最新公告速递

上海证券交易所上市公司

(上接D1版)

600436 片仔癀 2011年度股东大会通过有关议案。

600459 贵研铂业 董事会通过《关于为公司控股子公司提供委托贷款的议案》。

600480 凌云股份 2011年年度股东大会通过有关议案。

600486 扬农化工 公布2011年年度股东大会通过有关议案。

600495 晋西车轴 公布关于使用8,400万元闲置募集资金暂时补充公司流动资金的公告。

600512 腾达建设 公布关于归还募集资金的公告。董事会通过了《关于继续使用部分闲置募集资金补充流动资金的议案》。

600535 天士力 公布变更公司名称的公告。

600549 厦门钨业 2011年年度股东大会通过有关议案。选举刘同高为董事长,选举黄康、山田正二为副董事长。

600558 大西洋 公布为控股子公司提供担保的公告。

600565 迪马股份 公布2011年度分配方案实施公告。

600567 山鹰纸业 公布关于召开2012年第一次股东大会的二次通知。

600572 康恩贝 公布前次募集资金使用情况报告。董事会通过《关于前次非公开发行股票募集资金使用情况的报告》、《关于公司非公开发行A股股票方案的议案》、《关于公司本次募集资金运用的可行性分析报告的议案》等事项。定于2012年5月24日召开公司2012年第一次临时股东大会,审议以上议案及其他事项。

600572 康恩贝 2011年度股东大会通过有关议案。

600577 精达股份 公布关于第二大股东股权质押解除及再质押的公告。

600581 八一钢铁 公布2011年度利润分配实施公告。

600608 ST沪科 本次有限售条件的流通股上市数量为23,277,476股,上市流通日2012年5月16日。

600614、900907 鼎立股份、鼎立B股 公布关于公司大股东股权质押的公告。

600617、900913 ST联华、ST联华B 增补职工监事。

600645 中源协和 公布关于控股子公司增加经营范围的公告。

600668 尖峰集团 2011年度股东大会通过有关议案。

600677 航天通信 公布关于召开2012年第一次临时股东大会的提示性公告。

600678 *ST金顶 管理人公布关于公司重整进展情况的公告。

600692 亚通股份 公布关于公司控股子公司上海亚通和谐投资发展有限公司对上海中居投资发展有限公司进行投资的公告。

600695、900919 大江股份、大江B股 公布澄清公告。

600710 常林股份 公布关于国有股权无偿划转获得中国证监会核准批复的公告。

600714 金瑞矿业 董事会通过了《关于选举公司第六届董事会董事长、副董事长的议案》、《关于聘任公司经营班子成员的议案》、《关于聘任公司第六届董事会董事会秘书、证券事务代表的议案》等事项。

600714 金瑞矿业 2012年第一次临时股东大会通过有关议案。

600722 ST金化 2011年年度股东大会通过有关议案。

600727 ST鲁北 公布关于山东鲁北盐化有限公司“100Kt/a金红石型钛白粉项目”建设主体变更的公告。

600742 一汽富维 2011年度股东大会通过有关议案。董事会通过了“选举董事长、副董事长的议案”、“聘任公司总经理的议案”、“聘任公司董事会秘书、证券事务代表的议案”等事项。

600745 中茵股份 交易异常波动公告。

600763 通策医疗 同意于2012年5月29日召开公司2011年年度股东大会,审议《公司2011年度报告》等事项。

600766 *ST园城 公布关于矿业公司经营进展公告。

600790 轻纺城 2011年度股东大会通过有关议案。

600798 宁波海运 公布2011年度利润分配及“海运转债”转股价格调整的提示性公告。

600823 世茂股份 本次有限售条件的流通股上市数量为69224万股,上市流通日为2012年5月14日。

600851、900917 海欣股份、海欣B股 公布关于第一大股东股份质押的提示性公告。

600886 国投电力 2011年年度股东大会通过有关议案。董事会通过了《关于选举公司第八届董事会副董事长的议案》、《关于更换第八届董事会专门委员会委员的议案》。

600975 新五丰 定于2012年5月29日召开公司2011年年度股东大会,审议关于公司2011年度财务决算报告的议案等事项。

600976 武汉健民 公布2011年度利润分配实施公告。

600983 合肥三洋 公布2011年度利润分配实施公告。

600984 ST建机 2011年度股东大会通过有关议案。

600987 航民股份 2011年年度股东大会通过有关议案。

600998 九州通 公布关于股东减持本公司股份的公告。

601012 隆基股份 定于2012年5月29日召开公司2011年度股东大会,审议《关于2011年度董事会工作报告的议案》、《关于公司2011年度利润分配方案的议案》、《关于募集资金运用及募投项目变更的议案》等事项。

