大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告

一、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》的有关规定和《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的管理人大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）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，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2020年11月24日起，至2020年12月24日17:00止（以本公告列明的公证机关指定的表决票收件人收到纸质表决票的时间为准或以基金管理人系统记录时间为准；纸面表决时间在2020年12月24日17:00以后的为无效表决，电话及短信方式表决时间在2020年12月18日17:00以后的为无效表决）

3、纸质表决票的寄达地点

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司
地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心1601室
邮政编码：100035
联系人：吕婧
联系电话：400-888-5558，010-88009300
传真：010-85252282

请在信封背面注明：“大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

4、短信投票形式表决票的提交（仅适用于个人持有人）

短信投票形式的表决票按本公告规定的方式回复至基金管理人指定的短信平台。

二、会议审议事项

本次持有人会议审议事项为《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的说明》（附件四）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年11月24日，即该日在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人或其委托代理人享有本次会议的表决权。

四、投票方式

（一）纸质投票

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（www.dcfund.com.cn）下载等方式下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（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表决票的其他证明文件，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；

（3）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”部分规定的授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人（或代理人，下同）接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权”部分之“（三）授权方式”之“1、纸面方式授权”之“（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件。

以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等文件，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2020年11月24日起，至2020年12月24日17:00以前（以本公告列明的表决票收件人收到纸质表决票的时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司
地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心1601室
邮政编码：100035
联系人：吕婧
联系电话：400-888-5558，010-88009300
传真：010-85252282

请在信封背面注明：“大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

（二）电话投票（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会投票，自2020年11月24日起，至2020年12月18日17:00以前（以基金管理人系统记录时间为准），基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话400-888-5558并按提示转人工坐席进行投票。

基金管理人也将通过客服电话主动与预留联系方式的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投票记录从而完成投票。

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投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

（三）短信投票（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会投票，基金管理人将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集投票短信，持有人可根据征集投票短信的要求回复短信表明表决意见，回复时间自2020年11月24日起，至2020年12月18日17:00为止（以基金管理人系统记录时间为准）。

基金份额持有人通过短信投票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投票。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行投票，请投资者采用纸质方式进行投票。

五、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。

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。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面、短信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三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（www.dcfund.com.cn）下载等方式获取授权委托书样本。

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，受托人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2）机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）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、有权部门的批文或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2、电话方式授权

为方便基金份额持有人参与大会，基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话400-888-5558并按提示转人工坐席进行授权。

基金管理人也将通过客服电话主动与预留联系方式的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、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，持有人可根据征集授权短信的要求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。短信授权仅支持授权给基金管理人模式。

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。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行授权，请投资者采用纸质方式进行授权。

4、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短信方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的，以时间在最后的一次有效纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的，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，视为无效授权；

（2）如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在有效短信方式授权的，以有效短信方式的授权为准；

（3）如果同一基金份额以短信方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。同时多次以短信方式进行授权的，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，视为无效授权；

（4）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，视为无效授权。

（5）如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下在所通知的表决截止日期后第2个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交、邮寄或传真送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准。通过短信方式表决的，表决时间以系统记录时间为准。表决时间在相应表决方式对应的截止时间以后的，为无效表决。

（2）如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和短信方式有效表决的，以有效的纸面表决为准。

（3）纸面表决票的效力认定

纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

3）送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准，传真的以本公告规定的收件人传真接收到的时间为准。

（4）如果同一基金份额以短信方式进行多次表决的，以时间在最后的表决为准。

七、决议生效条件

本次会议召开的条件为：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权益登记日基金总份额的50%（含50%）。

本会议表决的票数要求为：基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权，不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按一般决议处理，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50%以上（含50%）通过方为有效。

基金份额持有人大会的决议，自表决通过之日起生效，基金管理人应当自决议通过之日起5日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《基金合同》的规定，本次持有人大会需要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权益登记日基金总份额的50%（含50%）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，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。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。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做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。

九、本次大会相关机构

1、召集人：大成基金管理有限公司
联系地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人：教姣
联系电话：0755-83183388
传真：0755-83199588
客户服务电话：400-888-5558
网址：www.dcfund.com.cn

2、监督人：中国银行股份有限公司
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号
托管部门信息披露联系人：王永民
中国银行客服电话：95566

