华夏基金管理有限公司
关于以通讯方式召开华夏沪深300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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《华夏沪深300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，华夏沪深300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”）的基金管理人华夏基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与基金托管人中国工商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，审议本基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资并修订基金合同事宜。会议的具体安排如下：

（一）会议召开方式：通讯方式。

（二）表决票收取时间：2020年10月24日至2020年11月4日17:00（以收到表决票的时间为准）

（三）会议计票日：2020年11月5日

（四）会议通讯表决票的送达：

1、会议通讯表决票可直接交送至本基金管理人，具体联系方式如下：

地址：华夏基金管理有限公司北京分公司

北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座1层（100033）；

联系电话：010-88087226。

2、会议通讯表决票可邮寄至本基金管理人，具体联系方式如下：

地址：北京市西城区月坛南街1号院7号楼11层（100045）；

联系人：刘金；

联系电话：010-88066494。

请在信封表面注明：“华夏沪深300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表决专用”。

二、会议审议事项

《关于华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资并修订基金合同的议案》（见附件一）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年10月23日，该日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与本次基金份额持有人大会的表决。

四、投票

（一）本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印获取表决票或登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）下载表决票。

（二）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、个人持有人自行投票的，需在表决票上签字，并提供个人身份证明文件（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）正反面复印件。

2、机构持有人自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务章（以下合称“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身份证明文件复印件，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，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、个人持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人持有人身份证明文件（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）正反面复印件，以及授权的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件（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）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

4、机构持有人委托他人投票的，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）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

5、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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。

6、以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以本基金管理人的认可为准。

（三）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于2020年10月24日至2020年11月4日17:00期间（以收到表决票的时间为准），通过专人送交、快递或邮寄的方式提交给本基金管理人。

五、授权

为便于基金份额持有人参与本次大会，除直接投票外，基金份额持有人还可以委托代理人代其行使表决权。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委托他人在基金份额持有人大会上表决的，需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人可按“（三）授权方式”列明的方式授权委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人授权委托他人代理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，每一份基金份额享有一票表决权，如基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额，则授权无效。基金份额持有人在权益登记日是否持有本基金基金份额以及所持有的基金份额数额以本基金登记机构最终确认的数据为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以授权委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构或个人，代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。为保证基金份额持有人有效行使权利，建议基金份额持有人选择本基金的基金管理人为受托人。

本基金管理人可以根据有关情况向基金份额持有人建议增加受托人名单，并另行公告。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面、电话、短信以及法律法规和中国证监会认可的其他方式进行授权，授权方式及程序应符合以下规定：

1、纸面授权

（1）授权委托书样本

基金份额持有人通过纸面方式授权的，需填写授权委托书（见附件三）。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.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个人持有人授权委托他人代理行使表决权的，应由委托人填妥并签署授权委托书原件，并提供委托人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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构持有人授权委托他人代理行使表决权的，应由委托人填妥授权委托书原件并在授权委托书原件上加盖委托人公章，并提供委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明文件复印件；如受托人为机构，还需提供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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（3）纸面授权文件的送交

基金份额持有人可选择直接送交、邮寄、柜台办理3种方式送交纸面授权文件，具体如下：

①直接送交

基金份额持有人可将填妥的授权委托书和所需的相关文件直接送交至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

地址：华夏基金管理有限公司北京分公司

北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座1层（100033）；

联系电话：010-88087226。

②邮寄

基金份额持有人可将填妥的授权委托书和所需的相关文件邮寄至本基金管理人。具体地址和联系方式如下：

地址：北京市西城区月坛南街1号院7号楼11层（100045）；

联系人：刘金；

联系电话：010-88066494。

③柜台办理

基金份额持有人也可在会议召开前到本基金管理人柜台办理授权，填写授权委托书，并提交身份证明文件。具体地址及联系方式如下：

地址：华夏基金管理有限公司北京分公司

北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座1层（100033）；

联系电话：010-88087226。

2、电话授权（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会，基金份额持有人可拨打本基金管理人客户服务电话（400-818-6666转人工，免收长途话费），并按提示确认身份后进行授权。

本基金管理人和本基金主要销售机构的呼叫中心也可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基金份额持有人身份后，根据基金份额持有人意愿进行授权记录并完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

