华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第二次提示性公告

华安基金管理有限公司决定以通讯开会方式召开华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并于2018年8月30日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.huaan.com.cn）发布了《华安基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》，并于2018年8月31日在上述报纸和网站发布了《华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，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《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）（以下简称“华安中证定向增发事件LOF”或“本基金”）的基金管理人华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）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，审议《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2018年9月10日起，至2018年10月8日17:00止（以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件LOF基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

邮政编码：200120

联系人：谈媛

联系电话：021-38969931

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》（以下简称“《议案》”，详见附件一）。

上述议案的内容说明详见《〈关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案〉的说明》（详见附件四）。

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9月7日，即2018年9月7日下午交易时间结束后，在本基金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。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站（www.huaan.com.cn）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相关的业务专用章（以下简称“公章”），并提供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自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（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有效身份证件复印件，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和证券账户卡复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供持有人的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供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和证券账户卡复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（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。

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2018年9月10日起，至2018年10月8日17:00以前（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“华安中证定向增发事件LOF基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人的办公地址及联系办法如下：

收件人：华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件LOF基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期 31、32层

邮政编码：200120

联系人：谈媛

联系电话：021-38969931

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话40088-50099（免长途费）咨询。

五、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本基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下在所通知的表决截止日期后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、本基金基金份额持有人的表决权

本基金基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，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。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，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。

（3）如表决票上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指定联系地址的，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。

（4）基金份额持有人重复提交表决票的，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，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；

2、本次议案须经参加会议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）通过方为有效；

3、本次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定的事项自持有人大会表决通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）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。

八、本次大会相关机构

1、召集人（基金管理人）：华安基金管理有限公司

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：傅匀

联系方式：021-62154848

4、律师事务所：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、上述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.huaan.com.cn）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40088-50099（免长途话费）咨询。

3、本基金的首次停牌时间为《华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》刊登日当天（2018年8月30日）开市起至当日10:30止，10:30后恢复交易。本基金第二次停牌的时间为基金份额持有人大会计票之日（2018年10月9日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30止。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4、若本次基金份额持有人大会表决通过本基金的转型事宜，则基金管理人将在转型实施前预留不少于二十个开放日供持有人选择赎回或转出。特别提请投资人关注本基金转型的风险。

5、本公告的有关内容由华安基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《〈关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案〉的说明》

华安基金管理有限公司

2018年9月3日

附件一：《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》

华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》和《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议以对华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）进行转型，基金名称变更为“华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，基金类别变更为“股票型证券投资基金、ETF联接基金”，并修改标的指数、基金份额的上市交易、基金份额的申购赎回、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、费率水平、收益分配原则、估值方法等相关事项。具体说明可参见附件四《〈关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案〉的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

华安基金管理有限公司

2018年8月30日

附件二：《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票》

华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
证券账户卡号/开放式基金账户号：			
审议事项	同意	反对	弃权
关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案			
基金份额持有人/（受托人）代理人签名或盖章 年 月 日			
说明： 1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人持有的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。 2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的（且其他各项符合会议通知规定）的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签字/盖章部分不完整、不清晰的，将视为无效表决。			

（本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站（www.huaan.com.cn）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：《授权委托书》

兹授权先生/女士或机构代表本人（或本机构）参加投票截止日为2018年10月8日的以通讯方式召开的华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。

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。若本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号：

委托人证券账户卡号/开放式基金账户号：

代理人（签字/盖章）：

代理人身份证件号或营业执照号：

委托日期：年月日

授权委托书填写注意事项：

1、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、委托人为机构的应当于名称后加盖公章，个人则为本人签字；

3、以上授权是持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权；

4、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。

附件四：《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》的说明

华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）于2017年4月11日成立，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》。本次华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更事宜属于实质性调整，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。

本次华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更方案需经参加会议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）通过，因此变更方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人，本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额须占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且自本次基金份额持有人大会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安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次修改方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

具体方案如下：

一、方案要点

（一）更名

基金名称由“华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）”更名为“华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。

（二）变更后基金的基本情况

1、基金的名称：华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

2、基金的类别：股票型证券投资基金、ETF联接基金。

3、目标ETF：华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金，已于2016年6月30日成立，2016年7月22日于深圳证券交易所上市交易。