3、公证机构：北京市长安公证处
地址：北京市东城区朝阳门北大街6号首创大厦7层
联系人：陆晓冬
电话：010-65543888-8066
邮政编码：100027

4、见证律师：上海源泰律师事务所
地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
联系电话：021-51150298
联系人：张雯倩

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交纸质表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本基金份额的首次停牌时间为本公告刊登日（2020年11月24日）开市起至当日10:30。本基金份额第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2020年12月25日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止（如基金份额持有人大会决议生效公告发布日为非交易日，则发布日后首个交易日开市起复牌）。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

3、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查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-5558咨询。

基金管理人将在发布本公告后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本公告的有关内容由大成基金管理有限公司负责解释。

大成基金管理有限公司
二〇二〇年十一月二十四日

附件一：《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》
附件二：《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会通讯表决票》
附件三：《授权委托书》
附件四：《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的说明》附件一：

关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案

大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）份额持有人：

根据市场环境变化，考虑到大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的长期发展及持有人的利益，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》的有关规定和《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，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，审议修改《基金合同》等相关事项，修改内容包括调整投资范围、投资策略以及增加C类份额等，并修改基金合同中根据上述调整需要同步进行修改的相关内容以及按照最新的法律法规及证监会要求修改的内容。具体修改方案请见附件四：《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的说明》。

为实施大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改《基金合同》方案，提议授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于根据《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的说明》的相关内容调整投资范围、投资策略以及增加C类份额等，并对《基金合同》等法律文件进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：大成基金管理有限公司
二〇二〇年十一月二十四日

附件二：

大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人名称：
证件号码(身份证号/营业执照号等)：
基金账户号：
表决事项：关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案
表决结果：
□同意 □反对 □弃权
机构基金份额持有人或代理人签章栏 个人基金份额持有人或代理人签字栏
单位公章：签字：
日期：日期：

说明：

1、请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”；

2、如纸面表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

3、“基金账户号”仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

4、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托 先生／女士或 单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为2020年12月24日17:00的以通讯方式召开的大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并代为行使表决权。表决意见以受托人（或代理人，下同）的表决意见为准。若在法定时间内就同一议案重新召开基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人签名/盖章：
委托人身份证号或营业执照号等：
基金账户号：
受托人签章（受托人为自然人则签字/受托人为机构则盖公章）：
受托人证件号码(身份证号或营业执照号等)：
委托日期： 年 月 日

说明：

1、本授权委托书可剪报、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。

2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

附件四：

关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的说明

一、声明

1、根据市场环境变化，考虑到大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）的长期发展及持有人的利益，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》的有关规定和《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，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《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》。

2、本次修改基金合同事宜属于原注册事项的实质性变更。

3、本次基金合同修改方案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。

4、基金份额持有人大会的决议，自表决通过之日起生效。修改后《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效时间将由基金管理人另行公告。

二、方案要点

（一）修改后的《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效前的基金运作

在修改后的《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效前，本基金仍按照《基金合同》约定的运作方式进行运作。

（二）本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将在修改后的《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效前安排选择期供基金份额持有人做出选择（如赎回、转换转出或者卖出），具体时间安排详见基金管理人发布的相关公告。

（三）修改后的《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效后的基金运作

1、通过《关于大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）修改基金合同等相关事项的议案》的基金份额持有人大会决议自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。基金管理人将自决议生效之日起2日内按规定在规定媒介上公告。

2、基金管理人应当自修改后的《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合修改后的基金合同的有关约定。

（四）变更后基金的份额类别设置

本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额为在投资人申购时收取前端申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码。两类份额之间不能转换。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书及基金产品资料概要中公告。在不违反法律法规、基金合同的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可在履行适当程序后调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

（五）变更后基金的投资范围、投资策略和基金合同的其他修改

A、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、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、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货，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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例为基金资产的60%-95%（港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的50%），本基金投资中小盘股票的资产不低于基金非现金资产的80%。

本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

B、投资策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的方法进行主动投资策略，以宏观经济和政策研究为基础，通过分析影响证券市场整体运行的内外部因素，进行自上而下的资产配置和组合管理，同时自下而上的精选各个行业中具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票进行投资。

1、大类资产配置策略

本基金的大类资产配置将重点分析宏观经济指标、微观经济指标、市场方面指标和政策因素，研究我国国民经济发展过程中的结构化特征，通过对于国家宏观经济运行趋势、产业政策、社会热点等因素的准确判断和把握，自上而下的实施大类资产间的战略配置。