3、短信授权（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会，本基金管理人可以通过短信平台向预留有效手机号码的基金份额持有人发送授权征集短信，基金份额持有人可回复短信表明授权意见。

（四）授权效力确定规则

1、直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托，后又直接投票表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

2、纸面优先规则

如果同一基金份额持有人通过纸面及其他多种方式进行了有效授权，不论授权时间先后，均以有效的纸面授权为准。

3、最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次通过同一种方式或纸面以外的其他不同方式进行有效授权，无论授权意向是否相同，均以最后一次授权为准。

（五）授权时间的确定

如基金份额持有人通过纸面方式进行授权，授权时间以本基金管理人收到授权委托书的时间为准。如基金份额持有人通过非纸面方式进行授权，授权时间以系统记录时间为准。

如果授权时间相同但授权意见不一致，视为委托人授权受托人选择一种表决意见进行表决。

（六）授权截止时间

本基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2020年11月4日17:00。

六、计票

（一）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督员在基金托管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。

（二）基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

（三）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，且在规定时间之前送达指定收件人的，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。

2、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，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，或未能在规定时间之前送达指定收件人的，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。

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，邮寄的以本基金管理人指定收件人收到的时间为准。

七、决议生效条件

（一）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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50%（含50%）；

（二）《关于华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资并修订基金合同的议案》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；

（三）基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在通过之日起5日内报中国证监会备案，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》的规定，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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50%（含50%）时，基金份额持有人大会方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定，本基金管理人可以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做出授权，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

（一）召集人：华夏基金管理有限公司

客户服务电话：400-818-6666；

联系人：杨霞；

网址：www.chinaAMC.com。

（二）基金托管人：中国工商银行股份有限公司

（三）公证机关：北京市中信公证处

电话：010-81139046；

联系人：甄真。

（四）见证律师：北京市天元律师事务所

十、重要提示

（一）华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同修订说明见附件四。

（二）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，确保表决票于表决截止时间前送达。

（三）若本次基金份额持有人大会未能成功召开，或者本次会议议案未能通过，基金管理人可根据法律法规及《基金合同》在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会或向基金份额持有人提交新的议案，届时基金管理人将重新发布有关基金份额持有人大会的公告。

（四）投资者可登录本基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）或拨打本基金管理人客户服务电话（400-818-6666）了解本次基金份额持有人大会相关事宜。

（五）本会议通知的有关内容由华夏基金管理有限公司负责解释。

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇二〇年九月三十日

附件一：《关于华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资并修订基金合同的议案》

附件二：《华夏沪深300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通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修订说明》

附件一：

关于华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资并修订基金合同的议案

华夏沪深300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：

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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》等有关规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，华夏基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开华夏沪深300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”）的基金份额持有人大会，审议本基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资并修订基金合同事宜。《华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修订说明》见附件四。

为实施本次会议议案，提议授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于确定本基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资的具体时间，根据本次审议事项对本基金基金合同进行修订，并可以根据现时有效的法律法规在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对本基金基金合同进行其他必要的修订和补充。

以上议案，请予审议。

华夏基金管理有限公司

二〇二〇年九月三十日

附件二：

华夏沪深300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通讯表决票

基金份额持有人名称：		
证件号码（身份证件号/营业执照号）	基金账户号	
受托人（代理人）姓名/名称：	受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：	
审议事项	同意	反对	弃权
关于华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金参与转融通证券出借业务及股指期货等衍生品投资并修订基金合同的议案			
基金份额持有人/受托人签名或盖章	日期　年　月　日		

说明：

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所持全部基金份额的表决意见。如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，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。

“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。

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.chinaamc.com）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

兹委托　　代表本人（或本机构）参加投票截止日为2020年11月4日的以通讯方式召开的华夏沪深300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，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接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）：

委托人身份证号或营业执照注册号：

委托人基金账户号：

受托人签字/盖章：

受托人身份证明编号：

委托日期：　　年　月　日

附注：

1、此授权委托书可剪报、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。

3、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修订说明

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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《华夏沪深300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，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，华夏基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开华夏沪深300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”）基金份额持有人大会，审议本基金参与转融通证券出借业务及股指期货、国债期货、股票期权等衍生品投资并修订基金合同事宜。基金管理人已对基金合同中“释义”、“基金的投资”、“基金资产估值”、“基金的信息披露”、“基金合同当事人及权利义务”等相关章节进行了修订，并相应修订了本基金托管协议及招募说明书（更新）。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响。现将基金合同主要修订情况公告如下（具体修订详见附表）：

