华宝中证1000指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期份额折算的相关规定,当华宝中证1000B份额的基金份额参考净值跌至0.2500元或以下时,本基金将分别对华宝中证1000分额(场内简称:1000分级,代码:162413)、华宝中证1000A分额(场内简称:1000A,代码:150263)、华宝中证1000B分额(场内简称:1000B,代码:150264)进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2018年10月19日,华宝中证1000B份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件,因此提请投资者密切关注华宝中证1000B份额近期的基金份额参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对前述情形下的不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

1、触发不定期折算当日,华宝中证1000B份额的基金份额参考净值已跌至0.2500元或以下,而折算基准日在触发日后才能确定,因此折算基准日华宝中证1000B份额的基金份额参考净值可能与0.2500元有差异。

2、由于华宝中证1000A、华宝中证1000B份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,华宝中证1000A、华宝中证1000B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

3、华宝中证1000B份额具有预期风险、预期收益较高的特征。随着华宝中证1000B份额的基金份额参考净值降低,其杠杆率升高。在不定期份额折算后,华宝中证1000B份额的杠杆率将恢复至初始杠杆水平。

4、华宝中证1000A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。但在发生不定期份额折算后,华宝中证1000A份额的持有人会获得一定比例的华宝中证1000份额,原华宝中证1000A份额持有人的风险收益特征将发生一定变化,由持有单一的较低风险收益特征的华宝中证1000A份额变为同时持有较低风险收益特征的华宝中证1000A份额与较高风险收益特征的华宝中证1000份额,因此原华宝中证1000A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外,华宝中证1000份额为跟踪指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原华宝中证1000A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

5、根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则,场外份额进行份额折算时计算结果保留到小数点后2位,小数点后2位以后的部分舍去,舍去部分计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位(最小单位为1份),小数点以后的部分舍去,舍去部分计入基金财产。因此,在不定期份额折算过程中,由于尾差处理,可能使持有人的资产净值出现微小误差,但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

6、在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司赎回基金份额。因此,如果投资者通过不具备基金销售资格的证券公司购买华宝中证1000A份额,在不定期份额折算后,则折算薪增的华宝中证1000份额无法赎回。投资者可以选择在折算前将华宝中证1000A份额卖出,或者在折算后将新增的华宝中证1000份额转托管到具有基金销售资格的证券公司后赎回。

本基金管理人的其他重要提示:

1、为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停华宝中证1000A份额与华宝中证1000B份额的上市交易和华宝中证1000份额的申购、赎回、配对转换等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

2、投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的基金合同及《华宝中证1000指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)或者拨打本公司客服电话:400-700-5588(免长途话费),021-38924558。

3、本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。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“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,由投资者自行承担。投资有风险,选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件和临时公告。

特此公告。

华宝基金管理有限公司
2018年10月22日

华宝基金管理有限公司关于以现场方式召开华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

华宝基金管理有限公司于2018年10月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站(www.fsfund.com)发布了“华宝基金管理有限公司关于以现场方式召开华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会的公告”。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,根据基金合同的相关规定,现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《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》和《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)的基金管理人华宝基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“基金管理人”)决定以现场方式召开本基金的基金份额持有人大会(以下简称“本次会议”),审议《关于华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》。会议具体安排如下:

1、会议召开方式:现场方式。

2、会议召开时间:2018年11月19日上午10:00。

3、会议召开地点:上海浦东新区东方路778号国信紫金山大酒店四楼菜莉厅

4、上证180成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)将于2018年11月26日以现场方式召开基金份额持有人大会(具体内容可参见目标ETF基金份额持有人大会的相关公告)。鉴于本基金和目标ETF的相关性,在2018年10月25日交易时间结束后,在本基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人可直接参加或者委派代表参加目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。

二、会议审议事项

本次会议审议事项为《关于华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》(见附件一)。

上述议案的内容说明见《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》(见附件三)。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2018年10月25日,即该日下午交易时间结束后,在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权,权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权。

四、会议的议事程序和表决方式

1、大会主持人宣布会议开始;

2、大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人人数及所持有有表决权基金份额的总数、占权益登记日基金总份额的比例;

3、大会主持人宣布会议议事程序及注意事项;

4、大会主持人确定和公布监票人、公布公证机关和公证员姓名、见证律师;

5、大会主持人宣读议案;

6、享有表决权的与会人员对议案进行审议,并以记名投票方式进行表决;