本基金在考虑大类资产配置比例主要考虑以下指标：

（1）宏观经济指标：包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等；

（2）微观经济指标：包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期；

（3）市场方面指标：包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场情况、市场资金供求情况；

（4）政策因素：与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。

2、股票投资策略

（1） 中小盘股票的界定：A、基金管理人每季度末对中国A股市场的股票按流通市值自小到大进行排序，累计流通市值占A股总流通市值70%的股票；B、基金管理人每季度末对港股市场的港股通标的股票按流通市值自小到大进行排序，累计流通市值占港股通标的股票流通总市值70%的股票，均称为中小盘股票。在此期间对于未纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其流通市值（对未上市新股而言为本基金管理人预计的流通市值）可满足以上标准，也称为中小盘股票。基金因所持有股票价格的相对变化 而导致中小盘股票投资比例低于基金合同规定的范围，本基金管理人将根据市场情况，本着投资者利益最大化的原则，适时予以调整，最长不超过3个月。

（2）中小盘股票的选股标准

本基金管理人坚持“超额收益来自超越市场的深入研究”的投资理念，对中小盘股票的投资采取案头研究与实地调研等方法，对拟投资企业进行分析，包括对拟投资股票所在行业进行分析，走访上市公司及其上下游企业、调研公司的竞争对手、与公司经营管理层和员工谈话等，选择商业模式和发展战略清晰，成长空间广阔，公司治理结构良好、估值较低的股票进行投资。

1）商业模式和发展战略清晰

本基金关注公司管理层对企业的长期发展是否有着明确的发展方向和清晰的经营思路。

2）具有较高成长性

本基金主要投资具有较高成长性的企业。较高成长性指的是企业未来净利润增长率高于上市公司平均水平、行业平均水平。本基金管理人将重点关注有可能成为未来经济驱动力的行业中具有较高增长潜力的中小市值公司，这些中小市值公司短期或长期增长率位居行业前列。

企业业绩出现高于上市公司平均水平或行业平均值的原因主要包括：行业处于成长周期或者出现行业景气；公司通过改进管理来降低能耗和生产成本，提高产能利用率；企业加大营销力度，开拓新市场；开发与引进新技术；新建产能以及收购外部生产能力等；产能大幅提高，并有相应的市场需求；技术水平出现突破性进展；行业景气回升，产品价格和毛利率大幅提高；资产重组、收购兼并等。

3）在行业内具有较强的竞争优势

本基金优先投资行业内的龙头企业，即在行业中市场占有率及盈利能力综合指标位居前列的企业，也包括经过快速成长即将成为行业龙头的企业；而且该行业具有较大的发展空间，行业景气度较高；

4）公司治理结构良好

公司具有较好的治理结构，公司管理层关心社会股东利益，关联交易按公平价格或有利于社会股东的价格成交并充分披露，在股息分派、融资、收购兼并、高管及员工的股权激励等政策制定中都充分考虑到将社会股东的利益放在首位。

（3）评估中小盘股票的投资价值

投资价值评估是根据一系列历史和预期的财务指标，结合定性考虑，分析公司盈利稳固性，判断相对投资价值，主要指标包括：企业价值倍数（EV/EBITDA），市售率、市盈率、市净率、股息率、净资产收益率、经营利润率和净利润率等。分析师将根据行业特点选择合适的指标进行估值。

（4）港股投资策略

本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票投资策略外，还需关注：

1）香港股票市场制度与中国内地股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面；

2）人民币与港币之间的汇兑比率变化情况。

3、债券投资策略

主要通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等策略配置债券资产，力求在保证债券资产总体的安全性、流动性的基础上获取稳定收益。

（1）利率预测分析

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益。当预期利率下调时，适当加大组合中长久期债券的投资比例，为债券组合获取价差收益；当预期利率上升时，减少长久期债券的投资，降低债券组合的久期，以控制利率风险。

（2）收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券组合内部品种的比例，获得投资收益。

（3）债券信用分析

通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行深入、细致的调研，准确评价债券的违约概率，提早预测债券评级的改变，捕捉价格优势或套利机会。