601168 西部矿业 公布2011年度利润分配实施公告。

601377 兴业证券 本次有限售条件流通股可上市流通数量468万股,可上市流通日期2012年5月14日。

601599 鹿港科技 董事会通过为控股子公司张家港神鹿毛纺织染有限公司提供担保的议案等。

601616 广电电气 公布2011年度利润分配实施公告。定于2012年5月29日召开公司2012年第一次临时股东大会,审议关于使用部分超募资金永久补充流动资金的议案。

601668 中国建筑 公布签署阿联酋EPC总承包合作项目备忘录公告。

601669 中国水电 公布关于2012年度董事薪酬方案的公告。

601789 宁波建工 公布2011年度利润分配实施公告。

601872 招商轮船 公布关于签订《募集资金三方监管协议》的公告。

601877 正泰电器 公布关于“11正泰债”公司债券跟踪评级结果的公告。

601886 江河幕墙 公布2011年度利润分配实施公告。

601899 紫金矿业 公布关于2011年度股东大会增加临时提案的补充通知(二)。

601901 方正证券 公布关于获准在北京设立资产管理分公司的公告。

601933 永辉超市 2011年年度股东大会通过有关议案。

603000 人民网 公布关于签署募集资金三方监管协议的公告。

603002 宏昌电子 首次公开发行A股网上资金申购发行摇号中签结果公告。

603366 日出东方 首次公开发行A股投资风险特别公告。确定本次发行的发行价格区间为人民币20.00元/股-21.50元/股(含上限和下限)。

900948 伊泰B股 2011年年度股东大会通过有关议案。

嘉实基金管理有限公司关于拟召开嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的预公告

一、会议基本情况

嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据中国证监会证监许可[2012]393号文批准募集的嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实沪深300ETF”)的基金合同已于2012年5月7日生效,鉴于该基金与基金管理人现已管理的嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”或“嘉实沪深300LOF”)的标的指数相同,且具备由于实物申赎所带来的跟踪紧密等优势,为优化本基金的投资成本,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关约定,基金管理人经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,提议召开本基金的基金份额持有人大会,审议变更本基金的投资范围及其相关事宜,将本基金变更为嘉实沪深300ETF的联接基金,允许本基金投资股指期货,参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务。

为维护基金份额持有人的合法权利,便利基金份额持有人参与本次大会,实现本次大会合法、有效、顺利召开,基金管理人就本次会议审议事项及基金份额持有人参与大会的相关安排特别预先公告。

本预公告内容仅为本基金拟召开基金份额持有人大会的初步安排,并不构成本基金的基金份额持有人大会的正式会议通知。

基金管理人将依据相关法律法规的规定以及《基金合同》的约定,发布召开本基金基金份额持有人大会的会议通知,并公告会议召开的具体时间、地点、方式、具体议案、议事程序、表决方式、权益登记日等必要内容。

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《关于嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》(以下简称“《议案》”),《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日将在基金管理人届时发布的召开基金份额持有人大会的通知中进行公告。

四、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会,使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志,基金份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则:

(一)委托人

本基金的基金份额持有人自本预公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书,待申购申请确认后,授权委托书自动有效。

基金份额持有人(含新申购投资者,下同)授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算,一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的,授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册登记机构的登记为准。

(二)受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

为便基金份额持有人的权利得到有效行使,建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人,或基金托管人,或代销机构中国银行股份有限公司为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加的受托人名单。

(三)授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面、电话、网络和短信等其他法律法规和中国证监会认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。

基金份额持有人通过纸面方式授权的,授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录嘉实基金网站下载(http://www.jsfund.cn/)等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人通过非纸面方式授权的,授权形式及程序应符合本通知的规定。

1、纸面方式授权

(1)基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

1)个人基金份额持有人委托他人投票的,应由委托人填妥并签署授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件二的样本),并提供个人身份证明文件复印件。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证明文件复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

如果个人基金份额持有人使用其收到的基金管理人邮寄的专用授权委托征集信函授权时,无需提供身份证明文件复印件,在专用回邮信函上填写个人姓名、身份证明文件号码和授权委托意见,并回寄给基金管理人,该授权委托书即视为有效授权。

2)机构持有人委托他人投票的,应由委托人填妥授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件二的样本)并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证明文件复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件)。

(2)纸面授权文件的递达

基金份额持有人可通过邮寄授权文件或在基金管理人或受托人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人或受托人营业机构。

