

海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证可质押城投债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

一、会议基本情况

海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据中国证监会证监许可〔2014〕932号文准予募集注册的上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)于2014年11月13日成立,并于2014年12月16日在上海证券交易所上市交易。

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》等法律法规的规定和《上证可质押城投债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》”)的有关约定,本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会,审议《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2019年3月27日起,至2019年4月22日17:30止(投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准)。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人,具体地址和联系方式如下:

收件人:吴晨莺

地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36层

邮政编码:200120

联系电话:021-38650821

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》(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2019年3月26日,即在2019年3月26日上海证券交易所交易结束后,在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、纸质表决票的填写和寄交方式

1、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.hftfund.com>)下载并打印等方式获取表决票。

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相关的业务专用章,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事业单位法人登记证书、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,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。

①. 个人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,并提供个人投资者身份证件正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(参照附件二)。如受托人为个人,还需提供受托人的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,并提供持有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),以及填妥的授权委托书原件。如受托人为个人,还需提供受托人的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,以及填妥的授权委托书原件。如受托人为个人,还需提供受托人的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) 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受托人需将填妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内(自 2019 年 3 月 27 日起,至 2019 年 4 月 22 日 17:30 止,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的办公地址,请在信封表面注明:“上证可质押城投债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”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式: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)授权代表的监督下在表决截止日期后 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、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)纸面表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的,表决时间以基金管理人收到表决票时间为准。2019 年 4 月 22 日 17:30 以后送达收件人的纸面表决票,均为无效表决。

(2)纸面表决票的效力认定:

① 纸面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 如纸面表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、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 如纸面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面表决票的,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:

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:专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以本公告规定的收件

人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金份额持有人持有的每一份基金份额有一票表决权；

2、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二分之一（含二分之一）；

3、《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》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二分之一以上(含二分之一)通过方为有效；

4、本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授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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本基金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)。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,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:海富通基金管理有限公司

地址:上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦36层

客服电话:40088-40099

联系人:吴晨莺

联系电话:021-38650821

网址:<http://www.hftfund.com>

2、公证机构:上海市东方公证处

地址:上海市凤阳路660号

联系人:林奇

联系电话:021-62154848

3、见证律师:上海市通力律师事务所

注册及办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话:(021)31358666

4、基金托管人：中国银行股份有限公司

九、重要提示

1、请基金份额持有人在邮寄表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

2、若本次基金份额持有人大会议案获得通过,则本基金变更为上证城投债交易型开放式指数证券投资基金,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。

3、上述基金份额持有人大会有关公告可通过海富通基金管理有限公司网站(<http://www.hftfund.com>)查阅,投资者如有任何疑问,可致电 40088-40099 (咨询)。

4、正式变更日(不含)前,本基金的申购、赎回及二级市场交易按照本基金原基金合同、招募说明书(更新)及上海证券交易所的规定正常办理。自正式变更日起,上证城投债交易型开放式指数证券投资基金的日常申购、赎回业务,二级市场交易办理不受变更影响。上述业务未来如若发生变动,本基金管理人将及时发布公告,敬请投资者留意。

5、本公告的有关内容由海富通基金管理有限公司解释。

特此公告。

海富通基金管理有限公司

2019年3月23日

附件一:《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》及其说明

附件二:《授权委托书》(样本)

附件三:《上证可质押城投债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》

附件一:《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人:

根据市场环境变化、标的指数的代表性和投资适合性,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《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,变更上证可质押城投债交易

型开放式指数证券投资基金的标的指数为上证城投债指数，同时变更基金名称、投资范围、业绩比较基准等，并据此修改《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

基金管理人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，根据现时有效的法律法规对《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》进行其他必要的修订和补充。

《基金合同》修改的具体方案和程序可参见《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项议案的说明》。