（4）收益率利差分析

在预测和分析同一市场不同板块之间、不同市场的同一品种之间、不同市场不同板块之间的收益率利差的基础上，采取积极投资策略，选择适当品种，获取投资收益。

4、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

套期保值实质上是利用股指期货多空双向和杠杆放大的交易功能，改变投资组合的Beta，以达到适度增强收益或控制风险的目的。为此，套期保值策略分为多头套期保值和空头套期保值。多头保值策略是指基于股市将要上涨的预期或建仓要求，需要在未来买入现货股票，为了控制股票买入成本而预先买入股指期货合约的操作；空头套期保值是指卖出期货合约来对冲股市系统性风险，控制与回避持有股票的风险的操作。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成，决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在构建套期保值组合过程中，基金管理人通过对股票组合的结构分析，分离组合的系统性风险（beta）及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合beta值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰，通过大量数据分析与量化建模，确立最优套保比率。

在套期保值过程中，基金管理人将不断精细和不断修正套保策略，动态管理套期保值组合。主要工作包括，基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理；对投资组合beta系数的实时监控，全程评估套期保值的效果和基差风险，当组合beta值超过事先设定的beta容忍度时，需要对套期保值组合进行及时调整；进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。

6、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，以套期保值为目的投资国债期货，力求实现基金资产的长期稳定增值。

C、基金合同的其他修改

本次修改基金合同将根据上述调整同步对基金合同等法律文件进行相关内容修改，以及按照最新的法律法规及中国证监会的要求修改相关内容。基金合同具体修改情况详见“附表：《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同修订对照表》”。

三、选择期的相关安排

本次基金份额持有人决议生效后，基金管理人将在修改后的《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效前安排选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转换转出或者卖出）。在此期间，投资者可正常进行申购（含转换转入）、赎回（含转换转出）、二级市场买卖交易等业务。

选择期结束后，未全部赎回或转出本基金基金份额的投资者将默认适用修改后的《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同》，其持有的基金份额仍为大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金份额。

具体选择期时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

在选择期期间，由于需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况暂停申购、赎回或调整赎回方式等。

四、基金修改基金合同的主要风险及预备措施

（一）持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定，本次份额持有人大会需要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权益登记日基金总份额的50%（含50%） 方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将在会前与基金份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

（二）修改基金合同的方案被持有人大会否决的风险

在方案公告之前，基金管理人将面向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对本基金修改基金合同的方案等进行适当的修订。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间，或更改其他会务安排。

如果修改基金合同的方案未获得持有人大会批准，基金管理人将按照有关规定重新召集基金份额持有人大会，重新向持有人大会提交新的议案，或者采取修改方案等其他合适的方式。

（三）基金修改基金合同前后遭遇大规模赎回的风险

为应对修改基金合同前后可能遭遇的大规模赎回，本基金在修改基金合同期间将保证投资组合的流动性，以应对修改基金合同前后可能出现的较大赎回，降低净值波动率。

（四）预防及控制在修改基金合同过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，防范大额申购赎回或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况对可能存在的市场投资风险进行有效的评估，科学有效地控制基金的市场风险。