基金份额持有人也可在授权截止时间前至基金管理人或代销机构的柜台办理授权,填写授权委托书,并提交基金份额持有人身份证明文件。投资者通过直销柜台及指定代销机构网点柜台办理基金交易业务时,直销柜台及指定代销机构网点柜台将为投资者提供纸面方式授权的服务。为保护投资者利益,投资者在交易时,不论投资者是否授权或选择何种授权方式,均不影响交易的进行。

2、电话授权方式

为方便基金份额持有人参与大会,基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道(400 801 8888400 600 8800转6),基金份额持有人可免费拨打并按提示转入人工坐席进行授权。

基金管理人、基金托管人和主要代销机构的呼叫中心也将主动与基金份额持有人取得联系,在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后,由人工坐席根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益,整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话等其他授权的方式仅适用于个人持有人,对机构持有人暂不开通。

3、网络授权

为方便基金份额持有人参与大会,基金管理人提供以下互联网通道供投资者进行授权。

(1)在基金管理人网站设立授权专区,基金份额持有人可按提示进行操作。

(2)基金管理人和基金托管人通过各自的网上平台为投资者提供通过互联网络进行授权的服务。

为保护投资者利益,投资者在进行交易时,不论投资者是否授权或选择何种授权方式,均不影响交易的进行。

通过基金管理人和基金托管人网上交易平台进行授权的基金份额持有人,应使用其交易密码进行登录;基金份额持有人在通过基金管理人授权专区及基金管理人提供的持有人查询平台进行授权时,需核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过互联网络授权的方式仅适用于个人持有人,对机构持有人暂不开通。

4、短信授权

为方便基金份额持有人参与大会,基金管理人提供以下短信通道供投资者进行授权。

基金管理人、基金托管人和本基金的主要代销将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集授权短信,持有人回复短信表明授权意见。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人持有人,对机构持有人暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的,可选择其他方式进行授权。

5、授权效力确定规则

(1)如果同一基金份额存在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的,以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的,以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的,如最后时间收到的授权委托有多次,以表示具体表决意见的纸面授权为准;最后时间收到的多次纸面授权均未表示具体表决意见的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准;若授权表示不一致,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

(2)如果同一基金份额在只存在有效纸面方式授权时,委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权;

(3)如果同一基金份额无有效纸面方式授权,但存在有效的其他非纸面方式授权的,以有效的其他非纸面方式的授权为准;

(4)如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的,以时间在最后的授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项,以表示具体表决意见的授权为准;最后时间收到的多次授权其授权表示一致的,以一致的授权表示为准;若授权表示不一致,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权;

(5)如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权;如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

6、授权截止时间

基金份额持有人授权截止时间以本基金基金份额持有人大会的会议通知所规定的授权截止时间为准。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人、基金托管人或代销机构的指定地址的,授权时间以收到时间为准;通过其他非纸面方式授权的,授权时间以系统记录时间为准。

五、表决

表决方式及具体表决时间以基金份额持有人大会通知为准。

六、本次大会相关机构

1、召集人:嘉实基金管理有限公司

持有人大会专线客服电话:400 801 8888/400 600 8800转6

联系人:赵虹

联系电话:010 65215588

传真:010 65182266

网址:http://www.jsfund.cn

电子邮件:service@jsfund.cn

2、公证机构:北京市方圆公证处

3、见证律师:通力律师事务所

七、重要提示

1、本次基金份额持有人大会召开时间应以届时公告的召开本次基金份额持有人大会的通知为准。在大会通知公告之前,基金管理人、基金托管人或者代销机构征集授权的行为在任何方面均不构成对本次会议召开时间的明示或者暗示。

2、根据《基金法》及《基金合同》的规定,本次大会需要持有基金份额百分之五十以上的基金份额持有人出席方可召开,经出席基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》及《基金合同》的有关规定,本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

3、上述基金份额持有人大会有关预公告可通过嘉实基金管理有限公司网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电400 600 8800咨询。

4、本通知的有关内容由嘉实基金管理有限公司解释。

附件一:《关于嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》

附件二:授权委托书(样本)

嘉实基金管理有限公司

2012年5月9日

附件一

关于嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案

嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人:

鉴于嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实沪深300ETF”)基金合同已经生效,该基金与基金管理人现已管理的嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”或“嘉实沪深300LOF”)的标的指数相同,且具备由于实物申赎所带来的跟踪紧密等优势,为优化本基金的投资成本,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关约定,基金管理人经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,提议召开本基金的基金份额持有人大会,审议变更本基金的投资范围及其相关事项,将本基金变更为嘉实沪深300ETF的联接基金,允许本基金投资股指期货,参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务。

