

2013年7月29日 星期一

广发基金管理有限公司关于召开 广发中证500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

广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于 2013年7月23日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及广发基金管理有限公司网站 <http://www.gffunds.com.cn> 发布了《广发基金管理有限公司关于召开广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》。为了便于基金份额持有人大会顺利召开,现将有关召开广发中证500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。

一、会议基本情况

广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可〔2013〕165号文批准募集的《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金 以下简称“广发中证500ETF”》的基金合同已于2013年4月11日生效,鉴于该基金与基金管理人现已管理的《广发中证500指数证券投资基金（LOF）》以下简称“本基金”或“广发中证500 LOF”的标的指数相同,为优化本基金的投资成本,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》以下简称“基金合同”》的有关约定,基金管理人经与本基金基金托管人中国工商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,审议变更本基金的投资范围及其相关事宜,将本基金变更为“广发中证500ETF的联接基金,允许本基金投资股指期货,参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务。

- 1.会议召开方式:通讯方式;
- 2.会议投票表决起止时间:自2013年7月24日起,至2013年8月29日17:00止;股票表决时间以本次大会公证机关指定的投票接收人收到表决票时间为准;
- 3.会议通讯表决票将送达至本次大会公证机关的指定收件人,具体地址和联系方式如下:

收件人:广发基金管理有限公司客户服务中心
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场东裙楼4楼
联系人:赵歆
联系电话:020-89188603
传真:020-34281105
邮政编码:510308

其他形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式提交或发送至基金管理人的系统,并在公证机关的监督下完成统计。

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为 关于广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项的议案》以下简称“议案”》,议案详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2013年8月19日,即在2013年8月19日深圳证券交易所交易结束后,在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的本基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、投票方式

- 1、(一)纸质表决票的填写和寄交方式
本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站 <http://www.gffunds.com.cn> 等方式获取表决票。
- 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)机构投资者投票的,需在表决票上加盖单位公章,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的公章(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经公证认证的授权代表持有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签署的营业执照、商业登记证书或其他有效注册登记证证明复印件,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基金管理人于2013年7月2日通过基金管理人网站及《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》发布的《广发基金管理有限公司关于召开广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的预告公告》以下简称“预告公告”》及本公告“五、授权”的规定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。受托人接受基金份额持有人以纸质方式授权代理投票的,应在受托人在表决票上签字或盖章,并提供授权委托书以及本人身份证“五、授权”（二）授权方式、纸质方式授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证件号码或机构主体资格证明文件,但下述第（四）项另有规定的除外;

- 4、基金份额持有人使用基金管理人邮寄的由授权委托征集信函或通过《预告公告》及本公告规定的电话授权方式、网络授权方式或短信授权方式授权基金管理人投票的,接受有效委托的基金管理人应在表决票上加盖本单位公章,并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件。

- 5、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2013年7月24日起,至2013年8月29日17:00以前(以本次大会公证机关指定的投票接收人收到表决票时间为准)通过专人送交、邮寄寄送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:广发基金管理有限公司客户服务中心
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场东裙楼4楼
联系人:赵歆
联系电话:020-89188603
传真:020-34281105
邮政编码:510308

五、网络投票

为方便基金份额持有人参与大会投票,自2013年7月24日起,至2013年8月29日17:00以前(以基金管理人系统记录时间为准),基金管理人提供以下网络通信供投资者进行投票。
1.在基金管理人网站设立投票专区,基金份额持有人可投票进行投票。
2.基金管理人通过网上平台为投资者提供通过互联网网络投票的服务。

为了保护投资者利益,投资者在进行交易时,不论投资者是否授权或选择何种投票方式,均不影响投票的有效性。

基金份额持有人通过基金管理人授权专区进行投票时,需核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人权益;通过基金管理人网上平台进行投票的基金份额持有人,应使用密码登录。

基金份额持有人通过网络投票的方式仅适用于个人持有人。

六、短信投票

为了方便基金份额持有人参与大会投票,自2013年7月24日起,至2013年8月29日17:00以前(以基金管理人系统记录时间为准),基金管理人提供以下短信通信供投资者进行投票。
基金管理人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,持有人可回复短信表明投票意见。

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,对机构投资者暂不开通。

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,使基金份额持有人有在本次大会上充分表达其意见,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有基金份额持有人大会上表决符合以下规则:

（一）委托书

本基金的基金份额持有人自本预告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,授权委托书自动有效。

基金份额持有人(含申购投资者,下同)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有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册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、基金托管人、代销机构以及其他符合法律法规规定的机构和/或个人,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、基金托管人或中国工商银行股份有限公司、代销机构为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人增加建议的受托人名单。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过书面、电话、网络和短信等其他法律法规和中国证监会认可的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质方式授权的,授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录广发基金网站下载 (www.gffunds.com.cn) 等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人的授权形式及程序应符合以下规定:

- 1.纸质方式授权
(1)基金份额持有人进行纸质授权所需提供的文件
(2)个人基金份额持有人委托他人投票的,应由委托人填写并签署授权委托书(授权委托书的格式可参考附件二)的样本),并提供个人身份证件复印件;如受托人为机构,还需提供该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单位法人《登记证书》、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。
如果个人基金份额持有人使用其收到的基金管理、邮寄的专用授权委托书征集信函授权时,无需提供身份证件复印件,应在专用回邮信封内填写个人姓名、身份证号码及授权委托书意见,并同寄给基金管理人,该授权委托书即视为有效授权。
- 2.机构投资者有委托他人投票的,应由委托人授权受托人填写《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,并提供该受托人具有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单位法人《登记证书》、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,应由委托人填写授权委托书(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本单位的公章(如有)或由授权代表在授权委托书上签字(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经公证认证的授权代表持有代表该合格境外机构投资者签署授权委托书的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者签署的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证证明复印件,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.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,还需提供该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单位法人《登记证书》、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。
如基金份额持有人拟委托基金管理人、基金托管人、或代销机构、或基金管理人建议的受托人投票的,无需提供受托人的企业法人营业执照复印件。

（四）纸质授权文件的送达

基金份额持有人或其代理人需将填妥的授权委托书和所需的相关文件通过专人送交、

邮寄或以电子邮件、传真、在线客服、微信的方式送达至基金管理人。

基金份额持有人可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人或受托人营业机构。

基金份额持有人也可在授权截止前向至基金管理人或代销机构的柜台办理授权,填写授权委托书,并提交授权委托书人身份证明文件。

投资者通过直销柜台及主要代销机构柜台办理基金交易业务时,直销柜台及主要代销机构网点柜台将作为投资者提供纸质方式授权的场所。为了保护投资者利益,投资者在交易时,不论投资者是否授权或选择何种授权方式,均不影响交易的有效性。

二、电话方式授权

为方便基金份额持有人参与大会,基金管理人提供以下电话通信供投资者进行授权。
(1)基金管理人在线客服:投资者通过人工专用电话通、客户拨打客服热线95105828,按照语音提示“进行中证500F产品类型转接型投资咨询”,然后该类客户电话先转人工,客服人员根据客户身份后进行授权记录及完成授权。

(2)基金管理人呼叫中心:基金份额持有人取得联系,在通话过程中回答提问方式核实持有身份后,由人工坐席根据客户意愿进行授权记录而完成授权。

为了保护基金份额持有人利益,上述所有通讯过程将被录音。
基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于委托人为个人持有人,受托人为基金管理人。

三、网络方式授权

为了方便基金份额持有人参与大会,基金管理人提供以下网络通信供投资者进行授权。
(1)在基金管理人网站设立授权专区,基金份额持有人可投票进行授权。

(2)基金管理人通过网上平台为投资者提供通过互联网网络进行授权的服务。

为了保护投资者利益,投资者在进行交易时,不论投资者是否授权或选择何种授权方式,均不影响投票的有效性。

基金份额持有人通过基金管理人授权专区进行投票时,需核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人权益;通过基金管理人网上平台进行授权的基金份额持有人,应使用密码登录。

基金份额持有人通过网络投票的方式仅适用于委托人为个人持有人,受托人为基金管理人。

七、短信投票

为了方便基金份额持有人参与大会,基金管理人提供以下短信通信供投资者进行授权。
(1)基金管理人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,持有人可回复短信表明投票意见。

(2)个人持有人发送短信表明投票意见至基金管理人指定号码。
基金份额持有人通过短信进行授权时,需核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人权益。基金份额持有人预先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。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于委托人为个人持有人,受托人为基金管理人。