以上议案,请予审议。

海富通基金管理有限公司

2019年3月23日

《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项议案的说明》

一、声明

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金成立于2014年11月13日,基金托管人为中国银行股份有限公司。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,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《上证可质押城投债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,本基金管理人经与基金托管人协商一致,决定召开基金份额持有人大会,审议《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

- 1、本次修改合同事项需经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。
- 2、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议自表决通过之日起生效。
- 3、中国证监会对本次修改《基金合同》所作的任何决定或意见，均不表明其对本次修改《基金合同》后基金的价值或投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、对原基金合同的主要修订如下：

1、本基金的基金名称变更为：上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

2、本基金的标的指数变更为：上证城投债指数

3、本基金的投资范围变更为：

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、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、同业存单、货币市场工具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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券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%。

4、本基金的业绩比较基准变更为：上证城投债指数收益率。

三、其他需要提示的事项

基金管理人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，根据现时有效的法律法规对《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》进行了其他必要的修订和补充。并根据《基金合同》修订内容相应修改了本基金托管协议及招募说明书。

基金管理人将及时发布变更后的法律文件，届时投资者可通过本基金管理人网站查阅。

附表：基金合同修订对照表

章节

修改前

修改后

基金名称

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

.....

三、上证可质押城投债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”)注册。

中国证监会对本基金的募集注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

.....

.....

三、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金由上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金转型而来，上证可质押城投债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”)注册。

中国证监会对上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金转型为本基金的募集变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

释义

1、基金或本基金：指上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

.....

4、基金合同或本基金合同：指《上证可质押城投债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

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上证可质押城投债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

6、招募说明书：指《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

.....

10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

.....

11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 2 月 17 日修订通过、同年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

27、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与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

28、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、在募集期间代理本基金发售业务的机构

.....

33、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

35、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，最长不超过三个月。

.....

42、认购：指在基金募集期内，投资人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

49、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的上证可质押城投债指数及其未来可能发生的变更

56、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

59、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

60、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

61、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

62、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

1、基金或本基金：指上证城投债交易型开放式指数证券投资基金，由上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金转型而来

.....

4、基金合同或本基金合同：指《上证城投债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

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《上证城投债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

6、招募说明书：指《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

删除。

.....

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布的、同年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

.....

26、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与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，主要指申购

赎回代理券商

删除。

.....

31、基金合同生效日：指《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效日，原《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》自同一日终止

.....

删除。

删除。

45、标的指数：指中证指数有限公司编制并发布的上证城投债指数及其未来可能发生的变更

52、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

53、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

54、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

55、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

56、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

删除。

基金的基本情况

一、基金名称

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

.....

五、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

六、基金份额初始面值和认购费用

本基金基金份额发售初始面值为人民币 1.00 元。

本基金具体认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。

七、基金存续期限

不定期

八、开通场外认购、申购、赎回等相关业务

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，开通场外认购、申购、赎回等相关业务并制定、公布相应的交易规则，而无

需召开基金份额持有人大会审议。

一、基金名称

上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

.....

五、基金的存续期限

不定期

删除。

基金份额的发售

第四部分 基金份额的发售

一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

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。

2、发售方式

投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购 3 种方式。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；网下债券认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构以债券进行的认购。

投资人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、发售代理机构可接受的认购方式、办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告或相关公告。

各发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告。基金管理人可以根据情况调整发售代理机构，并另行公告。

3、发售对象

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、机构投资者和合格境外机构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人。

二、基金份额的认购

1、认购费用

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。在基金管理人或发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用，具体在招募说明书中列示。

2、基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

3、认购申请的确认

基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

4、投资人具体的认购原则、认购限额、认购份额的计算公式、认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在招募说明书或基金份额发售公告中披露。

三、基金份额认购金额的限制

1、投资人认购时，需按基金管理人和/或发售代理机构规定的方式全额缴款或备有足额认购债券。

2、基金管理人可以对每个账户的单笔最低认购份额或认购债券数进行限制，具体限制请参看招募说明书。

3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购份额或认购债券数进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。