4、标的指数：创业板50指数。

5、基金的运作方式：契约型开放式。

6、基金的投资目标：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。

7、基金存续期限：不定期。

（三）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等投资相关

1、投资目标

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、标的指数成份股及其备选成份股，把接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、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）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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：投资于目标ETF的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，应当保持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、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

3、投资策略

本基金为目标ETF 的联接基金，目标ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。

本基金通过把接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（1）资产配置策略

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及其备选成份股投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、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），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。

（2）目标ETF投资策略

本基金投资目标ETF的方式如下：

1）申购和赎回：目标ETF开放申购、赎回后，以股票组合进行申购、赎回或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购、赎回目标ETF。

2）二级市场方式：目标ETF上市交易后，在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

（3）股票投资策略

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。

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。

（4）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。

（5）股指期货投资策略

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，达到有效跟踪标的指数的目的。

（6）权证投资策略

本基金在实现权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，谨慎地进行投资，以追求较为稳定的收益。

（7）资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（8）参与融资业务的投资策略

本基金在参与融资业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

4、投资限制

（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）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、存出保证金和应收申购款等；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（6）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%；

（7）本基金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%；

（8）本基金持有的同一(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%；

（9）本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%；

（10）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；

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

（12）基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：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%；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；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基金持有的股票总市值的20%；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%；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；

（13）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%；本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（14）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（15）本基金参与融资时遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

（16）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

（17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（18）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（1）、（2）、（10）、（17）、（18）项外，因证券或期货市场波动、证券发行人合并、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申购、赎回、交易被暂停或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合第（1）项规定的比例，基金管理人应当在20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自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基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

5、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：95% × 创业板50指数收益率＋5% × 商业银行税后活期存款利率。

由于本基金为ETF联接基金，投资组合中本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，并且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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。因此，设定本基金的业绩比较基准为“95% × 创业板50指数收益率＋5% × 商业银行税后活期存款利率”，该基准能较为客观的衡量本基金的投资绩效。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。其中，若变更业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更业绩比较基准召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若业绩比较基准的变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），经基金管理人与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。

6、风险收益特征

本基金属于目标ETF的联接基金，目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。

（四）变更后的基金资产估值方法

1、目标ETF份额的估值

本基金投资的目标ETF份额以估值日目标ETF的基金份额净值估值，若估值日目标ETF未公布净值，以其最近估值日的基金份额净值估值。如果基金管理人认为按上述价格不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。

2、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

3、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票和权证，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）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、交易所市场交易的固定收益品种（指在上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、资产支持证券、同业存单等债券品种，下同）的估值：

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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；

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

5、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、当发生大额申购或赎回时，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。

10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

（五）变更后基金的费率水平

1、年化管理费率：0.5%（本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费）。

2、年化托管费率：0.1%（本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费）。

3、申购费率

本基金申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

除养老金客户外，其他投资人申购本基金的申购费率如下表所示：

单笔申购金额（M）	申购费率
M＜100万	1.2%
100万≤M＜300万	0.8%
300万≤M＜500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户申购费率为500元/笔。

4、赎回费率

本基金的赎回费率按持有期递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产，对持续持有期不少于7日的投资人收取的赎回费，不低于赎回费总额的25%归基金财产。具体费率如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7天	1.50%
7天≤Y＜1年	0.50%
1年≤Y＜2年	0.25%
2年≤Y	0

注：1年为365天，2年为730天。

基金份额持有人在基金终止上市前持有的原华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）份额，持有期限不受影响持续计算。

（六）变更后基金的收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

（七）授权基金管理人修订基金合同

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的产品特征修订基金合同的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订基金合同。

（八）关于基金转型安排

本次持有人大会决议生效后，本基金将在转型正式实施前安排不少于二十个交易日的选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回或者卖出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。选择期期间，本基金将开放场内赎回和场外赎回等业务。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）份额将于新基金合同生效后转换为华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额。选择期内，本基金豁免《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》约定的投资组合比例、投资策略等约定。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。

选择期内，本基金豁免遵守基金合同中关于基金投资目标、投资组合比例等的相关规定。对于申请赎回的投资者，除持有期限不满7日收取1.5%的赎回费并全额归入基金财产外，不收取赎回费。