八、授权效力确定规则

- 1.如果同一基金份额存在包括有效纸质方式授权和其他非纸质方式有效授权的,以有效的纸质授权为准。多次以有效纸质方式授权的,以最后一次纸质授权为准。不能确定最后一次纸质授权的,如最后时间收到的授权表决有多次,以表示具体表决意见的纸质授权为准;最后时间收到的多次纸质授权均未表示具体表决意见的,若授权表决一致,以一致的授权表决为准;若授权表决不一致,视为委托人授权受托人选择其中一种授权方式行使表决权;
- 2.如果同一基金份额只在存在有效纸质方式授权时,委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权;
- 3.如果同一基金份额无有效纸质方式授权,但存在有效的其他非纸质方式授权的,以有效的其他非纸质方式的授权为准;
- 4.如果同一基金份额以非纸质方式进行多次授权的,以时间在最后授权的授权为准。如最后时间收到的授权表决有多项,以表示具体表决意见的授权为准;最后时间收到的多次授权授权表决一致,以一致的授权表决为准;若授权表决不一致,视为委托人授权受托人选择其中一种授权方式行使表决权;
- 5.如委托人未在授权委托书中表示明确其表决意见的,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书中表示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方式行使表决权;
- 6.授权截止时间
基金份额持有人授权截止时间自2013年8月29日17:00 点。将纸质授权委托书寄送给专人送达给基金管理人、基金托管人或指定代销机构的指定地址的,授权时间以收到时间为准;通过其他非纸质方式进行授权的,授权时间以系统记录时间为准。

六、计票

1.本次通讯会议的计票方式:为本公告通知的表决截止时间后第2个工作日,由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国工商银行股份有限公司)授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程及结果予以公证。

- 2.基金份额持有人所持每份基金份额均有一票表决权。
- 3.表决效力认定的如下:
(1)纸质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;通过其他非纸质方式表决的,表决时间以系统记录时间为准。2013年8月29日17:00以后送达基金管理人的,为无效表决。

- 2.如果同一基金份额存在包括有效纸质方式表决和其他非纸质方式有效表决的,以有效的纸质方式表决为准。

（一）纸质表决票的效力认定

(1)纸质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。

(2)纸质表决票上的表决意见未选、多选或无法判断,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)如纸质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授权人经有效授权的证明文件,或未能在规定时间内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。

(4)基金份额持有人重复提交纸质表决票的,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,则按首次原则处理:

- I.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;
- II.送达时间为同一天的,视为在同一天表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;
- III.送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际送达时间为准,邮寄的以本公告规定的收件人收到时间为准,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非纸质方式进行多次表决的,以时间在最后表决的为准。

七、决议生效条件

- 1、本人权益登记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代表的基金份额须占权益登记日本基金总份额的50%以上;
- 2、关于“广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项的议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其授权人所持表决权的50%以上通过;
- 3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项,自获得中国证监会依法备案之日起生效。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定,本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的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成功召开,根据2013年6月1日生效的《基金法》,基金管理人可在规定的时间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时间所限定的时间为准。

如果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新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:广发基金管理有限公司
持有人大会专线客服电话:95105828*6
联系人:赵歆
联系电话:020-89188603
传真:020-34281105
网址:www.gffunds.com.cn
电子邮件:services@gffunds.com.cn

2.公证机构:北京市方圆公证处
地址:北京市东城区朝阳门内大街东水胡同5号北京IN大厦B502室
联系人:原莹
联系电话:010-85197530
邮政编码:100010

3.见证律师:国浩律师(广州)事务所
地址:广州市体育西路 189 号城建大厦9楼
联系人:黄贞
电话:020-38799345
邮编:510620

十、重要提示

- 1.请基金份额持有人于邮寄表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。
- 2.基金管理人将向深圳证券交易所申请将本基金自2013年9月2日开始持续停牌。基金管理人将召集基金份额持有人大会决议公告后向深圳证券交易所申请停牌。本基金的持续停牌不会对本基金的市场外正常申购造成影响,投资人可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。

- 3、如本次基金份额持有人大会不能成功召开未能通过本次大会审议的议案,根据《基金法》及《基金合同》的有关规定,本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

4.本公告的有关内容由广发基金管理有限公司解释。

附件一:关于广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项的议案》
附件二:授权委托书(样本)