7、监票人在基金份额持有人或代理人表决后立即对投票情况进行清点,公证机关对计票过程予以公证;

8、大会主持人当场公布计票结果;

9、公证机关公证员宣读公证词;

10、见证律师发表意见。

五、会议出席对象

1、权益登记日在登记机构登记在册的华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人或其代理人。

2、基金管理人代表。

3、基金托管人代表。

4、基金管理人聘请的见证律师。

5、基金管理人聘请的公证机关人员。

六、基金份额持有人出席会议需要准备的文件

1、个人基金份额持有人出席会议的,需提供本人身份证件原件及正反面复印件;个人基金份额持有人授权委托他人出席会议并代理行使表决权的,应按本公告“七、授权”的规定提供相关资料。

2、机构基金份额持有人出席会议的,需提供该机构加盖公章(或基金管理人认可的其他印章,下同)的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等),以及代表该机构出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件,该合格境外机构投资者出席会议的,需提供授权代表的有效身份证件原件及正反面复印件,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出席会议的证明文件,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资格的证明文件的复印件。机构基金份额持有人委托他人出席本次大会并行使表决权的,应按本公告“七、授权”的规定提供相关资料。

3、对基金管理人纸面授权文件的送达

基金份额持有人授权基金管理人出席大会并行使表决权的,可选择直接送交、邮寄2种方式送交纸面授权文件。

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为:2018年11月16日15:00。

纸面授权资料应在授权截止时间之前送达,具体地址及联系方式如下:

地址:华宝基金管理有限公司

中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

收件人:于帅

联系电话:021-38505904

封面请注明:“上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会授权”。

4、授权效力确定规则

(1)如果同一基金份额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。

(4)如基金份额持有人授权他人出席本次大会后,又亲自出席本次大会进行投票表决的,以其本人亲自投票的表决意见为准。

5、以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

6、基金管理人可接受本基金基金份额持有人的委托,以本基金基金份额持有人代理人的身份参加本基金及/或目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。

7、投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-700-5588或021-38924558咨询。

八、会议召开的条件

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定;

2、经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上。

九、计票

1、大会主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(监督员由基金托管人担任)共同担任监票人。

2、监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

3、如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4、计票过程由公证机关予以公证。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

十、形成基金份额持有人大会决议的条件

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

2、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。基金份额持有人或代理人在表决票上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。表决意见模糊不清或相互矛盾的、未填或未投的表决票视为投票人放弃表决权利,其所持份数的表决结果均计为“弃权”。

3、《关于华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》应当由参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过;

4、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。

十一、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》的规定,本次持有人大会需要全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,根据2013年6月1日生效的新修订的《基金法》,本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

十二、本次大会相关机构

1、召集人:华宝基金管理有限公司

联系地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海环球金融中心58楼

联系人:于帅

联系电话:021-38505888

传真:021-38505777-904

客户服务电话:400-700-5588、021-38924558

网址:www.fsfund.com

2、基金托管人:中国银行股份有限公司

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

3、公证机关:上海市东方公证处

联系地址:上海市凤阳路660号

联系人:林奇

联系电话:021-62154848

邮政编码:200041

4、见证律师事务所:上海市通力律师事务所

注册及办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话:021-31358666

联系人:陆奇

十三、重要提示

1、本基金转型后目标ETF为华宝中证银行ETF,标的指数为中证银行指数。在华宝中证银行ETF联接基金的投资组合比例需符合基金合同的有关约定之前,本基金可能产生较大跟踪偏离度和跟踪误差。

2、基金管理人将在发布本公告后2个工作日内连续公布相关提示性公告,就本次会议相关情况做必要说明,请予以留意。

3、本次会议将于2018年11月19日10:00召开,届时基金管理人、基金托管人、基金管理人聘请的公证机关人员以及见证律师将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记,请出席会议人员务必按照本公告的要求,携带必需的文件提前半小时至会议地点,以便验证入场。主持人宣布会议开始后,不再对未登记的基金份额持有人进行登记,未登记的持有人不得入场参加会议。基金份额持有人应当保持会议秩序,服从召集人的引导,除出席会议的基金份额持有人(或代理人)、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外,召集人有权依法拒绝其他人士入场,对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为,召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

4、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站(www.fsfund.com)查阅,投资者如有任何疑问,可致电客服电话400-700-5588或021-38924558咨询。