本基金转型为华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金后，将进入封闭期，封闭期不超过三个月，在封闭期最后一个工作日，基金份额持有人所持有的基金份额在其资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.0000元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。具体份额折算方案请见基金管理人届时发布的公告。

原本基金的场内基金份额将由中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记系统统一变更登记至中国证券登记结算有限责任公司登记结算系统。原本基金场内份额的基金份额持有人需要对其持有的基金份额进行重新确认与登记（即确权登记），办理确权登记后，方可通过相关销售机构办理华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的赎回等业务。办理确权登记的具体时间和相关业务规则请见基金管理人届时发布的公告。

（九）《华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的生效

依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》失效，《华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自同一日起生效。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会，授权基金管理人按照现行有效的法律法规的规定及《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同等相关事项的议案》的方案要点修订基金合同并实施转型方案。

二、基金管理人就方案相关事项的说明

1、华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基本情况

华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）遵照《中华人民共和国证券投资基金法》于2017年4月11日成立，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，基金募集规模达309,484,316.78份基金份额，已顺利运作至今。

2、基金管理人将严格保证基金合同修订的合法合规

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同。修订后的基金合同已经基金管理人和基金托管人签字盖章，并已经中国证监会变更注册。

3、关于本次基金份额持有人大会费用的说明

根据《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会费用以及律师费等相关费用可从基金资产列支。

三、转型方案的可行性

1、法律可行性

在《基金法》第八十三条到第八十六条对基金持有大会的召集人、召开形式以及其相关事宜都作了规定与说明，这为基金持有大会的召开流程提供了法律依据。

本次基金份额持有人大会决议属于一般决议，经参加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）通过，决议即可生效。

因此，基金转型方案不存在法律方面的障碍。

2、技术可行性

为了保障华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）持有人大会的顺利召开，基金管理人成立了工作小组，筹备、执行份额持有人大会相关事宜。基金管理人与基金托管人、律师事务所、公证机关、投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。

本基金的基金管理人、基金托管人已就本次转型方案进行了充分沟通和细致准备，技术可行。

因此，转型方案不存在运营技术层面的障碍。

四、转型方案的主要风险及预备措施

本次基金转型的主要风险是议案被持有人大会否决的风险。

在设计转型并确定具体方案之前，基金管理人已同基金份额持有人进行了沟通，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，基金管理人还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对转型方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

若本次基金份额持有人大会表决通过本基金的转型事宜，则基金管理人将在转型实施前预留不少于二十个开放日供持有人选择赎回或转出。特别提请投资人关注本基金转型的风险。

如果转型方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向持有人大会提交转型并修改基金合同等相关事项的议案。

附件：《华安中证定向增发事件指数证券投资基金 （LOF） 基金合同》（“《基金合同》”）与《华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（“《基金合同》（修订）”）修改前后对照表

