年3月27日起生效。

## 五、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、《华宝中证消费龙头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、本公告仅对华宝中证消费龙头指数证券投资基金(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](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3月25日

附件：《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(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	<del>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同</del>	<u>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同(由华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更而来)</u>
全文	<del>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</del>	<u>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)</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、<del>本基金</del>由基金管理人依照《基金法》、<del>基金合同</del>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》”)、《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》”)、<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>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)</u>(以下简称“<u>本基金</u>”)由华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更而来，<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</u>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</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>会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</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<u>主要投资于目标ETF</u>，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>七、<u>当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。</u></p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1、基金或本基金：指<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</u></p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</u>基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</u>托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</u>招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</u>基金产品</p>	<p>1、基金或本基金：指<u>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)</u>，由<u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)</u>变更而来</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《<u>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)</u>基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《<u>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)</u>托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《<u>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)</u>招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《<u>华宝中证消费龙头交</u></p>

<p>资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行）</p> <p>8、<del>基金份额发售公告：指《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》</del></p> <p>9、<del>上市交易公告书：指《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》</del></p> <p>27、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>41、<del>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>43、<del>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</del></p> <p>44、<del>存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</del></p> <p>51、<del>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</del></p> <p>54、<del>上市交易：指基金合同生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为</del></p> <p>62、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</p>	<p><u>易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新</u></p> <p>27、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、定期定额投资及交易等业务</p> <p>41、<u>基金合同生效日：指《华宝中证消费龙头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《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效</u></p> <p>43、<u>存续期：指《华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效至终止之间的不定期期限</u></p> <p>52、<u>上市交易：指《华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》生效后投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为</u></p> <p>60、<u>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</u></p> <p>61、<u>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</u></p> <p>新增：</p>
--	--

	<p>约</p> <p>63、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><u>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。本基金以华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF</u></p> <p><u>16、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</u></p> <p><u>71、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</u></p>
<p>第三部分基金的基本情况</p>	<p>二、基金的类别</p> <p>股票型证券投资基金</p> <p>六、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0.35%，年化跟踪误差不超过4%。</p> <p>七、基金的最低募集份额总额</p> <p>本基金的最低募集份额总额为2亿份。</p>	<p>二、基金的类别</p> <p><u>ETF 联接基金</u></p> <p>六、基金的投资目标</p> <p><u>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。</u></p>

八、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。

本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。

新增：

九、目标ETF

华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金。

十、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：

(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。

(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。

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，每个交易日日终在扣

		<p>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。</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><del>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。</del></p> <p><del>2、发售方式</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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</del></p>	<p><u>第四部分 基金的历史沿革</u></p> <p><u>华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)由华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更而来。</u></p> <p><u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)经中国证监会《关于准予华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)注册的批复》（证监许可【2019】654号）注册募集。基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2019年12月19日正式生效。</u></p> <p><u>2021年9月28日，基金管理人管理的华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金成立。根据《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(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”。</u></p> <p><u>基金管理人经与基金托管人协商一致后，决</u></p>

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。~~

## 三、~~基金份额认购金额的限制~~

### 1、~~投资者认购时，需按销售机构规~~

定将华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)，并据此修订《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同》。自2026年3月9日起，《华宝中证消费龙头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《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同》同日起失效。

	<p>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> <p>5、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数超过基金总份额的50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。</p>	
<p>第五部分 基金的 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，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。</del></p> <p><del>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</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>《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同》生效后，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</u></p>

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

基金合同生效后,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。

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>第六部分 基金份额的上市交易</p>	<p>一、上市交易的基金份额</p> <p>《基金合同》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>二、上市交易的地点</p> <p>上海证券交易所。</p> <p>三、上市交易的时间</p> <p><del>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。</del></p> <p><del>在确定上市交易的时间后，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。</del></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> <p><del>1、募集金额不少于2亿元人民币；</del></p> <p><del>2、基金份额持有人不少于1000人；</del></p> <p><del>3、上海证券交易所规定的其他条件。</del></p>	<p>一、上市交易的基金份额</p> <p><u>华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)A类基金份额于2020年1月6日起在上海证券交易所上市交易。自华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)于2026年3月27日起正式变更为华宝中证消费龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)后，本基金A类基金份额继续上市交易。</u></p>
<p>第七部分 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>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>遇交易所或交易市场数据传输延迟、</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>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>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</p>

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，则赎回款项的划付相应顺延至该因素消除后的下一工作日。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

~~8、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。~~

发生上述第1、2、3、5、6、7、~~10~~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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资者。发生上述第~~8~~项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。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。

