万家基金管理有限公司关于万家中证创业成长指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《万家中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》（简称“基金合同”）、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定，万家中证创业成长指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在2015年1月5日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2015年1月5日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的万家中证创业成长指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“万家创A”，交易代码：150090），万家中证创业成长指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“万家中创”，交易代码：161910）。

三、基金份额折算方式

万家创A份额和万家中创份额按照《基金合同》“三、基金份额的分类与净值计算规则”进行净值计算，对万家创A份额的应得收益进行定期份额折算，每2份万家中创份额将按1份万家创A份额获得约定应得收益的新增折算份额。

在基金份额折算前与折算后，万家创A份额和万家创B份额的份额配比保持1:1的比例。

对于万家创A份额期末的约定应得收益，即万家创A份额每个会计年度12月31日份额净值超出1.000元部分，将折算为场内万家中创份额分配给万家创A份额持有人。万家中创份额持有人持有的每2份万家中创份额将按1份万家创A份额获得新增万家中创份额的分配。持有场外万家中创份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外万家中创份额的分配；持有场内万家中创份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内万家中创份额的分配。经过上述份额折算，万家创A份额和万家中创份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额折算基准日，本基金将对万家创A份额和万家中创份额进行应得收益的定期份额折算。

有关计算公式如下：

（一） 万家创A份额

[illegible]

万家创A份额新增份额折算成万家中创份额的场内份额采用截位方法保留到整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。

（二）万家创B份额

每个会计年度的定期份额折算不改变万家创B份额净值及其份额数。

（三）万家中创份额

[illegible]

万家中创份额的场外份额经折算后的份额数采用截位方法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；万家中创份额的场内份额经折算后的份额数采用截位方法保留到整数位（最小单位为1份），余额计入基金财产。

（四）折算后万家中创份额的总份额数

定期份额折算后万家中创份额的总份额数= 定期份额折算前万家中创份额的份额数+ 万家中创份额持有人新增的万家中创份额的份额数+万家创A份额持有人新增的万家中创份额的份额数

在实施基金份额折算时，份额折算日折算前万家中创份额的基金份额净值、万家创A份额参考净值等具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（五）举例

2015年1月5日为本基金的定期份额折算日，假设万家中创份额当日折算前资产净值为4,658,000,000元。当日场外万家中创份额、场内万家中创份额分别为30亿份、5亿份。前一个会计年度末每份万家创A份额资产净值为1.065000000元，且未进行不定期份额折算。投资者甲持有万家中创份额场内份额100,000份，投资者乙持有万家创A份额20,000份，投资者丙持有万家创B份额8,000份，则执行定期份额折算后：

万家中创份额的基金份额净值

=[4,658,000,000－3,500,000,000×(1.065000000－1.000)/2]/3,500,000,000=1.298元

投资者甲新增场内万家中创份额数

=[100,000/2×(1.065000000－1.000)] /1.298=2,503份

投资者乙新增场内万家中创份额数=[20,000×(1.065000000－1.000)] /1.298=1,001份

即：份额折算后，投资者甲共持有万家中创份额的场内份额102,503份，投资者乙共持有万家创A份额20,000份及万家中创份额的场内份额1,001份，投资者丙仍持有万家创B份额8,000份。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）定期份额折算基准日（即2015年1月5日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务、配对转换业务；万家创A、万家创B正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

（二）定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2015年1月6日），本基金暂停办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，万家创A暂停交易，万家创B正常交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2015年1月7日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务，万家创A将于2015年1月7日上午10:30恢复交易，万家创B正常交易。

（四）根据深圳证券交易所《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015年1月7日万家创A复牌首日即时行情显示的前收盘价为2015年1月6日的万家创A的份额净值（四舍五入至0.001元）。由于万家创A折算前可能存在折溢价交易情形，折算前的收盘价扣除2014年约定收益后与2015年1月7日的前收盘价可能有较大差异，1月7日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

由于万家创A份额新增份额折算成万家中创份额的场内份额数和万家中创份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有较少万家创A份额数或场内万家中创份额数的份额持有人存在无法获得新增场内万家中创份额的可能性。

投资者若希望了解基金份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.wjasset.com或者拨打本公司客服电话：400-888-0800(免长途话费)。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

万家基金管理有限公司
2014年12月29日

新华中证环保产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及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定，新华中证环保产业指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）将在2015年1月5日办理定期份额折算业务。相关事项提示如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度第一个工作日。本次定期份额折算的基准日为2015年1月5日。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的新华环保A份额、新华环保份额。

三、基金份额折算方式

新华环保A份额与新华环保B份额按照基金合同第四部分“基金份额的分类与净值计算规则”进行基金份额参考净值计算，对新华环保A份额的应计收益进行定期份额折算，每2份新华环保份额将按1份新华环保A份额获得约定收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，新华环保A份额和新华环保B份额的份额配比保持1:1的比例。