章节	《基金合同》	《基金合同(修订)》
全文修改基金名称	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）	华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金
第一部分前言	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。	2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。
第一部分前言	三、华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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”)注册。 中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。	三、华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来，华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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”)注册，变更后的华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金已经中国证监会变更注册。 中国证监会对华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
第二部分释义	1、基金或本基金：指华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF） 7、基金份额发售公告：指《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》 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 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 23、销售机构：指华安基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所办理基金销售业务的会员单位 26、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户 27、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户 28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 29、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 31、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月 38、《业务规则》：指本基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订 39、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为 42、上市交易：指基金投资者通过深圳证券交易所会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为 43、场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回 44、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回 46、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管及跨系统转托管 47、系统内转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为 48、跨系统转托管：指投资者将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统之间进行转托管的行为 49、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统 50、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统 55、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和 59、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等	1、基金或本基金：指华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金，本基金由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来 删除7。 增加： 7、目标ETF：指另一经中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金（以下亦简称“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。本基金选择华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“创业板50ETF”）为目标ETF 14、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等 15、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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待 17、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 24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 25、销售机构：指华安基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构 28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户 删除27。 29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管、定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 30、基金合同生效日：指《华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效日，原《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》自同一日起失效 删除31。 38、《业务规则》：指本基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司及销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订 删除39。 删除42。 删除43。 删除44。 42、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作 删除47。 删除48。 删除49。 删除50。 47、基金资产总值：指基金拥有的目标ETF份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和 删除59。
第三部分基金的基本情况	二、基金的类别 股票型证券投资基金 四、上市交易所 深圳证券交易所 五、基金的投资目标 本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 六、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为2亿份。 七、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金认购费率按招募说明书的规定执行。	二、基金的类别 股票型证券投资基金、ETF联接基金 删除。 四、基金的投资目标 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。 本基金的目标ETF为华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金。 删除。 删除。 增加： 六、标的指数 本基金的标的指数为创业板50指数。 如果未来目标ETF的标的指数发生变更，本基金不变更目标ETF，且本基金的标的指数将随之变更，不需另行召开基金份额持有人大会。 七、本基金与目标ETF的联系与区别 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的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对标的指数的紧密跟踪。 2、在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所市场买卖目标ETF，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求，申购、赎回目标ETF；而本基金可以与普通的开放式基金一样，通过基金管理人及其他销售机构按“未知价”原则进行基金的申购与赎回，但不可以在交易所市场买卖。 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、投资比例要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将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，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，仍需保留不低于基金资产净值5%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。 2、申购赎回的影响。目标ETF按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式，采取实物申赎方式进行的申购、赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申购、赎回的方式，大额申购、赎回可能会对基金净值产生一定冲击。
第四部分基金的历史沿革	第四部分基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 本基金将以场内和场外两种方式公开发售。 场内发售是指本基金募集期结束前获得基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位发售基金份额的行为。 场外发售是指通过基金销售机构（包括直销机构及其他场外销售机构）通过场外公开发售基金份额的行为。各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。 场外发售的基金份额可在办理跨系统转托管业务后，在深交所上市交易，跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。 3、发售对象 符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。 2、募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。 3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。 4、认购份额余额的处理方式 本基金场外认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内认购份额按整数申报。 5、认购申请的确认 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。	第四部分基金的历史沿革 一、本基金的历史沿革 华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而来。 华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）经中国证监会2016年8月22日《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）注册的批复》（证监许可【2016】1901号文）注册，基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。 华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）自2017年2月20日至2017年3月31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，《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》于2017年4月11日起正式生效。 经中国证监会2018年8月14日《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更注册的批复》，华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）就基金转型事宜进行变更注册。 华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）自2018年9月10日至2018年10月8日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华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型及修改基金合同等相关事项的议案，内容包括华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更标的指数、基金类别、申购赎回规则、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、业绩比较基准、风险收益特征、收益分配原则、费率水平、估值方法以及修订基金合同等，并同意将转型后的基金更名为“华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。 依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》失效，《华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效。 二、基金份额的变更登记 基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。
第五部分基金的存续	第五部分基金备案 一、基金备案的条件 本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。 基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式 如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任： 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用； 2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息； 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 三、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、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。	第五部分基金的存续 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5000万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

（下转A38版）

华安基金管理有限公司关于调整华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金基金网下股票认购清单的提示性公告

根据华安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）于2018年7月27日发布的《华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》、《华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》，华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”，认购代码：512863）自2018年8月1日至2018年9月18日公开发售，投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式认购本基金，其中，网上现金认购的日期为2018年9月14日至2018年9月18日；通过基金管理人进行网下现金认购的日期为2018年8月1日至2018年9月18日；通过发售代理机构进行的网下现金认购和网下股票认购的日期为2018年8月1日至2018年9月18日。

根据MSCI指数有限公司关于调整MSCI中国A股国际样本股的相关通知，本公司将根据本基金基金合同及招募说明书的有关规定，自2018年9月3日起相应调整本基金网下股票认购清单如下：

