广发基金管理有限公司

关于修改广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金及联接基金基金合同的公告

根据深圳证券交易所（以下简称“深交所”）合并主板与中小板工作安排，深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司2021年2月5日的相关公告及基金合同的有关规定，广发基金管理有限公司（以下简称“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，并报中国证券监督管理委员会备案，对旗下广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称：广发中小板300ETF）及广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称：广发中小板300联接）的基金合同和托管协议相关条款进行修改。本次修改将自主板与中小板两板合并日起正式生效。

根据深交所《关于调整中小板指等指数名称的公告》，“中小板300指数”名称变更为“中小企业300指数”，指数简称“中小300”保持不变。相关指数选样空间描述涉及“中小板”或“中小企业板”，变更为“原中小板”或“原中小企业板”。

现将相关事项公告如下：

一、主要修改内容

1、基金名称

基金主代码	变更前基金全称	变更后基金全称
159907	广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金	广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金
270026	广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2、标的指数

广发中小板300ETF：标的指数由“中小板300价格指数”变更为“**中小企业300价格指数**”。

广发中小板300联接：标的指数由“中小板300价格指数”变更为“**中小企业**

300价格指数”。

3、业绩比较基准

广发中小板300ETF：业绩比较基准由“中小板300价格指数收益率”变更为“**中小企业300价格指数收益率**”。

广发中小板300联接：业绩比较基准由“中小板300价格指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“**中小企业300价格指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%**”。

二、重要提示

1、《托管协议》涉及上述内容的一并修改。修订后的《基金合同》、《托管协议》自中小板和主板两板合并生效日起生效，本公司已履行了规定程序，符合相关法律法规的规定及《基金合同》的约定。修改后的《基金合同》等法律文件将于主板与中小板两板合并日前在本公司网站（www.gffunds.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）披露，供投资者查阅。更新的招募说明书及产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并在规定媒介上公告。

2、本公告仅对本次基金合同修改的事项予以说明，最终解释权归本公司。投资者欲了解本公司旗下基金的详细情况，请登录本公司网站（www.gffunds.com.cn）查询或拨打本公司客户服务电话 95105828 或 020-83936999 进行咨询。

3、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。请充分了解基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2021年3月12日

附件 1：广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同修订对照表

章节	原条款	修订条款
一、前言	(三)广发中小板 300 交易型开放式指数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”)核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	(三）)广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金由广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金通过修订基金合同更名而来，广发中小板 300 交易型开放式指数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”)核准。中国证监会对本基金基金合同变更的备案，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
二、释义	1、基金或本基金：指广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金 …… 6、基金合同或本基金合同：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 7、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 8、招募说明书：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，及其更新 …… 53、标的指数：指深圳证券交易所编制并发布的中小板 300 价格指数及其未来可能发生的变更 …… 71、基金产品资料概要：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。	1、基金或本基金：指广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金，由广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金通过修订基金合同更名而来 …… 6、基金合同或本基金合同：指《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 7、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 8、招募说明书：指《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，及其更新 …… 53、标的指数：指深圳证券交易所编制并发布的中小企业 300 价格指数及其未来可能发生的变更 …… 71、基金产品资料概要：指《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。
三、基金的基本情况	(一)基金的名称 广发中小板 300 交易型开放式指数	(一)基金的名称 广发中小企业 300 交易型开放式指数证

	证券投资基金 …… (五)标的指数 中小板 300 价格指数。 如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小板 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小板 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数。	券投资基金 …… (五)标的指数 中小企业 300 价格指数。 如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小企业 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小企业 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数。
四、基金的历史沿革和存续		(一) 基金的历史沿革 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金，由广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金通过修订基金合同更名而来。 广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金于 2011 年 3 月 21 日经中国证监会证监基金字[2011]424 号文核准，基金合同于 2011 年 6 月 3 日生效。基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。 自深圳证券交易所主板与中小板两板合并日起，《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效，并取代原《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》，广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金正式变更为广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金，本基金合同当事人将按照《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。 (二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额 基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万