一、在“释义”中新增“转融通证券出借业务”释义如下：

“转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。”

二、在“基金合同当事人及权利义务（一）基金管理人2、基金管理人的权利”中新增有关参与转融通证券出借业务的权利约定如下：

“（14）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务等；”

三、对“基金的投资”的修订

（一）将“（二）投资范围”修订为：

“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。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成分股（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、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、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含回业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金还可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的（如股票指数期货等金融产品、商品期货等），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%（已申购尚未确认的目标ETF份额可计入在内）。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权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、应收申购款等。”

（二）在“（四）投资策略”中增加股票、债券、衍生品、资产支持证券及转融通证券出借业务的投资策略如下：

“1、目标ETF投资策略

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标ETF的份额。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标ETF的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。在目标ETF上市之前，本基金可以股票和现金特殊申购目标ETF基金份额。

2、股票投资策略

基金可通过买入标的指数成份股、备选成份股来跟踪标的指数，也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股的方式申购目标ETF。对于出现市场流动性不足等情况，导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人有权通过投资非成份股等进行适当的替代。基金管理人也可适度投资其他非成份股以增强基金收益。

3、债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。基金还可参与风险低且可控的债券回购等投资。

4、衍生品投资策略

为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权、国债期货。

基金投资股指期货、股票期权等衍生工具将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、股票期权合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回以及股指期货、股票期权之间的投资操作，以增强基金收益。

本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资申批事项，以防范股票期权投资的风险。

基金投资国债期货将本着谨慎的原则，充分考虑其流动性和风险收益特征，适度参与国债期货投资。

5、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿还风险，并根据资产证券化的现金转换安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。

6、参与转融通证券出借业务策略

为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

如法律法规或中国证监会允许，本基金还将投资于其他与标的指数或标的股份股权相关的金融产品，投资目标是更紧密地跟踪标的指数，基金拟投资于新的金融产品的，需将有关投资方案通知基金托管人，并在报中国证监会备案后公告。