代码	名称	代码	名称	代码	名称
000001	平安银行	002465	海格通信	600597	光明乳业
000002	万科A	002466	天齐锂业	600598	北大荒
000008	神州高铁	002475	立讯精密	600600	青岛啤酒
000009	中国宝安	002491	通鼎互联	600606	绿地控股
000027	深圳能源	002493	荣盛石化	600633	浙数文化
000028	国药一致	002500	山西证券	600637	东方明珠
000039	中集集团	002505	大康农业	600642	申能股份
000050	深天马A	002506	协鑫集成	600643	爱建集团
000060	中金岭南	002508	老板电器	600648	外高桥
000066	中国长城	002517	恺英网络	600649	城投控股
000069	华侨城A	002555	三七互娱	600660	福耀玻璃
000088	盐田港	002558	巨人网络	600674	川投能源
000157	中联重科	002572	索菲亚	600688	上海石化
000166	申万宏源	002573	清新环境	600690	青岛海尔
000333	美的集团	002583	海能达	600699	均胜电子
000338	潍柴动力	002589	瑞康医药	600703	三安光电
000401	冀东水泥	002594	比亚迪	600704	物产中大
000402	金融街	002601	龙蟒佰利	600705	中航资本
000413	东旭光电	002602	世纪华通	600717	天津港
000418	小天鹅A	002603	以岭药业	600718	东软集团
000423	东阿阿胶	002624	完美世界	600737	中粮糖业
000425	徐工机械	002640	跨境通	600739	辽宁成大
000513	丽珠集团	002673	西部证券	600741	华域汽车
000537	广宇发展	002701	奥瑞金	600754	锦江股份
000538	云南白药	002714	牧原股份	600760	中航沈飞
000559	万向钱潮	002736	国信证券	600777	新潮能源
000568	泸州老窖	002745	木林森	600779	水井坊
000581	威孚高科	002797	第一创业	600782	新钢股份
000596	古井贡酒	002925	盈趣科技	600787	中储股份
000598	兴蓉环境	002926	华西证券	600804	鹏博士
000623	吉林敖东	600000	浦发银行	600808	马钢股份
000625	长安汽车	600004	白云机场	600809	山西汾酒
000627	天茂集团	600008	首创股份	600816	安信信托
000630	铜陵有色	600009	上海机场	600820	隧道股份
000651	格力电器	600010	包钢股份	600827	百联股份
000656	金科股份	600011	华能国际	600835	上海机电
000661	长春高新	600015	华夏银行	600837	海通证券
000671	阳光城	600016	民生银行	600839	四川长虹
000686	东北证券	600018	上港集团	600863	内蒙华电
000709	河钢股份	600019	宝钢股份	600867	通化东宝
000712	锦龙股份	600021	上海电力	600872	中炬高新
000725	京东方A	600023	浙能电力	600873	梅花生物
000728	国元证券	600026	中远海能	600879	航天电子
000729	燕京啤酒	600027	华电国际	600884	杉杉股份
000732	泰禾集团	600028	中国石化	600885	宏发股份
000738	航发控制	600029	南方航空	600886	国投电力
000750	国海证券	600030	中信证券	600887	伊利股份
000768	中航飞机	600031	三一重工	600893	航发动力
000776	广发证券	600036	招商银行	600895	张江高科
000778	新兴铸管	600037	歌华有线	600900	长江电力
000783	长江证券	600038	中直股份	600909	华安证券
000786	北新建材	600048	保利地产	600919	江苏银行
000792	盐湖股份	600056	中国医药	600926	杭州银行
000800	一汽轿车	600060	海信电器	600958	东方证券
000807	云铝股份	600061	国投资本	600967	内蒙一机
000826	启迪桑德	600062	华润双鹤	600977	中国电影
000830	鲁西化工	600066	宇通客车	600998	九州通
000839	中信国安	600068	葛洲坝	600999	招商证券
000858	五粮液	600079	人福医药	601000	唐山港
000876	新希望	600085	同仁堂	601006	大秦铁路
000883	湖北能源	600089	特变电工	601009	南京银行
000887	中鼎股份	600104	上汽集团	601012	隆基股份
000895	双汇发展	600109	国金证券	601018	宁波港
000898	鞍钢股份	600111	北方稀土	601021	春秋航空
000937	冀中能源	600115	东方航空	601098	中南传媒
000938	紫光股份	600118	中国卫星	601099	太平洋
000960	锡业股份	600143	金发科技	601111	中国国航
000961	中南建设	600153	建发股份	601117	中国化学
000963	华东医药	600160	巨化股份	601138	工业富联
000975	银泰资源	600161	天坛生物	601155	新城控股