5、本通知的有关内容由华宝基金管理有限公司负责解释。

华宝基金管理有限公司
2018年10月22日

附件一:《关于华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》

附件二:授权委托书(样本)

附件三:《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》

附件一:

关于华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案

华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人:

由于市场环境变化,为更好地满足投资人需求,维护基金份额持有人利益,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》和《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,基金管理人华宝基金管理有限公司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,提议对华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证180成长ETF联接基金”)实施转型并修改《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》。具体内容详见附件三《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》。

为实施上证180成长ETF联接基金转型方案,提议投权基金管理人办理本次上证180成长ETF联接基金转型的有关具体事宜,包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式,根据现时有效的法律法规的要求和《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》等相关法律文件进行修订,并根据《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书》对华宝上证180成长ETF联接基金实施转型。

以上议案,请予审议。

基金管理人:华宝基金管理有限公司
2018年10月22日

附件二:

授权委托书

兹委托　　代表本人(或本机构)参加(请以打“√”方式选择授权受托人参加的基金份额持有人大会):

□于　年　月　日的以现场方式召开的华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会

□于　年　月　日的以现场方式召开的上证180成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会

并代为全权行使对上述勾选的基金份额持有人大会所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至上述基金份额持有人大会会议结束之日止。若华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金或上证180成长交易型开放式指数证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):

委托人身份证件号或营业执照注册号:

委托人基金账户号:

受托人(代理人):(签字/盖章):

受托人(代理人)身份证件号码或营业执照注册号:

委托日期:　年　月　日

附注:此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件三:

华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型方案说明书

华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证180成长ETF联接基金”或“本基金”)基金合同于2011年8月4日生效。为更好地满足投资人需求,维护基金份额持有人利益,根据《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》和《华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“基金合同”)等有关规定,本基金管理人(华宝基金管理有限公司)经与基金托管人(中国银行股份有限公司)协商一致,决定召开基金份额持有人大会,审议《关于华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》。

本次上证180成长ETF联接基金转型事宜属上证180成长ETF联接基金原注册事项的实质性调整,经基金管理人向中国证监会申请,已经中国证监会准予变更注册。

本次上证180成长ETF联接基金转型方案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上(含50%)通过,存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会决议通过的事项,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的,从其规定。

中国证监会对本次华宝上证180成长ETF联接基金变更注册所作的任何决定或意见,均不表明其对本次转型方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

一、上证180成长ETF联接基金转型方案要点

(一)更名

基金名称由“华宝上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金”更名为“华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金”以下简称(“华宝银行ETF联接基金”)。

(二)转型后基金合同的持有人大会条款

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人的每一基金份额拥有平等的投票权。

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的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。

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。

本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。

一)召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定外,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:

(1)终止《基金合同》;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)变更基金投资目标、范围或策略;

(9)变更基金份额持有人大会程序;

(10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

(11)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(12)对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(13)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况在法律法规和《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,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:

(1)法律法规要求增加的基金费用的收取;

(2)调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式;

(3)因相应的法律法规、证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(4)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;

(5)基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则;

(6)在对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项)的前提下,变更标的指数或业绩比较基准;

(7)基金推出新业务或服务;

(8)增加、减少、调整基金份额类别设置;

(9)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

二)会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

4、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

5、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30日,在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:

(1)会议召开的时间、地点和会议形式;

(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;

(3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;

(4)授权委托证明的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

(5)会务常设联系人姓名及联系电话;

(6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7)召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

四)基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理授票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

(1)亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理授票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

(2)经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。

若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以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基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以会议通知载明的形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1)会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人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基金总份额的二分之一(含二分之一);

若本人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小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以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基金份额持有人大会。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)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见;

(4)上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理授票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,本基金可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

五)议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则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。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

六)表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

1、一般决议,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)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议,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)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出席表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

七)计票

1、现场开会

(1)如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

九)本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规的部分,如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

(三)转型后基金投资目标、投资范围和投资策略、投资限制等投资相关条款

1、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。

2、投资范围

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股、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)、货币市场工具、股指期货、资产支持证券、权证以及法律法规或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。

基金的投资组合比例为: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%。本基金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,持有现金(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不低于基金资产净值的5%。股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

3、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。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的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

1)资产配置策略

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%;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,持有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%。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股、债券、货币市场工具、股指期货、资产支持证券、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

i.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