附件三:广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

广发基金管理有限公司
2013年7月29日

附件一:关于广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项的议案》

广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人:
鉴于“广发中证500交易型开放式指数证券投资基金 以下简称“广发中证500ETF”》基金合同已经生效,该基金与基金管理人现已管理的《广发中证500指数证券投资基金（LOF）》以下简称“本基金”或“广发中证500LOF”的标的指数相同,为优化本基金的投资成本,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》以下简称“基金合同”》的有关约定,基金管理人经与本基金基金托管人中国工商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,审议变更本基金的投资范围及其相关事宜,将本基金变更为“广发中证500ETF的联接基金,允许本基金投资股指期货,参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务。基于上述投资范围的变更,相应地对《基金合同》中有关基金的名称、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他相关条款,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定进行修改。就本基金投资范围变更需对《基金合同》修改的内容详见本议案附件《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》修改说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过,基金管理人将根据本议案及其附件《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》修改说明》对《基金合同》进行修改,并将修改后的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件报监管机构备案并公告。

以上议案,请予审议。

广发基金管理有限公司
2013年7月23日

关于“广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项”之附件:
《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》修改说明

为实现广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事宜之目的,根据《基金法》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》、《交易型开放式指数基金联接基金审核指引》等法律法规、监管机关相关规定,《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》以下简称“基金合同”以及《关于“广发中证500指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事项的议案》,现就《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》相关条款的修改,制作本《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》修改说明,将需修改的合同条款列示如下:

【一】将基金合同名称由“《广发中证500指数证券投资基金（LOF）基金合同》”修改为“《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》”。

【二】将基金名称由“广发中证500指数证券投资基金（LOF）”变更为“广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”,涉及本基金名称表述的条款相应修改。

【三】对原基金合同“第一部分 前言和释义”的修订
根据监管机关的规定,增加相关释义,具体如下:
登记结算业务实施规则:指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施规则》及其不时修订。

交易型开放式指数证券投资基金:指《登记结算业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”。

标的指数:指指数编制机构编制并发布的“中证500指数及其未来可能发生的变更。目标ETF:指广发中证500交易型开放式指数证券投资基金 简称“广发中证500ETF”。

ETF联接基金:指将基金大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF,紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金,简称联接基金。

【四】对原基金合同“第二部分 基金的基本情况”的修订
修改基金类别、基金的投资目标,增加目标ETF及标的指数的说明,并说明联接基金与目标ETF的联系和区别,具体修订如下:

1.将“二、基金的类别”的内容修改为“ETF联接基金”。

2.将“二、基金的投资目标”修改为“三、目标ETF及标的指数”,内容修改为“本基金的目标ETF为广发中证500F交易型开放式指数证券投资基金,标的指数为中证500指数”。

3.将“六、基金的投资目标”的内容修改为“本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩

比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”。

- 4、在“第二部分 基金的基本情况”增加“十、本基金与目标ETF的联系和区别”,内容为

“本基金为与目标ETF的联接基金,二者既有联系也有区别:

(1)在投资方法方面,目标ETF主要采取完全复制法,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,实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(2)在交易方式方面,投资者既可以在二级市场买卖目标ETF,也可以按照申购赎回清单的要求,采用份额申购和份额赎回的方式申购目标ETF;而本基金是上市开放式基金(LOF),投资者可以在二级市场买卖本基金份额,也可以通过交易所场内和场外销售机构申购和赎回本基金份额;

(3)申购赎回方式不同。目标ETF的投资者依据申购赎回清单,按以组合证券为主的中购价对价、赎回对价进行申购赎回,申购赎回均以份额申报;本基金的投资人依据基金份额净值,以现金方式进行申购赎回,金额申购、份额赎回。

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)法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基础品种,可将全部或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,仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于目标指数或到期日在一年以内的政府债券;

2)申购赎回的影响。目标ETF采取实物申赎的方式,申购赎回对基金净值影响较小;而本基金申购赎回采用现金方式,大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击;

3)投资管理方式的不同,如在指数化投资过程中,不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不问。”

【五】原基金合同“第四部分 基金备案”的修订
本部分标题修改为“基金的历史沿革和存续”,删去“一、基金备案的条件”、二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式”,并增加“一、本基金的历史沿革”,具体内容如下:

“广发中证500F交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)由广发中证500指数证券投资基金(LOF)通过基金合同修订变更而来。