000977	浪潮信息	600166	福田汽车	601166	兴业银行
000983	西山煤电	600170	上海建工	601168	西部矿业
000997	新大陆	600176	中国巨石	601169	北京银行
000998	隆平高科	600177	雅戈尔	601179	中国西电
000999	华润三九	600183	生益科技	601186	中国铁建
001979	招商蛇口	600196	复星医药	601198	东兴证券
002001	新和成	600201	生物股份	601200	上海环境
002007	华兰生物	600208	新湖中宝	601211	国泰君安
002008	大族激光	600219	南山铝业	601225	陕西煤业
002013	中航机电	600252	中恒集团	601229	上海银行
002019	亿帆医药	600256	广汇能源	601233	桐昆股份
002024	苏宁易购	600258	首旅酒店	601238	广汽集团
002027	分众传媒	600260	凯乐科技	601258	庞大集团
002032	苏泊尔	600266	北京城建	601288	农业银行
002038	双鹭药业	600271	航天信息	601318	中国平安
002044	美年健康	600276	恒瑞医药	601328	交通银行
002049	紫光国微	600282	南钢股份	601333	广深铁路
002050	三花智控	600291	西水股份	601336	新华保险
002065	东华软件	600297	广汇汽车	601377	兴业证券
002074	国轩高科	600298	安琪酵母	601398	工商银行
002078	太阳纸业	600315	上海家化	601555	东吴证券
002081	金螳螂	600317	营口港	601601	中国太保
002085	万丰奥威	600332	白云山	601607	上海医药
002092	中泰化学	600340	华夏幸福	601611	中国核建
002127	南极电商	600348	阳泉煤业	601618	中国中冶
002131	利欧股份	600352	浙江龙盛	601628	中国人寿
002142	宁波银行	600362	江西铜业	601668	中国建筑
002146	荣盛发展	600369	西南证券	601669	中国电建
002152	广电运通	600372	中航电子	601688	华泰证券
002153	石基信息	600373	中文传媒	601699	潞安环能
002174	游族网络	600376	首开股份	601718	际华集团
002176	江特电机	600380	健康元	601727	上海电气
002179	中航光电	600383	金地集团	601766	中国中车
002180	纳思达	600392	盛和资源	601788	光大证券
002183	怡亚通	600398	海澜之家	601800	中国交建
002195	二三四五	600409	三友化工	601801	皖新传媒
002202	金风科技	600415	小商品城	601818	光大银行
002217	合力泰	600418	江淮汽车	601857	中国石油
002221	东华能源	600426	华鲁恒升	601866	中远海发
002223	鱼跃医疗	600435	北方导航	601877	正泰电器
002230	科大讯飞	600436	片仔癀	601888	中国国旅
002236	大华股份	600438	通威股份	601899	紫金矿业
002241	歌尔股份	600446	金证股份	601901	方正证券
002244	滨江集团	600460	士兰微	601919	中远海控
002249	大洋电机	600466	蓝光发展	601933	永辉超市
002268	卫士通	600482	中国动力	601939	建设银行
002271	东方雨虹	600487	亨通光电	601958	金钼股份
002280	联络互动	600489	中金黄金	601966	玲珑轮胎
002285	世联行	600497	驰宏锌锗	601985	中国核电
002292	奥飞娱乐	600498	烽火通信	601988	中国银行
002294	信立泰	600500	中化国际	601992	金隅集团
002304	洋河股份	600511	国药股份	601997	贵阳银行
002311	海大集团	600516	方大炭素	601998	中信银行
002340	格林美	600518	康美药业	603019	中科曙光
002353	杰瑞股份	600519	贵州茅台	603077	和邦生物
002354	天神娱乐	600521	华海药业	603288	海天味业
002359	北讯集团	600522	中天科技	603369	今世缘
002371	北方华创	600525	长园集团	603589	口子窖
002372	伟星新材	600528	中铁工业	603799	华友钴业
002385	大北农	600535	天士力	603858	步长制药
002399	海普瑞	600547	山东黄金	603883	老百姓
002405	四维图新	600549	厦门钨业	603885	吉祥航空
002408	齐翔腾达	600566	济川药业	603899	晨光文具
002410	广联达	600567	山鹰纸业	603993	洛阳钼业
002415	海康威视	600570	恒生电子	600675	中华企业
002422	科伦药业	600582	天地科技	601088	中国神华
002424	贵州百灵	600583	海油工程	600050	中国联通
002439	启明星辰	600584	长电科技	600795	国电电力
002456	欧菲科技	600585	海螺水泥	600346	恒力股份
002460	赣锋锂业	600588	用友网络	600486	扬农化工
600406	国电南瑞	000100	TCL集团	000063	中兴通讯

