广发基金管理有限公司关于拟召开广发中证500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

广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2013]165号文批准募集的广发中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“广发中证500ETF”）的基金合同已于2013年4月11日生效，鉴于该基金与基金管理人现已管理的广发中证500指数证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”或“广发中证500 LOF”）的标的指数相同，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《广发中证500指数证券投资基金(LOF)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工商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，将本基金变更为广发中证500ETF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《关于广发中证500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。

为使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，或基金托管人中国工商银行股份有限公司，或代销机构为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人大会及其他部分条款进行相应修改。

（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、复印或登录广发基金网站下载（www.gffunds.com.cn）等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人的授权形式及程序应符合以下规定：

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（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（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等）。

合格境外机构投资者委托他人投票的，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本单位公章（如有）或由授权代表在授权委托书上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署授权委托书的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

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）。

③如基金份额持有人拟委托基金管理人，或基金托管人，或代销机构，或基金管理人建议的受托人投票的，无需提供受托人的企业法人营业执照复印件。

（2）纸面授权文件的送达

基金份额持有人或其代理人需将填妥的授权委托书和所需的相关文件通过专人送交、邮寄或以电子邮件、传真、在线客服、微信的方式送达至基金管理人。

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主要代销机构网点柜台办理基金交易业务时，直销柜台及主要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、电话方式授权

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供以下电话通道供投资者进行授权。

（1）基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道，客户可拨打客服热线95105828，按通后语音提示“进行中证500产品类型转型投票请按6”，然后该类客户电话优先转入工，客服人员核对客户身份后进行授权记录从而完成授权。

（2）基金管理人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，上述所有通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于委托人为个人持有人，受托人为基金管理人。

3、网络方式授权

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供以下网络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）基金管理人通过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。

基金份额持有人在通过基金管理人授权专区进行授权时，需核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人权益；通过基金管理人网上平台进行授权的基金份额持有人，应使用密码登录。

基金份额持有人通过网络授权的方式仅适用于委托人为个人持有人，受托人为基金管理人。

4、短信方式授权

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。

（1）基金管理人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。

（2）个人持有人发送短信表明授权意见至基金管理人指定号码。

基金份额持有人通过短信进行授权时，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。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于委托人为个人持有人，受托人为基金管理人。

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）如果同一基金份额只存在有效纸面方式授权，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：广发基金管理有限公司

持有人大会专线/客服电话：95105828转6

联系人：赵欢

联系电话：020-89188603

传真：020-34281105

网址：www.gffunds.com.cn

电子邮件：services@gffunds.com.cn

2、公证机构：北京市方圆公证处

地址：北京市东城区朝阳门内大街东水井胡同5号北京INN大厦B502室

联系人：原莹

联系电话：010-85197530

邮政编码：100010

3、见证律师：国浩律师（广州）事务所

地址：广州市体育西路 189 号城建大厦9楼

联系人：黄贞

电话：020-38799345

邮编：510620

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，本次大会需要持有不小于权益登记日基金总份额百分之五十（含百分之五十）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的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过才能做出有效决议。如本次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是否会有预公告可通过广发基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电95105828（免长途费）咨询。

4、本通知的有关内容由广发基金管理有限公司解释。

附件一：《关于广发中证500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）

广发基金管理有限公司
2013年7月2日

附件一：关于广发中证500指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案

广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人：

鉴于广发中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“广发中证500ETF”）基金合同已经生效，该基金与基金管理人现已管理的广发中证500指数证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”或“广发中证500LOF”）的标的指数相同，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《广发中证500指数证券投资基金(LOF)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工商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相关事项，将本基金变更为广发中证500ETF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。基于上述投资范围的变更，相应地对《基金合同》中有关本基金的名称、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他部分条款，按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改。就本基金投资范围变更需对《基金合同》修改的内容详见本议案附件《<广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同>修改说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，基金管理人将根据本议案及其附件《<广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同>修改说明》对《基金合同》进行修改，并将修改后的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件报监管机关并公告。

以上议案，请予审议。

广发基金管理有限公司
2013年7月2日

附件二：授权委托书

本人（或本机构）持有或申购了广发中证500指数证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）的基金份额，就广发基金官网（www.gffunds.com.cn）及2013年7月2日《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》公布的《广发基金管理有限公司关于拟召开广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的预公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