		元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规另有规定时，从其规定。 （新增）
七、基金份额的交易	（四）终止上市交易 …… 若因上述 1、4 项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为直接以中小板 300 价格指数为标的的指数基金。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，基金管理人将选取其他合适的指数作为标的指数，并就基金标的指数的更换提交基金份额持有人大会表决，同时报中国证监会备案并及时公告。	（四）终止上市交易 …… 若因上述 1、4 项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的，本基金将由交易型开放式基金变更为直接以中小企业 300 价格指数为标的的指数基金。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，基金管理人将选取其他合适的指数作为标的指数，并就基金标的指数的更换提交基金份额持有人大会表决，同时报中国证监会备案并及时公告。
十、基金合同当事人及权利义务	(一)基金管理人 …… 注册资本：人民币 1.2688 亿元	(一)基金管理人 …… 注册资本：14,097.8 万元人民币
十三、基金的托管	基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。	基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。
十五、基金的投资	(二)投资理念 中国经济和资本市场的长期发展，推动国内中小企业的长期快速成长。本基金遵循指数化投资理念，以较低的成本和较低的风险获得与中小板 300 价格指数相近的回报。 …… (六)标的指数和业绩比较基准 本基金业绩比较基准为标的指数。本基金的标的指数为中小板 300 价格指数。 如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小板 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小板 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金	(二)投资理念 中国经济和资本市场的长期发展，推动国内中小企业的长期快速成长。本基金遵循指数化投资理念，以较低的成本和较低的风险获得与中小企业 300 价格指数相近的回报。 …… (六)标的指数和业绩比较基准 本基金业绩比较基准为标的指数。本基金的标的指数为中小企业 300 价格指数。中小企业 300 指数由原中小板 300 指数更名而来。如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小企业 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小企业 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以

	管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数，业绩比较基准相应进行更改。 (七)风险收益特征 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中小板 300 价格指数的表现，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。	依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数，业绩比较基准相应进行更改。 (七)风险收益特征 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中小企业 300 价格指数的表现，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。

附件 2：广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修订对照表

章节	原条款	修订条款
一、前言	(三)广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接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”)核准。 中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	(三) 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金由广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金通过修订基金合同更名而来，广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接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”)核准。 中国证监会对本基金基金合同变更的备案，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
二、释义	1、基金或本基金：指广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 3、目标 ETF：指中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金(简称中小板 300ETF) 4、标的指数：深圳证券交易所编制并发布的中小板 300 价格指数及其未来可能发生的变更 …… 7、基金合同或本基金合同：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 8、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 9、招募说明书：指《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，及其更新 …… 64、基金产品资料概要：指《广发中	1、基金或本基金：指广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，由广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金通过修订基金合同更名而来 3、目标 ETF：指中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金(简称中小企业 300ETF) 4、标的指数：深圳证券交易所编制并发布的中小企业 300 价格指数及其未来可能发生的变更 …… 7、基金合同或本基金合同：指《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 8、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 9、招募说明书：指《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》，及其更新 …… 64、基金产品资料概要：指《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》及其

	小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》及其更新	更新
三、基金的基本情况	(一)基金的名称 广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 …… (四)基金的投资目标 通过将绝大部分基金资产投资于中小板 300ETF,紧密跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 (五)本基金与目标 ETF 的联系和区别 本基金是目标 ETF 的联接基金,二者既有联系也有区别: 1、二者的联系 (1)两只基金均跟踪同一个标的指数即中小板 300 价格指数。 (2)两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数即中小板 300 价格指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 (3)两只基金具有相似的风险收益特征。 (4)目标 ETF 是本基金的主要投资对象。 …… (六)标的指数 本基金的标的指数为中小板 300 价格指数。 如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位变更或停止中小板 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小板 300 价格指数不宜继续作为标的指数,或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,或中小板 300ETF 标的指数发生变更,基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,履行适当程序后,变更本基金的标的指数。	(一)基金的名称 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 …… (四)基金的投资目标 通过将绝大部分基金资产投资于中小企业 300ETF,紧密跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 (五)本基金与目标 ETF 的联系和区别 本基金是目标 ETF 的联接基金,二者既有联系也有区别: 1、二者的联系 (1)两只基金均跟踪同一个标的指数即中小企业 300 价格指数。 (2)两只基金的投资目标均为紧密跟踪标的指数即中小企业 300 价格指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 (3)两只基金具有相似的风险收益特征。 (4)目标 ETF 是本基金的主要投资对象。 …… (六)标的指数 本基金的标的指数为中小企业 300 价格指数。 如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位变更或停止中小企业 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小企业 300 价格指数不宜继续作为标的指数,或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,或中小企业 300ETF 标的指数发生变更,基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,履行适当程序后,变更本基金的标的指数。
四、基金的		(一) 基金的历史沿革

