# 华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

华宝基金管理有限公司已于2025年7月21日在《中国证券报》、华宝基金管理有限公司官网（www.fsfund.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）发布了《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金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，现发布华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、会议基本情况

华宝基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已以通讯方式组织召开了华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：159716，场内简称：深创100ETF，以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会（以下简称“第一次持有人大会”），投票期间为2025年3月28日起至2025年4月18日17:00止，审议《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》。由于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未达到第一次持有人大会权益登记日基金总份额的二分之一，未达到法定的基金份额持有人大会召开条件，故第一次持有人大会召开失败，详情请阅本基金管理人于2025年4月22日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》。

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》等法律法规和《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》的有关规定，第一次持有人大会未能成功召开的，基金管理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）基金份额的持有人参加方可召开。确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

基金管理人经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式重新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《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》，本次大会的权益登记日仍为2025年3月27日（第一次持有人大会权益登记日），权益登记日持有本基金基金份额的基金份额持有人有权参与投票。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自2025年8月4日起至2025年8月22日17:00止（以基金管理人收到表决票的时间为准）

3、会议通讯表决票的寄达地点

收件人：华宝基金管理有限公司

地址：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57楼

邮政编码：200120

联系人：龙怡

联系电话：400-700-5588，400-820-5050

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封表面注明：“华宝深证创新100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专用”。

二、会议审议事项

《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《（关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案）的说明》（见附件二）。

三、权益登记日

本次会议的权益登记日为2025年3月27日（第一次持有人大会权益登记日），即该日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的全体基金份额持有人均享有本次会议的表决权。

四、表决票的填写和寄交方式

（一）本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过登录基金管理人网站（www.fsfund.com）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）下载并打印或从报纸上剪裁、复印表决票。

（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、个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证件正反面复印件；

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、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，应由委托人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者有效身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件四）。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的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）；

4、机构投资者委托他人投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者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），以及填妥的授权委托书原件（详见附件四）。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的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）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由受托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和填妥的授权委托书原件（详见附件四）。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的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）；

5、以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

（三）基金份额持有人或其受托人需将填妥的表决票和所需的相关文件于前述会议投票表决起止时间内（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄的方式送达至本公告列明的寄达地点，并请在信封表面注明：“华宝深证创新100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专用”。

（四）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400-820-5050咨询。

五、计票

1、本次会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人中国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予以公证。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。

2、权益登记日登记在册的基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，且每一基金份额享有平等的表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达基金管理人的，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会议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、无法辨认、意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，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会议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受托人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次会议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。

（5）根据第一次持有人大会的相关公告，基金份额持有人在第一次召集的基金份额持有人大会所投的有效表决票在本次会议时依然有效，但如果基金份额持有人重新进行投票的，则以最新的有效表决票为准。

（6）授权效力确定规则

1）最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人多次以有效书面方式授权的，以最后一次书面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次，不能确定最后一次书面授权的，以表示具体表决意见的书面授权为准；最后时间收到的多次书面授权均为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）直接表决优先规则

如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准。

3）根据第一次持有人大会的相关公告，除非授权文件另有载明，第一次召集的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在本次会议时依然有效，但如果授权方式发生变化或基金份额持有人重新做出授权，则以根据本公告规定的授权效力确定规则确定的最新有效授权为准。

六、会议决议生效条件

1、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不小于在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一），则本次通讯方式开会视为有效。

2、《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》应当由提交有效表决票的本基金基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

3、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5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本次会议表决通过之日起生效。

七、本次会议相关机构

1、召集人：华宝基金管理有限公司

联系地址：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57楼

联系人：龙怡

联系电话：021－38505888

客户服务电话：400-700-5588、400-820-5050

网址：www.fsfund.com

2、基金托管人：中国银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

联系电话：95566

网址：www.boc.cn

3、公证机关：上海市东方公证处

联系地址：上海市凤阳路660号

联系人：林奇

联系电话：021－62154848

邮政编码：200041

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

八、重要提示

1、本基金将于基金份额持有人大会计票日（2025年8月25日）开市起停牌，基金份额持有人大会表决结果公告日上午10:30起复牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

2、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。

3、本次会议有关公告可通过本基金管理人网站（www.fsfund.com）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400-700-5588或400-820-5050咨询。

