华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开华安上证龙头企业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《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华安上证龙头ETF联接”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工商银行股份有限公司（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《关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及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2023年2月13日起，至2023年2月20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上证龙头ETF联接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：刘昕玥

联系电话：021-38969729

如基金份额持有人仅参与本基金基金份额持有人大会的表决，请在信封表面注明：“华安上证龙头企业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”；

如基金份额持有人同时参与本基金及上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标ETF”）基金份额持有人大会的表决，请在信封表面注明：“上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及华安上证龙头企业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表决专用”。

4、本基金的目标ETF因上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金将自2023年2月13日起至2023年2月20日17:00止以通讯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2023年2月13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。

为方便本基金基金份额持有人对目标ETF基金份额持有人大会事项进行表决，本次基金份额持有人大会的表决票、授权委托书包括仅参与本基金基金份额持有人大会或同时参与本基金及目标ETF基金份额持有人大会两种情形，基金份额持有人可根据参与持有人大会的情况选择填写。具体说明详见附件二及附件三。

二、会议审议事项

本次基金份额持有人大会拟审议的事项为《关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及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《关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及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2023年2月13日，2023年2月13日交易时间结束后，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。

四、表决票的填写和寄交方式及授权

1、本次会议表决票样本详见附件二。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）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）下载并打印表决票。

就表决票的填写：

（1）如基金份额持有人仅对本次会议事项进行表决的，请填写《华安上证龙头企业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票》；

（2）如基金份额持有人同时对本次会议及目标ETF基金份额持有人大会进行表决的，请填写《华安上证龙头企业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及上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决票》。

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加盖公章（如有）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，并提供机构投资者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加盖公章（如有）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2023年2月13日起，至2023年2月20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。

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上证龙头ETF联接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：刘昕玥

联系电话：021-38969729

如基金份额持有人仅参与本基金基金份额持有人大会的表决，请在信封表面注明：“华安上证龙头企业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”；

如基金份额持有人同时参与本基金及目标ETF基金份额持有人大会的表决，请在信封表面注明：“上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及华安上证龙头企业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表决专用”。

4、基金管理人可授受本基金的特定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出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。

5、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。

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督员在本基金托管人（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，如果能判断收到时间先后的，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；若无法判断收到时间先后的，则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%）；

2、本次议案须经参加会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；

3、2023年2月13日至2023年2月20日以通讯方式召开的目标ETF基金份额持有人大会决议通过，是本基金份额持有人大会决议生效的前提；

4、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基金份额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投权

根据《基金法》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：中国工商银行股份有限公司

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、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凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，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份额的总数乘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体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，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。

2、若本次基金份额持有人大会审议的转型事宜获表决通过，本基金将转型为华安上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金。本基金自决议生效公告日起（含当日）暂停办理申购赎回，目标ETF将于目标ETF基金合同生效后进入调仓期，目标ETF调仓期内本基金暂停办理申购赎回，详见基金管理人届时发布的相关公告，无意持有华安上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额的投资者请做好退出安排。

3、目标ETF对于调仓期内停牌的股票，在其复牌后调整为上证50指数成份股，在此之前可能导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

4、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。

5、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）或中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）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。

6、若2023年2月13日至2023年2月20日以通讯方式召开的目标ETF的基金份额持有人大会审议的事项未获表决通过，则无论本基金份额持有人大会决议事项是否通过，本基金份额持有人大会决议不生效。

7、本次基金份额持有人大会召开期间，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、转换及定期定额投资业务。相关业务若有变化，详见基金管理人发布的相关公告。

8、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：《关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《华安上证龙头企业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票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《（关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及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
2022年12月28日

附件一：《关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》

华安上证龙头企业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

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《华安上证龙头企业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，本基金管理人经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议对华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金进行转型，基金名称变更为“华安上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，并修改标的指数、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《（关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及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
2022年12月28日

附件二：

华安上证龙头企业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票

（适用于仅对联接基金基金份额持有人大会议案行使表决权的联接基金份额持有人）

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）：			
基金账户号：			
审议事项	同意	反对	弃权
关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及修改基金合同等相关事项的议案			
基金份额持有人/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、本表决票中“基金账户号”，指持有华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金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华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金所有份额。

（本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站（www.huaan.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

华安上证龙头企业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及上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决票

（适用于分别对联接基金基金份额持有人大会议案及上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会议案行使表决权的联接基金份额持有人）

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）：			
基金账户号：			
审议事项	同意	反对	弃权
关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及修改基金合同等相关事项的议案			
关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等相关事项的议案			
基金份额持有人/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。联接基金份额持有人可以分别对联接基金基金份额持有人大会议案及上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会议案行使表决权。对于每一项议案，联接基金持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表联接基金基金份额持有人所属基金账户号的全部联接基金基金份额（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”，计入有效表决票。签字/盖章部分不完整、不清晰的，将视为无效表决。

3、在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

4、本表决票中“基金账户号”，指持有华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金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华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金所有份额。

（本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站（www.huaan.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）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（请认打“√”方式选择授权受托人参加的基金份额持有人大会）：

☐ 投票截止日为2023年2月20日的以通讯方式召开的华安上证龙头企业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，

☐ 投票截止日为2023年2月20日的以通讯方式召开的上证龙头企业交易型开放式指数证券投资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。若上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金或华安上证龙头企业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基金份额持有人大会的，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、如本次基金份额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：《关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》的说明

《华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2010年11月18日生效，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。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《华安上证龙头企业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，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《关于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》。本次华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更事宜，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。

本次华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金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50%以上（含50%）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上证龙头企业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，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50%以上（含50%）。

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上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金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“华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金”更名为“华安上证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、基金名称：华安上证50交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

2、基金类别：股票型证券投资基金、ETF联接基金。

3、运作方式：契约型，开放式。

4、基金存续期限：不定期。

5、标的指数：上证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。

6、基金份额类别：

本基金根据申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别的基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

（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，把全部或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）、货币市场工具、股指期货、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货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）。

基金管理人在履行适当程序后，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，该部分资产占基金资产净值的比例不低于90%。为更好地实现投资目标，本基金可投资于标的指数成份股及其备选成份股，且可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货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，达到有效跟踪对标的指数的目的。

（6）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。

（7）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%；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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%；

（7）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；

（8）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；

（9）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）、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；

（10）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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

（11）基金总资产不超过基金净资产的140%；

（12）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%；

（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（14）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本基金同约定的投资范围保持一致；

（15）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）、（7）、（13）、（14）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，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。

5、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：95%×上证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%×上证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规定媒介公告。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规定媒介上及时公告，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、证券交易所上的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（包括股票等），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、债券，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；

（3）流通受限的股票，包括但不限于非公开发行股票、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