收、交易所或登记机构的交易结算规则发生重大变化、本基金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，则赎回款项的划付相应顺延至该因素消除后的下一工作日。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

8、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。

9、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。

发生上述第1、2、3、5、6、7、8、9、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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资者。发生上述第10项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。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。

增加：

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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。

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。

十八、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

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：<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认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；</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><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) 缴纳基金认购、申购款项及法律</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申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；</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>三、基金份额持有人</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</p>
---	--

	<p>法规和《基金合同》所规定的费用；</p>	<p>合同》所规定的费用；</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>第九部分 基金份额持有人大会</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</u></p>

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。

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。

#### 一、召开事由

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、中国证监会或基金合同另有规定的除外：

(14) 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；

#### 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金

		<p><u>份额的二分之一（含二分之一）；</u></p> <p><u>3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；</u></p> <p><u>4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；</u></p> <p><u>5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；</u></p> <p><u>6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</u></p> <p><u>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</u></p> <p><u>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</u></p>
<p>第十 三 部 分 基 金 的 投 资</p>	<p>一、投资目标</p> <p><del>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0.35%，年化跟踪误差不超过4%。</del></p> <p>二、投资范围</p>	<p>一、投资目标</p> <p><u>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。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0.35%，年化跟踪误差不超过4%。</u></p> <p>二、投资范围</p> <p><u>本基金的投资范围包括：目标ETF基金份额、</u></p>

本基金的投资范围包括：标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票（包括中小板、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（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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持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）或到期日在一年以内的政府债券。

### 三、投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

#### 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。

标的指数成份股、备选成份股、国内依法发行上市的其他股票（包括中小板、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（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、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持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）或到期日在一年以内的政府债券。

### 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。

#### 1、组合复制策略

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。

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。

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。

#### 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) 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且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%；

除上述第(2)、(7)、(15)、(16)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) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

#### 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。

#### 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的比例不低于基金资产净值的90%；

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

## 五、标的指数与业绩比较基准

未来若出现标的指数不符合要求（不包括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）、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，如对基金份额持有人利益有实质性影响，则在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

## 六、风险收益特征

~~本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。~~——

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）、（7）、（15）、（16）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、标的指数与业绩比较基准

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。

未来若出现标的指数不符合要求（不包括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）、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，如对基金份额持有人利益有实质性影响，则在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。但下文“目标ETF发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。

## 六、风险收益特征

本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型指数基金，本基金的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以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

#### 七、目标ETF发生相关变更情形时的处理

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。

(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；

(2) 目标ETF终止上市；

(3) 目标ETF基金合同终止；

(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）；

(5) 目标ETF与其他基金合并；

(6) 中国证监会规定的其他情形。

#### 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

		<p><u>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</u></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<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、股指期货合约、<del>权证</del>、债券、资产支持证券和银行存款本息、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>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、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>新增：</p> <p>三、估值方法</p> <p><u>1、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><u>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；</u></p> <p><u>九、实施侧袋机制期间的基金资产估值</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净</u></p>

第十六部分 基金费用与税收		值。
	<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</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—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、《基金合同》生效前的相关费用；</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：</u></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</p> <p>E为前一日的基金资产净值<u>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）</u></p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4—12项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、<u>《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）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><u>11、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><u>四、实施侧袋机制期间的基金费用</u></p> <p><u>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减</u></p>

		免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定。
第十七部分 基金的收益与分配		<p>新增:</p> <p>七、实施侧袋机制期间的收益分配</p> <p>本基金实施侧袋机制的,侧袋账户不进行收益分配,详见招募说明书的规定。</p>
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>(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>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</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><del>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>（四）基金份额上市交易公告书</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>（六）临时报告</del></p> <p><del>8、基金募集期延长或提前结束募集；</del></p> <p><del>八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。</del></p>	<p><del>（五）临时报告</del></p> <p><del>21、本基金变更目标ETF或变更标的指数；</del></p> <p><del>新增：</del></p> <p><del>（九）实施侧袋机制期间的信息披露</del></p> <p><del>本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</del></p>
<p>第二十三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>2、《基金合同》的有效期自其生效之</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2026年3月27日起，《华宝中证消费龙头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《华宝中证消费龙头指数证券投资基金（LOF）基金合同》同日起失效。</p>

	<p>日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>	<p>2、《基金合同》的有效期限自<u>《华宝中证消费龙头指数证券投资基金(LOF)基金合同》</u>生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p>
--	-----------------------------------	--