4、基金管理人将下个工作日再次公布相关提示性公告，就本次会议相关情况做必要说明，请予以留意。

5、本公告的有关内容由华宝基金管理有限公司负责解释。

华宝基金管理有限公司

2025年7月22日

附件一：《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》

附件二：《（关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案）的说明》

附件三：《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）表决票》

附件四：《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人授权委托书》

附件一：

关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案

华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人：

由于市场环境变化，为更好地满足投资者需求，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》等法律法规和《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经本基金管理人与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定召开华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》（以下简称“议案”），拟修改本基金标的指数、投资范围、投资策略、投资组合管理、投资限制、业绩比较基准等，并相应将基金名称变更为“华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金”，以及根据最新法律法规对《基金合同》进行相应修改。

为实施本次会议议案，提议授权基金管理人办理本次《基金合同》修改的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施变更前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在变更实施前，制订有关基金变更正式实施的日期并提前公告。

以上议案，请予审议。

华宝基金管理有限公司

2025年7月22日

附件二：《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》的说明

华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）于2021年6月18日成立并正式运作。为更好地满足投资者需求，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》等法律法规和《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人华宝基金管理有限公司经与基金托管人中国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，审议本基金转型并修改《基金合同》等事宜。

《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等有关事项的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持份额表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。基金管理人自表决通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决议通过后，本基金管理人可根据市场情况确定本基金变更正式实施的具体时间，具体安排将由基金管理人在相关公告中列明。

中国证监会对本次基金份额持有人大会决议的备案，均不表明其对本次合同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。

一、基金变更方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金”变更为“华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金”。

（二）修改标的指数

标的指数由“深证创新100指数”修改为“深证100指数”。

（三）转型后投资目标、投资范围、投资策略、投资组合管理、投资限制、业绩比较基准等内容。

1、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

2、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、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的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资以及转融通证券出借业务。

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。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；股指期货及其他金融工具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

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

（1）组合复制策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件而临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

（2）替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

（3）债券投资策略

本基金可适当参与债券投资，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，降低基金的跟踪误差。

（4）资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，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，控制信用风险和流动性风险的前提下，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。

（5）股指期货投资策略

在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用股指期货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，降低跟踪误差，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

（6）可转债投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析的基础上，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券。

（7）转融通投资策略

为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的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、基金历史申赎情况、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。

（8）融资投资策略

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成的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。

（9）存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

4、投资组合管理

本基金的指数化投资采用组合复制法，按照成份股在深证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

（1）标的指数定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

（2）成份股公司信息的日常跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。

（3）标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

（4）申购赎回情况的跟踪与分析

跟踪本基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。

5、跟踪偏离度的监控与管理

每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。

在正常情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。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。

6、投资限制

（1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；

2）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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，持有的买入股指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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；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%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）；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；

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）本基金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；

10）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；

11）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；

12）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

13）本基金参与融资，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%；

14）本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

①参与转融通证券出借业务的资产不得超过基金资产净值的30%，其中出借期限在10个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

②参与转融通证券出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的30%；

③最近6个月内日均基金资产净值不得低于2亿元；

④证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

15）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

16）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7）、10）、11）、14）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、期货市场波动、上市公司合并、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上述第14）项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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照调整后的规定执行。

（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）从事承担无限责任的投资；

4）买卖其他基金份额，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的同意，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或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

6、标的指数

深证100指数。

7、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即深证100指数收益率。

未来若出现标的指数不符合要求（不包括因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如对基金份额持有人利益有实质性影响，则在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

8、风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

（四）转型后基金的费率结构与费率水平

（1）申购费、赎回费率

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.50%的标准收取佣金。

（2）管理费率

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。

（3）托管费率

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。

（五）其他修改内容

为使《基金合同》适应新的法律法规要求和业务需要，在根据上述基金变更方案要点修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他部分条款一并进行了修改。

（六）授权基金管理人修订《基金合同》

基金管理人将根据法律法规的规定及变更后的华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金的产品特征对《基金合同》进行其他必要修改或补充。

二、转型选择期和调仓期安排

若本次基金份额持有人大会审议的转型事宜获表决通过，本基金将安排转型选择期。具体转型选择期安排以本基金管理人届时发布的相关公告为准。转型选择期结束后，本基金将转型为华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金，无意持有华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金基金份额的投资者请做好退出安排。