投资者办理本基金认购业务时，应遵循本基金基金合同、招募说明书及本基金的相关公告。如有疑问，请拨打本公司客户服务电话（40088-50099）或登录本公司网站（www.huaan.com.cn）获取相关信息。

特此公告

华安基金管理有限公司

二〇一八年九月三日

华安基金管理股份有限公司关于华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金开通直销网下股票认购业务的公告

为满足投资者的需求，华安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）自2018年9月3日起，开通华安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：512860，以下简称“本基金”）直销网下股票认购业务。现将相关情况公告如下：

一、业务办理时间

2018年9月3日至2018年9月18日（周六、周日和节假日不受理），上午9:30—11:30和下午1:00—3:00，具体业务办理时间由基金管理人确定。

二、机构投资者在本公司直销机构办理网下股票认购所需资料如下：

1、填妥并加盖单位公章及法定代表人章或交易预留印鉴的《直销申购认购申请表》（此申请表电子版与纸质盖章版需均提供）；

2、上海证券交易所A股账户卡或深圳证券交易所A股账户卡复印件；

3、加盖公章和法定代表人章的基金业务授权委托书；

4、经办人有效身份证件复印件（复印件上需加盖公章）；

5、加盖单位公章的营业执照复印件（未换发三证合一营业执照的需同时提供加盖单位公章的组织机构代码证和税务登记证复印件）；

6、加盖公章的股票份额承诺书；

7、公司要求提供的其他有关材料。

三、直销机构办理网下股票认购的程序

1、开立上海证券交易所A股账户、深圳证券交易所A股账户。如投资者需要使用MSCI中国A股国际成分股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资者需要使用MSCI中国A股国际成分股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

2、网下股票认购以单只股票股数申报。投资者通过基金管理人办理网下股票认购的，单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者通过基金管理人办理网下股票认购的每笔认购份额须在100万份以上（含100万份）。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。投资者在交易所A股账户中应具备足够的符合要求的MSCI中国A股国际成分股和已公告的备选成份股。具体名单以基金管理人最新披露的网下股票认购清单为准。

3、投资者填写认购委托单。登记机构将在募集结束后办理用以认购的股票的冻结业务，届时如投资者用以认购的股票的可用数量不足，则投资者的该笔股票认购申请无效。

具体认购程序以本公司直销机构的规定为准。

四、认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用由认购基金份额的投资人承担，认购费率不高于0.5%，认购费率如下表所示：

认购份额（M，份）	认购费率
M＜50万	0.5%
50万≤M＜100万	0.3%
M≥100万	每笔1000元

通过基金管理人的直销中心认购本基金份额的养老金客户认购费率为500元/笔。

基金管理人办理网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。投资者通过基金管理人办理网下股票认购的每笔认购份额须在100万份以上（含100万份），基金管理人在投资者提交认购申请时以现金方式向投资者收取认购费用。

五、注意事项：

1、开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

2、投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

六、投资者可通过以下途径咨询有关详情：

1、华安基金管理有限公司直销交易中心

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31－32层

联系人：刘芷伶

联系电话：021-38969983

投资者办理本基金认购业务时，应遵循本基金基金合同、招募说明书及本基金的相关公告。如有疑问，请拨打本公司客户服务电话（40088-50099）或登录本公司网站（www.huaan.com.cn）获取相关信息。

风险提示：

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。投资者投资于基金时应认真阅读基金的《基金合同》和《招募说明书》。敬请投资者留意投资风险。

特此公告

华安基金管理有限公司

二〇一八年九月三日