广发中证500指数证券投资基金(LOF)经中国证监会证监许可〔2009〕82号文核准募集,基金管理人人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

广发中证500指数证券投资基金(LOF)自2009年10月22日至2009年11月20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,《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2009年11月26日生效。

2013年*月*日广发中证500指数证券投资基金(LOF)以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于广发中证500指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事项的议案》,同意“广发中证500指数证券投资基金(LOF)变更投资范围及其相关事宜,将广发中证500指数证券投资基金(LOF)变更为广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),允许本基金投资股指期货,参与融资融券及通过证券金融公司办理转融通业务,并基于上述投资范围的变更,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金的名称、投资目标和估值、基金的费用、基金份额持有人大会及其他相关条款进行相应修改。上述基金份额持有人大会决议事项已经中国证监会于2013年*月*日核准生效;

自该日起,《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》生效,自该基金合同第三部分“基金份额的发售”仅适用于“广发中证500指数证券投资基金(LOF)的募集,对变更后后的广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)不适用,并取代原《广发中证500指数证券投资基金(LOF)基金合同》,广发中证500指数证券投资基金(LOF)正式变更为“广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)”,本基金当事人将按照《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》享有权利并履行义务。”

【六】原基金合同“第五部分 基金份额的上市交易”的修订

- 1、删除“基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的基金份额上市交易。”
- 2、将“二、上市交易的时间”的内容修改为:“广发中证500指数证券投资基金(LOF)已于2010年1月8日在深圳证券交易所上市。因召开基金份额持有人大会,基金管理人向深圳证券交易所申请广发中证500指数证券投资基金(LOF)自201*年*月*日开始持续停牌,201*年*月*日,经基金管理人向深圳证券交易所申请,本基金复牌。”

【七】对原基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”的修订
根据本基金变更投资范围后投资目标ETF而导致本基金可能发生的暂停申购赎回情况,对本部分进行修改,具体修改内容如下:

- 1、在“7、申购份额与赎回金额的计算”中,将“8)本基金基金份额净值的计算”的内容修改为:

“T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情形,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。本基金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,由此产生的误差计入基金财产。”

- 2、在“9、拒绝或暂停申购的情形及处理方式”中增加内容:

“1)目标ETF暂停基金资产净值;”

【八】对原基金合同“第七部分 基金合同当事人权利义务”的修订
在“二、基金份额持有人”的1、根据《基金法》、《暂行办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于“中”增加如下条款:

“9)出席或者委派代表出席目标ETF的份额持有人大会,对目标ETF份额持有人大会审议事项行使表决权,参加份额数和票数按登记日本基金所持有的目标ETF份额占本基金资产的比例计算。”

【九】对原基金合同“第八部分 基金份额持有人大会”的修订
1、在“一、召开事由”中将“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”的第八项修订为:

“6)变更基金投资目标、范围或策略,但由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外。”

2、在“一、召开事由”的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”中增加如下条款:

“1)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。”

3、在“一、召开事由”的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”中增加如下条款:

“4)由于目标ETF基金交易方式变更、终止上市或基金合同终止而变更基金投资目标、范围或策略。”

4、在本部分最后增加以下内容:

“九、本基金与目标ETF之间在基金份额持有人大会方面的联系
鉴于本基金是目标ETF的联接基金,本基金的基金份额持有人可以以所持有的本基金基金份额或者委派代表出席目标ETF的份额持有人大会并参与表决,其持有的有表决权的基金份额数和票数按如下方式,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的总份额以该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。”

本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全部基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人身份行使表决权,但可接受本基金的特定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议提议召开或召集目标ETF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份额持有人大会。”

【十】对原基金合同“第十一部分 基金的投资”的修订

根据相关法律法规及监管规则,对本部分中投资目标、投资范围、投资理念、投资策略、投资限制、标的指数和业绩比较基准、风险收益特征、基金的融资融券等与投资相关的条款将进行全面的修改,并增加“目标ETF发生相关变更情形时的处理”条款。具体修改如下:

1.将“一、投资目标”的内容修改为:

“本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。”

2.将“二、投资范围”的内容修改为:

“本基金以目标ETF基金份额的标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。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%,待现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发股票、衍生工具、权证、股指期货等)、债券、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等、资产支持证券、债券回购、银行存款以及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。”