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

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紫荆厅

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《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），以及代表机构出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件及加盖公章的单位授权委托书；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。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、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。

4、本部分内容同时适用于本基金基金份额持有人和联接基金基金份额持有人。

七、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次基金份额持有人大会，使基金份额持有人在本次基金份额持有人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

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。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，授权委托书自动生效。

基金份额持有人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。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

基金份额持有人可通过纸面授权方式授权受托人代为行使表决权，具体要求如下：

1、授权委托书样本

基金份额持有人通过纸面方式授权的，须填写授权委托书。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（http://www.fsfund.com/）下载等方式获取授权委托书样本。

2、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二的样本），并提供个人基金份额持有人身份证件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件原件及正反面复印件；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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表该受托机构出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件及受托机构授权委托书（出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书）。

（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）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件原件及正反面复印件；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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表该受托机构出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件及受托机构授权委托书（出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书）。

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23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：021-38505888

封面清注明：“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，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、亲自出席会议的基金份额持有人的身份证明及委托代理人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投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席决议或以委托代理人出席决议的，基金份额持有人大会决议视为有效。

（4）上述第（3）项中直接出席决议的基金份额持有人或委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、委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投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。

5、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、议案内容与程序

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日公告基金份额持有人，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项所规定的须经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，表决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，但应当计入出具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成同一议题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两名基金份额持有人代表担任监票人。

（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取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1）承销证券；

2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

3）从事乘扎买限责任的投资；

4）买卖除目标ETF以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

5）向其基金管理人、基金托管人出资；

6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政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、标的指数和业绩比较基准

本基金以中证银行指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为：中证银行指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

由于本基金为目标ETF的联接基金，与目标ETF具有相似的投资目标，因此本基金采用上述业绩比较基准。

如果目标ETF变更标的指数，或指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代，或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的业绩比较基准并及时公告。若变更标的指数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），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基托管人协商一致后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

6、风险收益特征

本基金为ETF联接基金，目标ETF为指数型基金，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，并且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。

7、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，则基金管理人将本着维护投资者合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将删除关于目标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基金，则基金管理人将本着维护投资者合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数。

（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生效。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决议。

（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.投资组合的选择

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；当收到净申购资料，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、降低跟踪误差的目的。

ii.投资组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。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。

4）债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5）资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的品种进行投资。

6）其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杆杠工具放大基金的投资。

4.投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金持有的目标ETF的比例不得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，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金（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；

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)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中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

13）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

14）本基金参与股指期货投资的，需遵守下述限制：

i.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%；

ii.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100%。其中，有价证券指股票、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；

iii.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%；

iv.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；

v.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%；

15）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；

16）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；

17）法律法规及《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第1）,2）,10）,15）,16）项外，因证券/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。法律法规另有规定的，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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

（2）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1）承销证券；

2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

3）从事乘扎买限责任的投资；

4）买卖除目标ETF以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

5）向其基金管理人、基金托管人出资；

6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政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.标的指数和业绩比较基准

本基金以中证银行指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为：中证银行指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

由于本基金为目标ETF的联接基金，与目标ETF具有相似的投资目标，因此本基金采用上述业绩比较基准。

如果目标ETF变更标的指数，或指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代，或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的业绩比较基准并及时公告。若变更标的指数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），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基托管人协商一致后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

6.风险收益特征

本基金为ETF联接基金，目标ETF为指数型基金，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，并且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。

7.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，则基金管理人将本着维护投资者合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将删除关于目标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基金，则基金管理人将本着维护投资者合法权益的原则，选取其他合适的指数作为标的指数。

（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生效。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决议。

（三）转型后基金投资目标、投资范围和投资策略

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.投资组合的选择

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；当收到净申购资料，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、降低跟踪误差的目的。

ii.投资组合的调整

本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，对基金投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）股票投资策略

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资，采用被动式指数化投资的方法进行日常管理。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。

4）债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5）资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将从信用风险、流动性风险、利率风险、税收因素和提前还款因素等方面综合评估资产支持证券的投资品种，选择低估的品种进行投资。

6）其他金融工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杆杠工具放大基金的投资。

4.投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金持有的目标ETF的比例不得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，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金（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；

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)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中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

13）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

14）本基金参与股指期货投资的，需遵守下述限制：

i.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%；

ii.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100%。其中，有价证券指股票、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；

iii.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%；

iv.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