附表：《大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）基金合同修订对照表》

章节	原文条款	修改后条款	修改理由
	内容	内容	
第一部分前言	无	六、基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。 七、基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股，存在不对港股进行投资的可能。	根据本基金变更注册后的实际情况补充风险提示。
	无	八、当本基金持有特定资产且存在潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，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。	根据法律法规修订补充风险提示。
	无	九、本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。	根据法律法规修订补充。
第二部分释义	无	14、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所和深圳证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票	根据变更注册后的实际情况补充释义。
	15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会	16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会	完善相关表述。
	41、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日	42、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时的公告为准）	根据变更注册后的实际情况完善释义。
	无	58、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用 59、基金份额类别：本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额为在投资人申购时收取前端申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额	根据变更注册后的实际情况补充释义。
	58、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介	61、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介	根据本基金变更注册的实际情况调整。（《基金合同》中关于“规定媒介”的同类修改不再一一列举。）
	无	62、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待 63、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 64、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产	根据本基金变更注册的实际情况补充相关释义。
第三部分基金的基本情况	无	七、基金份额类别 本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额为在投资人申购时收取前端申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额。 本基金A类和C类基金份额分别设置代码。两类份额之间不能转换。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。 有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书及基金产品资料概要中公告。在不违反法律法规、基金合同的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可在履行适当程序后调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。	根据本基金变更注册的实际情况补充增设基金份额类别的相关规定。
第四部分基金的历史沿革	无	大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于XX年XX月XX日表决通过了大成中小盘混合型证券投资基金（LOF）调整投资范围、投资策略以及增加C类份额等事项的议案，根据决议内容，本基金基金合同亦进行相应修改。	根据本基金变更注册的实际情况补充。
第五部分基金的存续	二、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，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，如转换运作方式或与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。	二、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，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50个工作日出现前述情形的，《基金合同》自动终止，无需召开基金份额持有人大会。	根据本基金变更注册的实际情况补充。
第六部分基金份额的申购与赎回和上市交易	一、申购和赎回场所 本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。 投资人可以通过场外、场内两种方式申购赎回本基金份额。本基金场外申购和赎回场所为场外销售机构的销售网点，场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。 办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。	一、申购和赎回场所 本基金A类基金份额可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回，C类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。 本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金场外申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及各场外销售机构的基金销售网点，场内申购和赎回场所为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位。通过场外申购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内申购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。本基金场内、场外销售机构名单将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金管理人可以根据情况开通本基金C类份额场内方式的申购赎回，并予以公告。 基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。	二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	五、申购和赎回的数量限制 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。	五、申购和赎回的数量限制 3、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。 6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。…… 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。…… 4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。	六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本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，由此产生的收益或损失由基金财产承担。…… 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金A类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份。…… 4、本基金A类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的投资人承担，不列入基金财产。C类基金份额不收取申购费用。 7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	七、拒绝或暂停申购的情形 7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。	七、拒绝或暂停申购的情形 7、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。 发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；……	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 5、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。 发生上述情形时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；……	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	十一、基金份额的上市交易 基金管理人可以根据有关规定，申请本基金基金份额上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记在证券登记结算系统中，再上市交易。 3、上市交易的规则 （1）本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值； （2）本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行； （3） 本基金买入申报数量为100份或其整数倍； （4）本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币； （5）本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。 4、上市交易的费用 本基金上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。 5、上市交易的行情揭示 本基金在深圳交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。 6、上市交易的注册登记 投资人T日买入成功后，注册登记机构在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自T+1日（含该日）后有权卖出该部分基金；投资人T 日卖出成功后，注册登记机构在T日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。 7、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。	十一、基金份额的上市交易 1、基金的上市条件 基金合同生效后，如基金具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请本基金A 类基金份额的上市交易。 （1）本基金场内资产净值不少于 2 亿元人民币； （2） 本基金场内份额持有人不少于 1000人； （3）《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。 在确定上市交易的时间后，基金管理人将依据法律法规的规定在规定媒介刊登基金份额上市交易公告书。 本基金A类基金份额上市交易后，登记在证券登记结算系统中的A类基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的A类基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记在证券登记结算系统中，再上市交易。 4、上市交易的规则 本基金A类基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定。 5、上市交易的费用 本基金A类基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。 6、上市交易的行情揭示 本基金A类基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示本基金A类基金份额前一交易日的基金份额净值。 7、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市 上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市等按照《基金法》等相关法律法规以及《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等相关业务规则、通知、指引、指南等有关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。 当本基金发生深圳证券交易所相关业务规则规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将变更为非上市的证券投资基金，除此之外，本基金的基金名称、基金费率、基金的投资范围和投资策略等均不变，无需召开基金份额持有人大会。基金变更并终止上市后，对于本基金场内份额的处理规则，由基金管理人提前制定并公告。 9、若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司允许本基金 C类基金份额上市交易或增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能，且此项修改无须召开基金份额持有人大会审议。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	无	十七、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。	根据本基金变更注册的实际情况补充。
第七部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 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： （8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合《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、赎回对价；	一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务 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： （8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回价格的方法符合《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、赎回价格；	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （11） 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；	二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外；	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	三、基金份额持有人 …… 每份基金份额具有同等的合法权益。 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： （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；	三、基金份额持有人 …… 除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。 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： （4）缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；	根据本基金变更注册的实际情况调整。
第八部分基金份额持有人大会	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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。	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。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	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： （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外； 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： （1）调低基金管理费、基金托管费； （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；	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： （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； 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对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： （2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率及销售服务费率； （3）调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整；	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	八、生效与公告 …… 基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作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。	八、生效与公告 …… 基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。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。	根据本基金变更注册的实际情况调整。
	无	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份额的二分之一（含二分之一）； 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）； 4、当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3个月以后、6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； 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50%以上（含50%）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； 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； 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。 侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一类别账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。 侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关约定。	根据本基金变更注册的实际情况补充。

（下转B98版）