对于新华环保A份额的约定收益，即新华环保A份额每个会计年度12月31日的基金份额参考净值超出1.000元部分，将折算为场内新华环保份额分配给新华环保A份额持有人。新华环保份额持有人持有的每2份新华环保份额将按1份新华环保A份额获得新增新华环保份额的分配。持有场外新华环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外新华环保份额的分配；持有场内新华环保份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内新华环保份额的分配。经过上述份额折算，新华环保A份额的基金份额参考净值和新华环保份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度第一个工作日为基金份额定期折算基准日，本基金将对新华环保A份额和新华环保份额进行应得收益的定期份额折算。

每个会计年度第一个工作日进行新华环保A份额上一年度应计收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

（1）新华环保A份额的折算：

定期份额折算后新华环保A份额的份额数 = 定期份额折算前新华环保A份额的份额数

[illegible]

（2）新华环保B份额的折算：

每个会计年度的定期份额折算不改变新华环保B份额的基金份额参考净值及其份额数。

（3）新华环保份额的折算：

[illegible]

定期份额折算后新华环保份额的份额数 = 定期份额折算前新华环保份额的份额数+新华环保份额持有人新增的新华环保份额的份额数+新华环保A份额持有人新增的新华环保份额的份额数

[illegible]

新华环保份额的场外份额经折算后的份额数保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有；新华环保份额的场内份额经折算后的份额数保留至整数位（最小单位为1份），小数点以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）定期份额折算基准日（即2015年1月5日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务及配对转换业务，新华环保A、新华环保B正常交易。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

（二）定期份额折算基准日后的第一个工作日（即2015年1月6日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，且新华环保A暂停交易，新华环保B正常交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）定期份额折算基准日后的第二个工作日（即2015年1月7日），基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、配对转换业务，新华环保A自2014年1月7日上午10:30起恢复交易，新华环保B正常交易。

五、重要提示

（一）根据深圳证券交易所《关于分级基金份额折算后次日前收盘价调整的通知》，2015年1月7日新华环保A即时行情显示的前收盘价为2015年1月6日的新华环保A份额净值（四舍五入至0.001元）。由于新华环保A折算前可能存在折溢价交易情形，且新华环保A份额折算后恢复交易首日的前收盘价以前一日的新华环保A的基金份额净值确定，因此，新华环保A份额折算后恢复交易首日的前收盘价与份额折算前的收盘价格可能发生较大变化。敬请投资者注意投资风险。

（二）本基金新华环保A份额期末的约定应得收益将折算为场内新华环保份额分配给新华环保A份额的持有人，而新华环保份额为跟踪中证环保产业指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此新华环保A份额持有人预期收益的实现存在一定的不确定性，其可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

（三）由于新华环保A份额新增份额折算成新华环保基金份额的场内份额数和新华环保基金份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金财产，持有较少新华环保A份额数或场内新华环保基金份额数的份额持有人存在无法获得新增场内新华环保基金份额的可能性。

投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情，请登陆本公司网站：www.ncfund.com.cn或者拨打本公司客服电话：400-819-8866、010-68730888。

风险提示：

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

新华基金管理有限公司
二〇一四年十二月二十九日

中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的第二次提示性公告

中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）于2014年12月25日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（http://www.szse.cn）及本公司网站（www.lcfunds.com）发布了《中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次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

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《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）的基金管理人中欧基金管理有限公司决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议召开的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2014年12月30日起，至2015年1月28日17:00止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2015年1月30日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：中欧基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行大厦8层

联系人：曹晓曼

联系电话：021－68609600—2011

请在信封表面注明：“中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》（见附件一）。

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2014年12月29日，即在2014年12月29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与本次基金份额持有人大会的表决。

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.lcfunds.com）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（或基金管理人认可的其他印章，下同），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）；

（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（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，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（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；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，并提供机构投资者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（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（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；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，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件，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（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）。

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2014年12月30日起，至2015年1月28日17:00以前（送达时间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办公地址，并请在信封表面注明：“中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下：

基金管理人：中欧基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行大厦8层

联系人：曹晓曼

联系电话：021－68609600—2011

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基金托管人（中国邮政储蓄银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后第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。

2、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之内送达基金管理人的，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内送达基金管理人的，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占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%)；

2、《关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人和其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过；

3、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提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和本公告的规定，并与注册登记机构记录相符；

4、本次基金份额持有人大会议议通过的事项，本基金管理人自生效之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议定的事项自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投权

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达到权益登记日基金总份额的50%以上(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成功召开，根据2013年6月1日生效的《中华人民共和国证券投资基金法》，基金管理人可在规定的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。