同意	反对	弃权

本人（或本机构）特此授权　　代表本人（或本机构）参加审议上述事项的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。本人（或本机构）同意受托人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件号码（填写）：

签署日期：　　年　　月　　日

授权委托书填写注意事项：

1、本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》要求的授权委托书。

2、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。

3、如委托人未在授权委托书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。

4、本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

《关于广发中证500指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》之附件：

《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》修改说明

为实现广发中证500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、《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）以及《关于广发中证500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《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》相关条款的修改，制作本《<广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同>修改说明》，将需修改的合同条款列示如下：

【一】将基金合同的名称由“《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》”修改为“《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》”。

【二】将基金合同中本基金名称由“广发中证500指数证券投资基金（LOF）”变更为“广发中证500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。

【三】对原基金合同“第一部分　前言和释义”的修订

根据监管机关的规定，增加相关释义，具体如下：

《登记结算业务实施细则》：《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：中证指数有限公司编制并发布的中证500指数及其未来可能发生的变更。

目标ETF：广发中证500交易型开放式指数证券投资基金（简称“广发中证500ETF”）。

ETF联接基金：将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标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。

【四】对原基金合同“第二部分　基金的基本情况”的修订

修改基金的类别、基金的投资目标，增加目标ETF及标的指数的说明，并说明联接基金与目标ETF的联系和区别，具体修订如下：

1、将“二、基金的类别”的内容修改为“ETF联接基金”。

2、将“五、基金的标的指数”修改为“五、目标ETF及标的指数”，内容修改为“本基金的目标ETF为广发中证500交易型开放式指数证券投资基金，标的指数为中证500指数”。

3、将“六、基金的投资目标”的内容修改为“本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”。

4、在“第二部分　基金的基本情况”增加“十、本基金与目标ETF的联系和区别”，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，投资者既可以在二级市场买卖目标ETF，也可以按照申购赎回清单的要求，采用申购申购和份额赎回的方式进行申赎目标ETF；而本基金是上市开放式基金（LOF），投资者可以在二级市场买卖本基金份额，也可以通过交易所场内和场外销售机构申购和赎回本基金份额；

（3）申购赎回方式不同。目标ETF的投资人依据申购赎回清单，按以组合证券为主的申购对价、赎回对价进行申购赎回，申购赎回均以份额申报；本基金的投资人依据基金份额净值，以现金方式进行申购赎回，金额申购、份额赎回。

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；而本基金申购赎回采用现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击；

（3）投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同。”

【五】对原基金合同“第四部分　基金备案”的修订

本部分标题修改为“基金的历史沿革和存续”，删去“一、基金备案的条件”、“二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式”，并增加“一、本基金的历史沿革”，具体修改内容如下：

“一、本基金的历史沿革

广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）由广发中证500指数证券投资基金（LOF）通过基金合同修订变更而来。

广发中证500指数证券投资基金(LOF)经中国证监会证监许可【2009】982号文核准募集，基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

广发中证500指数证券投资基金（LOF）自2009年10月22日至2009年11月20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，《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2009年11月26日生效。

2013年**月**日广发中证500指数证券投资基金(LOF)以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项的议案》，同意广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事宜，将广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更为广发中证500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本基金的名称、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2013年**月**日核准生效，自该日起，《广发中证500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（但该基金合同第三部分“基金份额的发售”仅适用于广发中证500指数证券投资基金（LOF）的募集，对变更后的广发中证500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《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》，广发中证500指数证券投资基金（LOF）正式变更为广发中证500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《广发中证500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。”

【六】对原基金合同“第五部分　基金份额的上市交易”的修订

1、删除“基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。”

2、将“二、上市交易的时间”的内容修改为：“广发中证500指数证券投资基金（LOF）已于2010年1月8日在深圳证券交易所上市。因召开基金份额持有人大会，基金管理人向深圳证券交易所申请广发中证500指数证券投资基金（LOF）自201*年*月*日开始持续停牌。201*年*月*日，经基金管理人向深圳证券交易所申请，本基金复牌。”

【七】对原基金合同“第六部分　基金份额的申购与赎回”的修订

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，对本部分进行修改，具体修改内容如下：

1、在“7、申购份额与赎回金额的计算”中，将“（3）本基金基金份额净值的计算”的内容修改为：

“T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。”

2、在“9、拒绝或暂停申购的情形及处理方式”中增加内容：

“（4）目标ETF暂停基金资产估值；

（5）目标ETF暂停申购、暂停上市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。”