为实现嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事宜之目的,根据《基金法》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》、《交易型开放式指数基金联接基金审核指引》等法律法规、监管机关相关规定、《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)以及《关于嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》,现就《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》相关条款的修改,制作本《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》修改说明》,将需修改的合同条款列示如下:

1.将基金合同的名称由“《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》”修改为“《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》”。

2.将基金合同中本基金名称由“嘉实沪深300指数证券投资基金”或“嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)”变更为“嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”,涉及本基金名称表述的条款相应修改。

3.第二章 释义

根据本基金变更投资范围后的基金名称相应修改第二章中与基金名称有关的条款;删除“发售公告公或基金份额发售公告”的定义;根据监管机关的规定,增加相关术语的定义,增加的相关术语的定义如下:

“登记结算业务实施细则”:指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及其不时修订。

“交易型开放式指数证券投资基金”:指《登记结算业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”。

“标的指数”:指中证指数有限公司编制并发布的沪深300指数及其未来可能发生的变更。

“目标ETF”:另一获中国证监会核准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。本基金以嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实沪深300ETF”)为目标ETF。

“ETF联接基金”: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,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作的基金,本基金是联接其所投资的目标ETF的ETF联接基金。

4.第三章 基金的基本情况

修改本基金的名称和基金的类别,增加目标ETF及其标的指数说明,并说明联接基金与嘉实沪深300ETF的联系和区别,具体修改如下:

(1)本章第(一)条 基金的名称”内容修改为:嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”;

(2)本章第(二)条 基金的类别”修改为:联接基金”;

(3)本章第(四)条 标的指数”修改为:目标ETF及其标的指数”,本条内容修改为:“目标ETF及其标的指数:目标ETF为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金,其标的指数为沪深300指数。”

(4)本章第(十)条后增加一条为第(十一)条 本基金与目标ETF的联系与区别”,具体内容为:

本基金为目标ETF的联接基金,二者既有联系也有区别:

1、在基金的投资方法方面,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,投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖目标ETF,也可以按照最小申赎单位和申赎清单的要求,实物申赎目标ETF;而本基金作为上市开放式基金,目常交易包括申购赎回和上市交易两种方式,投资者既可以通过银行等场外代销机构申购和赎回本基金份额,也可以在交易所买卖本基金或进行基金份额的申购与赎回。

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,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采取实物申赎的方式,申购赎回对基金净值影响较小;而本基金申赎采取现金方式,大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。”

5.第六章 基金备案

本章标题修改为“基金的历史沿革和存续”;本章第(一)条标题修改为“(一)本基金的历史沿革”,该第(一)条全部内容修改为:

“嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)由嘉实沪深300指数证券投资基金通过基金合同修订变更而来。

嘉实沪深300指数证券投资基金经中国证监会《关于同意嘉实沪深300指数证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2005]103号)批准募集,基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

嘉实沪深300指数证券投资基金自2005年7月5日至2005年8月19日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》于2005年8月29日生效。

2012年**月**日嘉实沪深300指数证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》,同意嘉实沪深300指数证券投资基金变更投资范围及其相关事宜,将嘉实沪深300指数证券投资基金变更为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),允许本基金投资股指期货,参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务,并基于上述投资范围的变更,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金的名称、投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他部分条款进行相应修改,上述基金份额持有人大会决定事项已经中国证监会于2012年**月**日核准生效,自该日起,《嘉实沪深300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(自该基金合同第四章 基金份额的场外认购”和第五章 基金份额的场内认购”仅适用于嘉实沪深300指数证券投资基金的募集,对变更后的嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)不适用),并取代原《嘉实沪深300指数证券投资基金基金合同》,嘉实沪深300指数证券投资基金正式变更为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),本基金当事人将按照《嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》享有权利并承担义务。”

6.第八章 基金的申购和赎回

根据本基金变更投资范围后因投资目标ETF而导致本基金可能发生的暂停申购赎回情况,对基金合同进行修改,具体修改内容如下:

1、本章第(二)条 申购、赎回的开放日及时间”中,删除该条第1款的标题“1、开放日”;删除该条第2款的标题 申购、赎回的开始日及业务办理时间”及该第2款中的 本基金自基金合同生效后不超过三个月的时间起开始办理申购、赎回。

在确定申购、赎回开始时间后,由基金管理人最迟于开放前3个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。”

2、本章第(九)条 拒绝或暂停申购的情形及处理”第1款第(2)项后增加两项,增加的内容为:“(3)所投资的目标ETF暂停估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;(4)所投资的目标ETF暂停申购或二级市场交易停牌,且基金管理人认为有必要暂停本基金申购的;”本第1款中的项目顺序相应调整。