八、本次大会相关机构

1、召集人：中欧基金管理有限公司

联系人：牛晨

联系电话：18611773001

传真：021-33830351

网址：www.lcfunds.com

2、监督人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系电话：021－62154848

4、见证律师事务所：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，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、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400-700-9700咨询。

3、2014年12月25日，本基金从开市至10:30停牌1小时后复牌；基金持有人大会计票之日（2015年1月30日），本基金从开市起停牌至基金持有人大会决议生效公告日10:30复牌。

4、基金管理人将在发布《中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》后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。

5、本公告的有关内容由中欧基金管理有限公司负责解释。

中欧基金管理有限公司
2014年12月29日

附件一：《关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》

附件二：《中欧中小盘股票型证券投资基金(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：《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型方案说明书》

附件一：

关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案

中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人：

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，提议对中欧中小盘股票型基金(LOF)（以下简称“中欧中小盘股票型基金(LOF)”）实施转型。《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型方案说明书》见附件四。

为实施中欧中小盘股票型基金(LOF)转型方案，提议授权基金管理人办理本次中欧中小盘股票型基金(LOF)转型的有关具体事宜，对《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》进行修改，并可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《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：中欧基金管理有限公司
2014年12月25日

附件二：

中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：			
基金份额持有人证件号码(身份证件号/营业执照注册号)：			
基金份额持有人基金账户号：			
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
《关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人(代理人)签字或盖章 日期：____年 月 日			

说明：1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“V”，同一议案只能表示一项意见；表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见；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、表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或相互矛盾的表决票均视为授权人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”；4、本表决票可从本基金管理人网站（www.lcfunds.com）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2015年1月28日的以通讯方式召开的中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

若在法定时间内就同一议案重新召开中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本次基金份额持有人大会授权期间本人（或本机构）做出的各类授权依然有效。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

委托人基金账户号：

受托人（代理人）姓名或名称（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

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：

中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)转型方案说明书

一、重要提示

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议关于中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)（以下简称“中欧中小盘股票型基金(LOF)”）转型有关事项的议案。

2、本次中欧中小盘股票型基金(LOF)转型方案需经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持表决权的50%以上(含50%)通过，因此转型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。

3、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，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次中欧中小盘股票型基金(LOF)持有人大会决议的备案，均不表明其对本次转型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。

二、转型方案要点

中欧中小盘股票型基金(LOF)转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)”更名为“中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)”。

（二）变更基金类别

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，“百分之八十以上的基金资产投资于股票的，为股票基金”，故本基金转型后基金类别将由“股票型”变更为“混合型”。

(三)修改基金的投资目标

修改前为：

“本基金主要通过投资于具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型企业，特别是处于加速成长期的中小型企业，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增长。”

修改后为：

“在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期稳定增值。”

（四）修改基金的投资范围

修改前为：

“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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%－95%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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占基金资产的5%－40%，其中现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

对于中小盘股票的界定既要与国内市场的认识相一致，也要能充分展示中小盘股票的投资价值。根据国际市场对股票市值风格的分类方法以及行业内对我国中小盘股票划分比例的较一致的认识，基金管理人将对中国A股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到A股总流通市值67%的这部分股票属于中小盘股票。每年对成份股调整两次，在此期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股上市等），如果其流通市值可满足以上标准，也称为中小盘股票。本基金不低于80%的股票资产将投资于中小盘股票。

一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，本着投资者利益最大化原则，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。

如果今后出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前三个工作日在指定媒体公告变更后具体的计算方法。

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：

本基金股票投资占基金资产的比例为60%－95%，其中投资于成长性行业股票的比例不低于非现金基金资产的80%，权证投资占基金资产净值的比例为0%－3%，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，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

（五）修改基金的投资策略

修改前为：

“本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司。同时，结合盈利预测动态调整策略和动量策略，动态调整股票持仓结构。

1、资产配置策略

本基金将通过分析宏观经济趋势，政府政策行为和资金供需关系三个影响资本市场的主要因素，在股票、债券和现金三大资产类别间实施策略性调控，确定相应大类资产配置比例。

（1）宏观面

从股市与宏观经济的内在作用机理来看，宏观经济决定着股市波动，引起股市上涨的原动力是一国经济的发展，当经济向好时，企业业绩上升，投资股票收益高，资金大量涌入股市，股价持续上升；反之，经济衰退，企业不景气，投资缩减，股价下跌。另一方面，股价会充分反映宏观经济变动的各种信息，当实际公布的经济数据和市场预测相背离时，股市会随之做出相应的修正。鉴于以上内在作用机理的存在，本基金资产配置主要建立在对未来宏观经济走势的预期以及预期和实际偏离的修正上。