3、在“10、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式中增加内容：

“（4）目标ETF暂停基金资产估值；

（5）目标ETF暂停赎回、暂停上市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的情形。”

【八】对原基金合同“第七部分　基金合同当事人及权利义务”的修订

在“三、基金份额持有人”的“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”中增加如下条款：

“（9）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。”

【九】对原基金合同“第八部分　基金份额持有人大会”的修订

1、在“一、召开事由”中将“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”的第8项修订为：

“（8）变更基金投资目标、范围或策略，但由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外。”

2、在“一、召开事由”的“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”中增加如下条款：

“（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。”

3、在“一、召开事由”的“2、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”中增加如下条款：

“（4）由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略。”

4、在本部分最后增加以下内容：

“九、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的份额持有人大会并参与表决，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，本基金持有目标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。”

【十】对原基金合同“第十二部分　基金的投资”的修订

根据相关法律法规及监管规则，对本部分中投资目标、投资范围、投资理念、投资策略、投资限制、标的指数和业绩比较基准、风险收益特征、基金的融资融券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”条款。具体修改如下：

1、将“一、投资目标”的内容修改为：

“本基金通过投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。”

2、将“二、投资范围”的内容修改为：

“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（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。届时本基金参与融资融券、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。”

3、将“三、投资理念”的内容修改为：

“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所跟踪的标的指数相近的平均收益率，满足基金投资者的投资需求。”

4、将“四、投资策略”的内容修改为：

“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。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。

（一）资产配置策略

本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股、备选成份股，其中投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、新股、债券、权证、股指期货及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。

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。

（二）目标ETF投资策略

1、投资组合的投资方式

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。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，无须召开基金份额持有人大会。

2、投资组合的调整

本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资目标ETF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，决定目标ETF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，决定目标ETF的赎回或卖出等。

（三）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标的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，根据标的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。

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标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

（四）债券投资策略

本基金将通过自上而下的宏观分析，结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置，并根据对个券相对价值的比较，进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性，有效利用基金资产。

（五）股指期货及其他金融衍生品的投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪对标的指数的目的。”

5、将“五、投资限制”的“（一）禁止行为”中的第4、5、6项条款修订为：

“4、买卖除目标ETF外的其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券，但在法律法规或监管机构允许的情况下，目标ETF与标的指数成份股除外；

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，但在法律法规或监管机构允许的情况下，目标ETF与标的指数成份股除外。”

6、在“五、投资限制”的“（二）投资组合限制”中删除“7、本基金建仓期为3个月”，并增加如下条款：

“1、本基金持有的目标ETF的资产不得低于基金资产净值的90%；

8、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%；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100%，其中，有价证券指目标ETF、股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票和目标ETF总市值的20%；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%；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；

9、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。”

7、将“五、投资限制”的“（二）投资组合限制”中最后两段内容修改为：

“基金托管人对本基金投资组合的监督自基金合同生效日起。基金管理人应当自本基金变更为ETF联接基金的基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

由于证券市场波动、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。”

8、在“六、标的指数和业绩比较基准”中，将“本基金业绩比较基准”变更为：“95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。”

9、将“七、风险收益特征”的内容修改为：

“本基金为ETF联接基金，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，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。”

10、将“九、基金的融资融券”的标题修改为“九、基金的融资融券及转融通”，内容修改为：

“本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。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。届时本基金参与融资融券、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。”

11、在本部分最后增加以下内容：

“十、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基金；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数基金，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。”

【十一】对原基金合同“第十三部分　基金的财产”的修订

在“一、基金资产总值”中增加内容为：“6、目标ETF投资及其估值调整”。

【十二】对原基金合同“第十四部分　基金资产估值”的修订

根据监管规则要求，本章补充约定对目标ETF估值和因目标ETF估值暂停估值的情形，并根据本基金变更投资范围相应增加股指期货等其他资产估值的约定，具体修改如下：

1、将“三、估值对象”的内容修改为：

“基金所拥有的目标ETF份额、股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。”

2、将“五、估值方法”第3条修改为：

“因持有股票而享有的配股权，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。”

3、在“五、估值方法”中增加如下条款：

“1、目标ETF份额的估值

本基金投资的目标ETF份额以目标ETF估值日基金份额净值估值，若估值日为非证券交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。

7、股票价格指数期货合约估值方法：

（1）股票价格指数期货合约以估值日结算