4、投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

四、募集期间资金与债券的处理方式

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用；网下债券认购募集的债券由登记机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

第四部分 基金的历史沿革

上证城投债交易型开放式指数证券投资基金由上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金转型而成。

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会证监许可[2014]932号文准予注册，于2014年10月17日至2014年11月7日期间公开发售。经中国证监会书面确认，《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2014年11月13日生效，于2014年12月16日在上海证券交易所上市交易，基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

2019年【】月【】日至2019年【】月【】日，上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会讨论通过了《关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金变更标的指数、投资相关条款、业绩比较基准以及修订基金合同等，并同意将上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金更名为“上证城投债交易型开放式指数证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自上述基金份额持有人大会决议生效之日起，《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效，《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

基金备案

第五部分 基金备案

一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币(含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值)且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会

确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将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；网下债券认购所募集的债券由登记机构予以冻结。

二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券，登记机构应予以解冻，发售代理机构将协助基金管理人、登记机构完成相关资金和证券的退还工作；
- 3、如基金募集失败，基金管理人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

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，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

第五部分 基金的存续

《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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

基金份额的上市交易

一、基金份额上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市

规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市：

- 1.基金募集金额（含网下债券认购所募集债券按基金合同约定的估值方法计算的价值）不低于 2 亿元；
- 2.基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3.《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金份额上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金份额上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

六、若上海证券交易所增加交易型开放式指数基金分级业务模式及具体业务规则，本基金管理人可与基金托管人协商一致后，增加本基金分级份额。

七、在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可申请在其他证券交易所同时挂牌交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

删除。

后续段落序号前移。

删除。

基金份额的申购与赎回

二、申购和赎回的开放日及时间

1. 申购、赎回的开始时间

本基金可在基金份额上市交易之前开始办理申购,但在基金份额申请上市期间基金可暂停办理申购。

本基金自基金合同生效后不超过 3 个月的时间内开始办理赎回。

五、申购和赎回的数量限制

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。

七、拒绝或暂停申购、赎回的情形

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购、赎回申请:

1、不可抗力导致基金无法接受申购、赎回申请;

2、上海证券交易所或银行间市场交易时间决定临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

- 3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构因异常情况无法办理申购、赎回申请；或者因指数编制单位、相关证券交易市场等的异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- 4、基金管理人开市前未能公布申购赎回清单；
- 5、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 6、基金管理人无正当理由认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- 7、本基金当日总申购份额/总赎回份额达到基金管理人所设定的上限，基金管理人可拒绝申购、赎回申请。
- 8、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 9、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 10、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受申购、赎回申请或延缓支付赎回对价。
- 11、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述 1、2、3、4、5、8、9、10、11 项情形之一且基金管理人决定暂停申购或赎回时，基金管理人应根据有关规定在指定媒介刊登暂停申购或赎回公告。

对于上述第 7 项情况，基金管理人于前一交易日设定并在基金管理人网站上公布当日申购限额/当日赎回份额，而不必在指定媒介上公告也无须报中国证监会备案。

在暂停申购或赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并予以公告。

巨额赎回指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数的余额)超过上一开放日基金总份额 10%的情形。

八、基金的非交易过户、冻结和解冻

登记机构可根据其业务规则受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

九、其他

1、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的资金或组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下时，基金管理人可以根据具体情况开通本基金的场外申购赎回等业务，场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。基金管理人也可采取其他合理的申购赎回方式，并于新的申购赎回方式开始执行前提前予以公告。基金管理人可以在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

3、基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、对于符合《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

1. 申购、赎回的开始时间

删除。

删除。

后续段落序号前移。

七、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、不可抗力导致基金无法接受申购申请；
- 2、上海证券交易所或银行间市场交易时间决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构因异常情况无法办理申购申请；或者因指数编制单位、相关证券交易市场等的异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- 4、基金管理人开市前未能公布申购赎回清单；
- 5、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 6、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
- 7、本基金当日总申购份额达到基金管理人所设定的上限，基金管理人可拒绝申购申请；
- 8、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形；
- 9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停