（2）政策面

国家政策对股市有着直接的影响，是影响股市走势的主要因素之一，本基金将主要通过分析政府的财政政策、货币政策和其他政策三个方面来判断政策对股市的影响：

国家财政通过税收总量和结构的变化，调节证券投资和实际投资规模，抑制社会投资总需求膨胀或者补偿有效投资需求的不足。当政府实行积极的财政政策，并且财政政策落到实处时，有利于股市。

政府通过适时灵活运用利率、存款准备金率和公开市场操作等政策工具，调节市场资金供求，宽松的货币政策会扩大社会上货币供给总量，对经济发展和证券市场交易有着积极影响。

其他政策（如印花税调整等）会通过影响投资者的股权风险溢价（ERP），从而显著影响估值水平。

（3）资金面

最终决定股市价格水平的因素来源于市场的供需关系，本基金通过分析市场的货币供应量和股票供给量来分析市场的供需关系：当资金充沛，需求大于供给时，股市上升；当供给大于需求时，股市下跌。

（二）行业配置策略

（1）本基金的行业配置特点

本基金的主要特点是对于成长性行业的重点配置。在本基金的投资标的中，成长性行业主要包括以下两种类型：一是从行业的生命周期来看，处于快速成长期和成熟成长期的行业，处于这两个阶段的行业增长率快速提高，企业利润水平超出市场平均水平，获得超额收益率的可能性很高；二是短期内处于复苏景气阶段的行业，部分行业虽然从长期来看并未进入成长阶段，但仍存在阶段性景气复苏的可能性，这往往是由于经济周期波动、供求关系变化等因素造成，从较长时间来看，投资于此类行业的收益率水平往往趋于市场平均值，但若能够准确预计行业的阶段性复苏，则有可能抓住行业阶段性成长的机会。

（2）成长性行业的选择标准

基金管理人将在申银万国一级行业的分类标准基础上，采取定性和定量的指标综合判断行业的成长性。筛选出的成长性行业将每六个月进行更新。

定量标准：

判断一个行业是否具有成长性，其核心是未来获得收入与盈利的能力。为了方便反映行业成长性，基金管理人将对行业的平均主营业务收入增长率、主营业务利润增长率及净利润增长率等成长性指标进行测算，并对测算结果分别进行排序。对于该三项指标中至少有一项增长率超越市场平均水平的行业，将进入本基金管理人重点研究的范围。

定性标准：

对行业基本面的深入分析也是判断成长性行业的重要途径。从行业自身来看，行业的成长性将受到行业发展阶段、行业景气程度、行业竞争状况、政策扶持程度、所处产业链地位、是否具有垄断性等多个定性指标的影响。基金管理人将在对各行业基本面进行分析的过程中，针对各行业的特殊性重点考察对其成长性影响较大的因素。在对行业的上述六个因素深入分析的基础上，基金管理人将分别就每个因素对该行业的影响做出“有利”或“不利”的判断。

综合判断：

在对各行业的定量指标进行排序的基础上，并结合对影响各行业的定性因素做出的“有利”或“不利”的判断，基金管理人将对各行业的成长性进行综合性评分并排序。对于排名处于前80%的行业，将作为成长性行业进入本基金重点研究和投资的范围。

（三）个股选择策略

本基金将重点选择成长性行业内基本面优良且具有成长潜力的股票进行最终的投资组合构建。

本基金将重点分析各成长性行业内公司的成长性指标（市盈增长比率（PEG），近三年平均主营业务收入增长率、近三年平均息税折旧前利润（EBITA）增长率、未来一年预测每股收益（EPS）增长率等），价值指标（市盈率（P/E）、市净率(P/B)、每股收益(EPS)、股息率等），盈利指标（近三年平均净资产收益率（ROE），近三年平均投资资本回报率（ROIC）等）等，筛选出基本面良好、成长潜力较大的股票进行投资。

（四）债券选择策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。

1、久期偏离

本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析，预测利率的变化趋势，从而采取久期偏离策略，根据对利率水平的预期调整组合久期。

2、期限结构配置

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

3、类属配置

类属配置指债券组合中各债券种类间的配置，包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布，债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

4、个券选择

个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素，确定一定期限下的债券品种的过程。

（四）股指期货投资策略

本基金投资股指期货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合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

（五）资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

（六）权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。”

（六）修改基金的投资限制

修改前为：

“1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

（2）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%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（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%；

（6）本基金股票投资的比例范围为基金资产的60%－95%；债券、权证、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为5%－40%；

（7）本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票资产的80%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）本基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；

（13）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；

（14）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%；

（15）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；

（16）如果法律法规对本基金合同约定投资组合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