历史沿革和存续		广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，由广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金通过修订基金合同更名而来。 广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金于 2011 年 3 月 21 日经中国证监会证监基金字[2011]424 号文核准，基金合同于 2011 年 6 月 9 日生效，基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。 自深圳证券交易所主板与中小板两板合并日起，《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，并取代原《广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金正式变更为广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，本基金合同当事人将按照《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》享有权利并承担义务。 (二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额 基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规另有规定时，从其规定。 （新增）
七、基金合同当事人及权利义务	(一)基金管理人 …… 注册资本：人民币 1.2688 亿元	(一)基金管理人 …… 注册资本：14,097.8 万元人民币
十、基金的托管	基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资	基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金联

	基金联接基金托管协议》。	接基金托管协议》。
十二、基金的投资	(一)投资目标 通过将绝大部分基金资产投资于中小板 300ETF,紧密跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 (二)投资理念 中国经济和资本市场的长期发展,推动国内中小企业的长期快速成长。本基金遵循指数化投资理念,以中小板 300ETF 为主要投资对象,为投资者获取与中小板 300 价格指数相近的回报。 (三)投资范围 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中小板 300ETF、中小板 300 价格指数成份股和备选成份股(含存托凭证)、新股(一级市场初次发行或增发、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)、货币市场工具以及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。本基金投资于中小板 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%,现金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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,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。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。 (四)投资策略 本基金为中小板 300ETF 联接基金。中小板 300ETF 是采用完全复制的方法实现对中小板 300 价格指数紧密跟踪的被动式指数基金,本基金主要通过投资于中小板 300ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本	(一)投资目标 通过将绝大部分基金资产投资于中小企业 300ETF,紧密跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 (二)投资理念 中国经济和资本市场的长期发展,推动国内中小企业的长期快速成长。本基金遵循指数化投资理念,以中小企业 300ETF 为主要投资对象,为投资者获取与中小企业 300 价格指数相近的回报。 (三)投资范围 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中小企业 300ETF、中小企业 300 价格指数成份股和备选成份股(含存托凭证)、新股(一级市场初次发行或增发、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等)、货币市场工具以及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。本基金投资于中小企业 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%,现金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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,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。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。 (四)投资策略 本基金为中小企业 300ETF 联接基金。中小企业 300ETF 是采用完全复制的方法实现对中小企业 300 价格指数紧密跟踪的被动式指数基金,本基金主要通过投资于中小企业 300ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日

	基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。 当本基金申购赎回中小板300ETF基金份额和在二级市场买卖中小板300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时、或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。 1、资产配置策略 本基金主要投资于中小板300ETF、中小板300价格指数成份股和备选成份股，其中投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%，现金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%。同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。 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。 2、目标ETF投资策略 （1）投资组合的构建 基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合，并在建仓期内将股票组合换购成中小板300ETF，使本基金投资于中小板300ETF的比例不少于基金资产净值的90%。 （2）投资组合的投资方式 本基金投资于中小板300ETF的两种方式如下： 1）申购和赎回：中小板300ETF开放申购赎回后，通过其申购赎回代理券商以股票组合进行申购赎回。 2）二级市场方式：中小板300ETF上市交易后，通过券商在二级市场进行中小板300ETF基金份额的交易。	均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。 当本基金申购赎回中小企业300ETF基金份额和在二级市场买卖中小企业300ETF或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时、或预期标的指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金经理可以对投资组合进行适当调整，以降低跟踪误差。 1、资产配置策略 本基金主要投资于中小企业300ETF、中小企业300价格指数成份股和备选成份股，其中投资于中小企业300ETF的比例不少于基金资产净值的90%，现金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%。同时，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。 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。 2、目标ETF投资策略 （1）投资组合的构建 基金合同生效后，本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合，并在建仓期内将股票组合换购成中小企业300ETF，使本基金投资于中小企业300ETF的比例不少于基金资产净值的90%。 （2）投资组合的投资方式 本基金投资于中小企业300ETF的两种方式如下： 1）申购和赎回：中小企业300ETF开放申购赎回后，通过其申购赎回代理券商以股票组合进行申购赎回。 2）二级市场方式：中小企业300ETF上市交易后，通过券商在二级市场进行中小企业300ETF基金份额的交易。 在基金的日常投资管理中，本基金将主要通过一级市场利用股票组合申购和