届时本基金管理人将进行调仓，为保证本基金顺利转型，本基金管理人将根据实际业务需要向深圳证券交易所申请停牌，为保护基金份额持有人利益，本基金管理人可按照《基金合同》规定暂停接受投资者的申购赎回申请，具体规定详见基金管理人届时发布的相关公告。

三、基金管理人对《基金合同》修改相关情况的说明

（一）历史沿革

华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2021年3月31日《关于准予华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可【2021】1088号）准予募集，基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金自2021年6月1日至2021年6月11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，《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2021年6月18日起正式生效。

（二）基金变更法律方面的可行性

本次对《基金合同》的修改事宜符合《基金合同》第十部分“基金份额持有人大会”的规定，对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的事项，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。因此，本次基金相应修改《基金合同》不存在法律方面的障碍。

（三）修改基金合同运作方面的可行性

本次转型不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，技术上实现难度较小。

本基金转型后，将进行基金份额变更登记。华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额将变更登记为华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金基金份额。基金管理人已就变更登记有关事项进行了充分准备，技术可行。本次修改《基金合同》不存在技术障碍。

（四）基金管理人修订基金合同的可行性

基金管理人将严格按照基金份额持有人大会决议以及法律法规的规定修订《基金合同》。

四、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

华宝基金管理有限公司

客户服务电话：400-700-5588、400-820-5050

网站：www.fsfund.com

五、基金合同修改内容

| 章节 | 原文条款内容 | 修改归并条款内容 |
|---|---|---|
| 全文 | 华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金 | 华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金 |
| 第一部分 前言 | 三、华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金由基金管理人依据《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会以证监许可【2021】1088号文准予注册。<br>“中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。” | 三、华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）由华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金变更注册而来。华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会以下简称“中国证监会”证监许可【2021】1088号文准予注册。<br>“中国证监会对华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金变更为本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。” |
| 第二部分 释义 | 1、基金或本基金：指华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金<br>4、基金合同或本基金合同：指《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充<br>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充<br>6、招募说明书：指《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新<br>7、基金产品资料概要：指《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》及其更新<br>8、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局<br>23、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者<br>24、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资的合称<br>25、特定投资者：指根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供分公司提供的《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》所定义的特定投资者<br>27、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金、办理基金申购赎回申购、赎回等业务<br>30、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件、取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托代为办理基金销售业务的机构<br>36、基金合同生效日：指《华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效之日，即《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》3日后起始日<br>37、证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所<br>38、基金份额持有人：指《华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限<br>40、标的指数：指深圳证券信息有限公司编制并发布的深证100指数及其未来可能发生的变更<br>删除：<br>9、基金份额发售公告：指《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》<br>9、上市交易公告书：指《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》<br>33、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构<br>41、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月<br>49、认购：指在基金募集期内，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为 |
| 第三部分 基金的基本情况 | 一、基金名称<br>华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金<br>五、基金的标的指数<br>深证创新100指数 | 一、基金名称<br>华宝深证100交易型开放式指数证券投资基金<br>五、基金的标的指数<br>深证100指数<br>删除：<br>六、基金的最低募集份额总额、金额和募集目标上限<br>本基金的最低募集份额总额为2亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于2亿元人民币。本基金不设募集目标上限。<br>七、基金份额发售面值和认购费用<br>本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。<br>本基金执行认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。 |
| 第四部分 基金的近况 | 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象<br>1、发售时间<br>自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。<br>2、发售方式<br>投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。<br>“网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购。<br>网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。<br>网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行认购。<br>投资者应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构按提交认购方式、办理基金发售业务的具体场所和联系方式，通告其基金份额发售公告。<br>发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告。基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，并在基金管理人网站公示。<br>销售机构对认购申请的受理并不代表申请一定生效，而仅代表销售机构实际收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。<br>投资者申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。<br>3、发售对象<br>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。<br>二、基金份额的认购<br>1、认购费用<br>本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。<br>2、募集期认购资金与股份登记<br>基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。认购款项在募集期间产生的利息的处理方式详见本基金招募说明书。投资者认购申请的，认购款项由发售代理机构代为托管。<br>该投资日认购日至登记机构进行股票过户日的冻结期间所产生的利息归属投资者。<br>3、基金认购份额的计算<br>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。<br>三、基金认购的具体规定<br>投资者认购款项、认购规模、认购份额的