接受申购申请；

10、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1、2、3、4、5、8、9、10 项情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应根据有关规定在指定媒介刊登暂停申购公告。

对于上述第 7 项情况，基金管理人于前一交易日设定并在基金管理人网站上公布当日申购限额，而不必在指定媒介上公告也无须报中国证监会备案。

在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告。

八、暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、不可抗力导致基金无法接受赎回申请；

2、上海证券交易所或银行间市场交易时间决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构因异常情况无法办理赎回申请；或者因指数编制单位、相关证券交易市场等的异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；

4、基金管理人开市前未能公布申购赎回清单；

5、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

6、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益时，可暂停接受投资人的赎回申请；

7、本基金当日总赎回份额达到基金管理人所设定的上限，基金管理人可拒绝赎回申请；

8、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受赎回申请或延缓支付赎回对价；

9、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述 1、2、3、4、5、8、9 项情形之一且基金管理人决定暂停赎回时，基金管理人应根据有关规定在指定媒介刊登暂停赎回公告。

对于上述第7项情况，基金管理人于前一交易日设定并在基金管理人网站上公布当日赎回限额，而不必在指定媒介上公告也无须报中国证监会备案。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

九、基金的非交易过户、冻结和解冻

登记机构可根据其业务规则受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

十、其他

1、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的资金或组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

2、基金管理人也可采取其他合理的申购赎回方式，并于新的申购赎回方式开始执行前提前予以公告。基金管理人可以在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

3、基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、对于符合《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，安排专门的申购方式，并于新的申购方式开始执行前另行公告。

基金合同当事人及权利义务

（二） 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换的业务规则；

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1)依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，编制申购赎回清单；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(12) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换的业务规则；

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1)依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、

赎回和登记事宜；

(2) 办理基金注册或备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，编制申购赎回清单；

删除。

后续段落序号前移。

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰伍拾伍万贰仟肆佰叁拾柒元整

基金合同当事人及权利义务

三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金认购款项和认购债券、申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (4) 缴纳基金申购对价、赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

基金份额持有人大会

一、召开事由

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：

- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

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：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；

- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(4) 因相应的法律法规、证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

- (6) 调整本基金份额类别设置；

(7) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

一、召开事由

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：

- (4) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

2、在法律法规和《基金合同》规定的范围内，且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规、证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 调整本基金份额类别设置；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

基金的投资

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、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、货币市场工具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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%。

二、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、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、同业存单、货币市场工具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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 80.90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

基金的投资

三、投资策略

（三）衍生品投资

未来，如法律法规或监管机构允许基金投资于其他与利率、标的指数、标的指数成份债券或构成基金组合的其他非成份债券相关的各种衍生工具，如远期、掉期、期权、期货等，以及其他投资品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金进行衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪业绩比较基准，以便更好地实现基金的投资目标。

三、投资策略

（三）资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

基金的投资

四、投资限制

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

.....

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。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本基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

.....

除上述第(8)、(11)、(12)项情形外，因证券、期货市场波动、标的指数成份债券调整、标的指数成份债券流动性限制、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。

四、投资限制

(1) 本基金投资于标的指数成份债券和备选成份债券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%；

.....

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。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本基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

.....

除上述第(8)、(11)、(12)项情形外，因证券、期货市场波动、标的指数成份债券调整、标的指数成份债券流动性限制、基金规模变动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。法律法规另有规定的，从其规定。

基金的投资

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准即标的指数，上证可质押城投债指数。

上证可质押城投债指数由中证指数有限公司编制及发布，指数样本由沪市剩余期限 1 年以上、债项评级为投资级以上、符合中国证券登记结算有限责任公司对可质押债券要求的城投类债券样本组成，为债券投资者提供新的投资标的。