……

章节	标题	修订前	修订后
全文		指定媒介 指定报刊 指定网站	规定媒介 规定报刊 规定网站
全文		一、前言和释义 二、基金的基本情况 三、基金份额的发售 四、基金备案 五、基金份额的申购与赎回 六、基金合同当事人及权利义务 七、基金份额持有人大会 八、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 九、基金的托管 十、基金份额的登记结算 十一、基金的投资 十二、基金的财产 十三、基金资产估值 十四、基金费用与税收 十五、基金的收益与分配 十六、基金的会计与审计 十七、基金的信息披露 十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 十九、业务规则 二十、违约责任 二十一、争议的处理和适用的法律 二十二、基金合同的效力 二十三、其他事项	第一部分　前言 第二部分　释义 第三部分　基金的基本情况 第四部分　基金份额的发售 第五部分　基金备案 第六部分　基金份额的申购与赎回 第七部分　基金合同当事人及权利义务 第八部分　基金份额持有人大会 第九部分　基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 第十部分　基金的托管 第十一部分　基金份额的登记 第十二部分　基金的投资 第十三部分　基金的财产 第十四部分　基金资产估值 第十五部分　基金费用与税收 第十六部分　基金的收益与分配 第十七部分　基金的会计与审计 第十八部分　基金的信息披露 第十九部分　基金合同的变更、终止与基金财产的清算 第二十部分　业务规则 第二十一部分　违约责任 第二十二部分　争议的处理和适用的法律 第二十三部分　基金合同的效力 第二十四部分　其他事项
五、基金份额的申购与赎回	（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式 （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式	证券交易场所	证券/期货交易场所
十三、基金资产估值	（七）暂停估值的情形 （八）特殊情形的处理	证券交易场所 证券交易所	证券/期货交易场所 证券/期货交易所
一、前言和释义	释义	…… 指定媒介：中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊…… …… 无右侧转融通证券出借业务的释义。	…… 规定媒介：符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的报刊和互联网网站。 转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。
四、基金备案	（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，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。	《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，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。
六、基金合同当事人及权利义务	（一）基金管理人1、基金管理人简况 …… 住所：北京市顺义区天竺空港工业区A区 …… （14）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资； …… （二）基金托管人1、基金托管人简况 …… 法定代表人：姜建清 ……	1、基金管理人简况 …… 住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院 …… （14）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通证券出借业务等； …… 法定代表人：陈四清 ……	
八、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	（一）基金管理人和基金托管人职责终止的情形	基金份额持有人大会决议通过全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。 1、基金管理人职责终止的情形 有下列情形之一的，基金管理人职责终止： （1）被依法取消基金管理资格； （2）被基金份额持有人大会解任； （3）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产； （4）法律法规、《基金合同》规定或经中国证监会核准的其他情形。 2、基金托管人职责终止的情形 有下列情形之一的，基金托管人职责终止： （1）被依法取消基金托管资格； （2）被基金份额持有人大会解任； （3）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产； （4）法律法规、《基金合同》规定或经中国证监会核准的其他情形。	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。 1、基金管理人职责终止的情形 有下列情形之一的，基金管理人职责终止： （1）被依法取消基金管理资格； （2）被基金份额持有人大会解任； （3）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产； （4）法律法规、《基金合同》规定或中国证监会规定的其他情形。 2、基金托管人职责终止的情形 有下列情形之一的，基金托管人职责终止： （1）被依法取消基金托管资格； （2）被基金份额持有人大会解任； （3）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产； （4）法律法规、《基金合同》规定或中国证监会规定的其他情形。
	（二）基金托管人的更换程序	1、基金管理人的更换程序 …… （4）核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行； （5）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会核准后2个工作日内在指定媒介公告； …… 2、基金托管人的更换程序 …… （4）核准：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行； （5）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会核准后2个工作日内在指定媒介公告； ……	1、基金管理人的更换程序 …… （4）备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案； （5）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的决议须生效后2日内在规定媒介公告； …… 2、基金托管人的更换程序 …… （4）备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案； （5）公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的决议须生效后2日内在规定媒介公告； ……
十一、基金的投资	（四）投资策略	…… 如法律法规或中国证监会允许，本基金还将投资于期权、期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品，投资目标是更紧密地跟踪标的指数。基金拟投资于新的金融产品，并在报中国证监会备案后公告。 ……	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。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、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、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含回业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金还可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。法律法规或监管机构允许基金投资其他品种的（如股票指数期货等金融产品、商品期货等），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%（已申购尚未确认的目标ETF份额可计入在内）。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权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、应收申购款等。 1、目标ETF投资策略 …… 2、股票投资策略 结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。基金还可参与风险低且可控的债券回购等投资。 4、衍生品投资策略 为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权、国债期货。 基金投资股指期货、股票期权等衍生工具将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、股票期权合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回以及股指期货、股票期权之间的投资操作，以增强基金收益。 本基金投资股票期权，基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股票期权的投资申批事项，以防范股票期权投资的风险。 基金投资国债期货将本着谨慎的原则，充分考虑其流动性和风险收益特征，适度参与国债期货投资。 5、资产支持证券投资策略 本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿还风险，并根据资产证券化的现金转换安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。 6、参与转融通证券出借业务策略 为了更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申购赎回情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 如法律法规或中国证监会允许，本基金还将投资于其他与标的指数或标的股份股权相关的金融产品，投资目标是更紧密地跟踪标的指数，基金拟投资于新的金融产品，需将有关投资方案通知基金托管人，并在报中国证监会备案后公告。 ……
	（五）基金份额持有人大会召集人及召集方式 第1点	基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。 会议召开方式由会议召集人确定。 1、现场开会：…… （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）时，会议召开的票数应当为权益登记日当日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）。若大会召集人在权益登记日的次日起6个工作日内召集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书面意见或授权他人代表出具书面意见。 （5）上述第（4）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。 ……	基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。 会议的召开方式由会议召集人确定。 1、现场开会：…… （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）时，会议召开的票数应当为权益登记日当日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）。若大会召集人在权益登记日的次日起6个工作日内召集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书面意见或授权他人代表出具书面意见。 （5）上述第（4）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。 ……
	（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日内报中国证监会核准或