	在基金的日常投资管理中，本基金将主要通过一级市场利用股票组合申购和赎回目标 ETF 的基金份额，实现指数化投资目标。同时，本基金也可通过二级市场在证券交易所直接买入、卖出目标 ETF 基金份额。例如，在买入、卖出量低于最小申购、赎回单位时，基金管理人可以通过二级市场直接买入、卖出目标 ETF 基金份额。这两种投资方式的选择，首先要考虑交易便利性及市场流动性两个方面的因素；其次，在交易制度允许和市场流动性充分的前提下，通过综合考虑交易成本和价格优势，优化得出目标基金 ETF 份额的买入、卖出数量。 当中小板 300ETF 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，无须召开基金份额持有人大会。 （3）投资组合的调整 本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资中小板 300ETF 的时间和方式。 1）当净申购时，本基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、中小板 300ETF 的申购或买入等； 2）当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定中小板 300ETF 的赎回或卖出等。 3、股票投资策略 （1）股票组合构建原则 根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。 （2）股票组合构建方法 本基金将以追求跟踪误差最小化进行中小板 300 指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据中小板 300 价格指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管	赎回目标 ETF 的基金份额，实现指数化投资目标。同时，本基金也可通过二级市场在证券交易所直接买入、卖出目标 ETF 基金份额。例如，在买入、卖出量低于最小申购、赎回单位时，基金管理人可以通过二级市场直接买入、卖出目标 ETF 基金份额。这两种投资方式的选择，首先要考虑交易便利性及市场流动性两个方面的因素；其次，在交易制度允许和市场流动性充分的前提下，通过综合考虑交易成本和价格优势，优化得出目标基金 ETF 份额的买入、卖出数量。 当中小企业 300ETF 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，无须召开基金份额持有人大会。 （3）投资组合的调整 本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资中小企业 300ETF 的时间和方式。 1）当净申购时，本基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、中小企业 300ETF 的申购或买入等； 2）当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定中小企业 300ETF 的赎回或卖出等。 3、股票投资策略 （1）股票组合构建原则 根据标的指数，结合研究报告和基金组合的构建情况，采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。 （2）股票组合构建方法 本基金将以追求跟踪误差最小化进行中小企业 300 指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据中小企业 300 价格指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。

	理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。 （3）股票组合的调整 1）定期调整 本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的中小板 300 价格指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 …… (五)业绩比较基准 本基金标的指数为中小板 300 价格指数。 本基金业绩比较基准为：中小板 300 价格指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。 如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小板 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小板 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，或者目标 ETF 标的指数发生变更时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数，业绩比较基准相应进行更改。 (六)风险收益特征 本基金为 ETF 联接基金，风险和收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要投资于中小板 300ETF，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。	（3）股票组合的调整 1）定期调整 本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的中小企业 300 价格指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。 …… (五)业绩比较基准 本基金标的指数为中小企业 300 价格指数。 本基金业绩比较基准为：中小企业 300 价格指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%。 中小企业 300 指数由原中小板 300 指数更名而来。如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位变更或停止中小企业 300 价格指数的编制及发布、或者由于指数编制方法等重大变更导致中小企业 300 价格指数不宜继续作为标的指数，或者证券市场上有其他代表性更强、更适合投资的指数推出，或者目标 ETF 标的指数发生变更时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数，业绩比较基准相应进行更改。 (六)风险收益特征 本基金为 ETF 联接基金，风险和收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要投资于中小企业 300ETF，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。
二十五、基金合同内容摘要	五、基金资产的投资范围和投资限制 (一)投资范围 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300ETF、中小板 300 价格指数成份股和备选成份股（含存托凭证）、新股（一级市场初次发行或增发、存托凭证）、债券	五、基金资产的投资范围和投资限制 (一)投资范围 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中小企业 300ETF、中小企业 300 价格指数成份股和备选成份股（含存托凭证）、新股（一级市场初次发行或增发、存托凭证）、债券（包括国

	（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具以及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。本基金投资于中小板 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，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。	债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具以及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。本基金投资于中小企业 300ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，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。