如果中证指数有限公司变更或停止上证可质押城投债指数的编制及发布，或者上证可质押城投债指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致上证可质押城投债指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与托管人协商一致，通过适当的程序变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并同时更换本基金的基金名称。若标的指数和业绩比较基准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），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

六、风险收益特征

本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证可质押城投债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

七、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准即标的指数收益率，上证城投债指数收益率。

上证城投债指数由中证指数有限公司编制及发布，指数样本由沪市剩余期限 1 年以上、债项评级为投资级以上的信用债券样本组成，为投资者提供新的投资标的。

如果中证指数有限公司变更或停止上证城投债指数的编制及发布，或者上证城投债指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致上证城投债指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与托管人协商一致，通过适当的程序变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并同时更换本基金的基金名称。若标的指数和业绩比较基准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），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备

案并及时公告。

六、风险收益特征

本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证城投债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

删除。

基金资产的估值

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

.....

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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，按最近交易日的收盘价估值。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、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

.....

(2) 交易所上市实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定；

.....

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以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。

基金资产的估值

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金的费用与税收

三、不列入基金费用的项目

3、《基金合同》生效前的相关费用；

三、不列入基金费用的项目

3、《基金合同》生效前的相关费用根据《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定执行；

基金的收益与分配

一、基金收益分配原则

3、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.25%以上，方可进行收益分配；

二、基金收益分配数额的确定

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率、标的指数同期增长率。

基金收益评价日本基金基金净值增长率减去标的指数同期增长率等于或大于 0.25%的，基金管理人可以进行收益分配。

一、基金收益分配原则

3、基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.1%以上，方可进行收益分配；

二、基金收益分配数额的确定

1、在收益评价日，基金管理人计算基金净值增长率、标的指数同期增长率。

基金收益评价日本基金基金净值增长率减去标的指数同期增长率等于或大于 0.1%的，基金管理人可以进行收益分配。

基金的会计与审计

一、基金的会计政策

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；

一、基金的会计政策

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

基金的信息披露

五、公开披露的基金信息

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。……

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告

（六）基金资产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

（八）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

（九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

7、基金募集期延长；

五、公开披露的基金信息

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。……

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金转型经中国证监会变更注册后，基金管理人应当将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

删除。

后续段落序号前移。

（二）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

（六）基金资产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

（七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

（八）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

删除。

后续段落序号前移。

增加：

（十一）投资资产支持证券的信息

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

基金的信息披露

五、公开披露的基金信息

五、公开披露的基金信息

增加：

（十一）投资资产支持证券的信息

本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

.....

基金合同的效力

.....

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后

.....

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，经 2019 年【】月【】日上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案。自 2019 年【】月【】日起，《基金合同》生效，原《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》同日起失效。

2、《基金合同》的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

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：

海富通基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36 层

邮政编码：200120

联系人：吴晨莺

联系电话：021-38650821

附件二：《授权委托书》

兹全权委托 先生 / 女士或 机构代表本人（或本机构）参加以通讯开会方式召开的上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。若在法定时间内

就同一议案重新召开上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人(签字/盖章): _____

委托人证件号码(填写): _____

委托人基金账号/证券账号(填写): _____

受托人(签字/盖章): _____

受托人证件号码(填写): _____

签署日期: 年 月 日

附注:

1、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、销售机构以及其他符合法律规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

2、本授权委托书(样本)中“委托人证件号码”,指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新,“受托人证件号码”指受托人的身份证件号码或营业执照注册号。

3、同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户/证券账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的,应当填写基金账户/证券账户卡号,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。

4、如本次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。

附件三: 上证可质押城投债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

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):

基金账号/证券账号:

审议事项

同意

反对

弃权

关于修改上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案

基金份额持有人(或受托人)签名或盖章:

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本基金账户下全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选或字迹无法辨认、模糊不清或互相矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利,基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户/证券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/证券账户卡号,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。表决票应附个人或机构有效身份证明文件复印件。

表决票效力认定的其他规则详见本次持有人大会公告。