3、本章第(九)条 拒绝或暂停申购的情形及处理”第2款 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形和处理”第(3)项后增加两项,增加的内容为:“(4)所投资的目标ETF暂停估值,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;(5)所投资的目标ETF暂停赎回,且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的;”本第2款中的项目顺序相应调整。

7.第九章 基金合同当事人及其权利和义务

本章第(四)条第1款 基金份额持有人的权利”第(9)项后增加一项为第(10)项,增加的内容为:“出席或者委派代表出席目标ETF份额持有人大会,对目标ETF份额持有人大会审议事项行使表决权,参会份额和票数按权益登记日本基金所持有的目标ETF份额占本基金资产的比例折算;”本第1款中的项目顺序相应调整。

8.第十章 基金份额持有人大会

根据监管机关对联接基金的监管要求,增加本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面的联系,具体修改条款如下:

1、本章第(二)条 召开事由”的第12项 变更基金份额持有人大会程序”后增加一项为第13项,增加的内容为:“基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或决定目标ETF基金份额持有人大会”。

2、本章第(九)条 生效与公告”后增加一条为第(十)条,增加的内容为:

“(十)本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面的联系

鉴于本基金是目标ETF的联接基金,本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系。

本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席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,计算参会份额和计票时,其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所持有的目标ETF份额的总数乘以该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份额持有人大会。”

9.第十七章 基金的投资

根据相关法律法规及监管规则,对本章中投资范围、投资理念、投资策略、业绩衡量基准、投资组合比例限制、投资组合比例调整等与投资相关的条款将进行全面的修改,并 增加目标ETF发生相关变更情形时的处理”。具体修改如下:

1、本章第(二)条 投资范围”全部修改为:“本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及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的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。”

2、本章第(三)条 投资理念”修改为:“本基金遵循指数化投资理念,通过投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股等,力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数扣除费用后的平均收益率,满足基金投资者的投资需求。”

3、本章第(四)条 投资策略”的第1款、第2款内容全部修改为:“本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,在正常市场情况下,本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

1、资产配置比例

本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

2、组合构建

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赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。

此外,为更好地实现投资目标,本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的,基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、期权等衍关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。”

4、本章第(五)条业绩衡量基准中“95%的沪深300指数增长率加5%的银行同业存款收益率”变更为:“95%的沪深300指数增长率加5%的银行活期存款税后利率。”

5、本章第(七)条 投资禁止行为与限制”中,“4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;”变更为“4)买卖其他基金份额,但是本基金投资目标ETF或者国务院另有规定的除外;”

6、本章第(八)条第2款 本基金投资组合比例限制”项下的内容全部修改为:“1)本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%;

2)持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

3)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;

4)基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

5)本基金投资权证,在任何交易日买入的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。其它权证的投资比例,遵从法规或监管部门的相关规定;

6)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。

8)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

9)本基金从事股票指数期货投资时,遵循相关法律法规的规定:

a)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;

b)本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%;

c)本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票及目标ETF总市值的20%;

d)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

e)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

f)本基金投资股指期货的,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;

10)不违反本基金合同有关投资范围、投资策略、投资比例等内容的约定;

11)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

基金的投资组合应在本基金变为ETF联接基金的基金合同生效之日起3个月内达到规定的标准。

因证券期货市场波动、上市公司合并、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不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

如法律法规或监管部门调整上述限制比例规定,基金管理人在履行适当程序后,按照调整后的规定执行。有关法律法规或监管部门取消上述限制,履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。”

7、本章第(七)条第2款后增加的一款,增加的内容为:“3.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该标的指数的指数基金;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,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,基金合同中将去掉关于目标ETF的表述部分,或将变更标的指数,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)。

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。”。

8、本章第(八)条 投资组合比例调整”全部内容修改为:

“1.基金经理根据投资决策委员会的指导意见确定具体的资产配置方案。

2.基金经理每日根据本基金申赎赎回情况及已有现金滞留,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赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。

3.通常情况下,联接基金的投资组合主要体现为持有目标ETF基金份额;对于目标ETF暂停申购、停牌或其他原因导致基金投资组合中出现的现金,基金经理将根据市场情况按照本基金的投资范围约定的其他投资品种进行投资。

4.风险管理部门定期对本基金的运行情况和跟踪偏离进行量化评估并出具评估报告。基金经理根据评估报告分析投资操作、组合状况和跟踪误差来源等情况,并相应进行组合调整。”

10.第十八章 基金的融资

1.将本章的标题由“基金的融资”修改为“基金的融资融券及转融通”。

2.本章内容全部