

## 泰达宏利基金管理有限公司

# 关于以现场方式召开泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金 基金份额持有人大会的第二次提示性公告

泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已于 2019 年 8 月 26 日在《证券时报》和本基金管理人网站(<http://www.mfcteda.com>)发布了《泰达宏利基金管理有限公司关于以现场方式召开泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2019 年 8 月 27 日发布了《泰达宏利基金管理有限公司关于以现场方式召开泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。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、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《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“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，决定以现场方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。会议的具体安排如下：

- 1、会议召开方式：现场方式
- 2、会议召开时间：2019 年 9 月 27 日上午 10 时
- 3、会议召开地点：北京市东城区朝阳门北大街六号首创大厦 7 层

### 二、会议审议事项

《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“议案”），议案内容见附件一。

### 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2019 年 8 月 30 日，即在 2019 年 8 月 30 日下午交易时间结束后，在本基金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并投票表决。

### 四、会议的议事程序和表决方式

- 1、大会主持人宣布会议开始；
- 2、大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人人数及所持有有表决权基金份额的总数、占权益登记日基金总份额的比例；
- 3、大会主持人宣布会议议事程序及注意事项；
- 4、大会主持人确定和公布监票人、公证机关和公证员姓名、见证律师；
- 5、大会主持人宣读议案；
- 6、享有表决权的与会人员对议案进行审议，并以记名投票方式进行表决；
- 7、监票人在基金份额持有人或代理人表决后立即进行清点，公证机关对计票过程予以公证；
- 8、大会主持人当场公布计票结果；
- 9、公证机关宣读公证词；
- 10、见证律师发表意见。

### 五、会议出席对象

- 1、权益登记日在登记机构登记在册的泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金的基金份额持有人或其代理人。
- 2、基金管理人代表。
- 3、基金托管人代表。
- 4、基金管理人聘请的见证律师。
- 5、基金管理人聘请的公证机关人员。

### 六、基金份额持有人出席会议需要准备的文件

- 1、个人基金份额持有人出席会议的，需提供本人开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的身份证件原件及正反面复印件；个人

基金份额持有人授权委托他人出席会议并代理行使表决权的，应按本公告“七、授权”的规定提供相关资料。

2、机构基金份额持有人出席会议的，需提供该机构开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的加盖公章（或其他经会议召集人认可的业务预留印章等印鉴，下同）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），以及代表单位出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件及加盖公章的单位授权委托书；合格境外机构投资者出席会议的，需提供授权代表的有效身份证件原件及正反面复印件，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出席会议的其他证明文件，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。机构基金份额持有人委托他人出席本次大会并行使表决权的，应按本公告“七、授权”的规定提供相关资料。

## 七、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次基金份额持有人大会，使基金份额持有人在本次基金份额持有人大会上充分表达其意志，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在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

### （一）委托人

本基金的基金份额持有人自本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，授权委托书自动生效。

基金份额持有人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数计算，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持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以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、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。

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或基金托管人为受托人。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纸面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面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（<http://www.mfcteda.com/>）下载等方式获取授权委托书样本。

### 1、纸面方式授权

#### （1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

① 个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供基金份额持有人开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的个人身份证明文件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件正反面复印件；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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表单位出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件及机构授权委托书（出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书；出席的受托人为非法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书和机构授权委托书）。

如果个人基金份额持有人使用其收到的基金管理人邮寄的专用授权委托征集信函授权时，无需提供身份证明文件复印件，在专用回邮信函上填写个人姓名、身份证明文件号码和具体表决意见，并回寄给基金管理人，该授权委托书即视为有效授权。

② 机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并在授权委托书上加

盖该机构公章，并提供该机构持有人开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用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）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件正反面复印件；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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）和代表单位出席会议的个人的身份证件原件及正反面复印件及机构授权委托书（出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书；出席的受托人为法定代表人的，提供加盖公章的法定代表人身份证明书和机构授权委托书）。

## （2）对基金管理人、基金托管人或销售机构的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人、基金托管人或销售机构进行授权的，可通过邮寄授权文件或在基金管理人、基金托管人或销售机构柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也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、基金托管人或销售机构营业机构。

基金份额持有人也可在授权截止时间前至基金管理人、基金托管人或销售机构的柜台办理授权，填写授权委托书，并提交基金份额持有人身份证明文件正反面复印件。投资者通过直销柜台及指定销售机构网点柜台办理基金交易业务时，直销柜台及指定销售机构网点柜台将为投资者提供纸面方式授权的服务。为保护投资者利益，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，均不影响交易的进行。

## 2、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额多次以有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均有具体表决意见的，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) 如果同一基金份额在有效纸面方式授权时，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表示行使表决权；

(4) 如基金份额持有人授权他人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，以其本人亲自投票的表决意见为准。

(四) 对基金管理人、基金托管人或销售机构的授权开始时间及截止时间  
基金管理人、基金托管人或销售机构接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为 2019 年 8 月 26 日至 2019 年 9 月 26 日 17 时。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人、基金托管人或销售机构的指定地址的，授权时间以收到时间为准。

## 八、会议的预登记

1、预登记时间：2019 年 9 月 2 日至 2019 年 9 月 26 日，每个工作日上午 9:00——下午 4:00。基金管理人将为基金份额持有人办理现场方式预登记或传真方式预登记。

2、现场方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人采用现场方式进行预登记的，应当按照本公告第六条、第七条的规定提供相关资料。

现场方式预登记地址：北京市西城区西直门外大街 1 号西环广场 T1 座 18 层 D1-D2 单元；联系人：客户服务部。

3、传真方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人可凭本公告第六条、第七条规定需提供的相关资料的传真件向基金管理人进行预登记，传真号为 8610-66577640，确认电话为 4006-988-888 /010-66555662，传真收件人为：客户服务部。

4、关于预登记的说明：基金管理人可以通过预登记估计持有人到会情况，以便为持有人大会召开进行相应准备，请各基金份额持有人予以积极配合。持有人大会会议入场前仍需按照本公告第六条、第七条的规定提供相关资料办理现场会议登记，未能按时依据本公告第六条、第七条的规定及重要提示出示及提供相关资料的，不能入场出席会议并表决。

## 九、会议召开的条件

1、亲自出席会议者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、基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额占权益登记日各自基金总份额的 50% 以上（含 50%）。

## 十、计票

1、主持人在会议开始后，宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表共同担任监票人。

2、监票人应在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3、如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4、计票过程应由公证机关予以公证。

## 十一、决议生效条件

1、泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。表决意见未填、错填、字迹无法辨认、模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

3、《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》应当经参加大会的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

4、本基金份额持有人大会决议，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议自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。

## 十二、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本次持有人大会需要全部有效凭证所代表的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额占权益登记日各自基金总份额的 50% 以上（含 50%）；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《基金法》，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。

## 十三、本次大会相关机构

1、召集人：泰达宏利基金管理有限公司

地址：北京市西城区西直门外大街 1 号西环广场 T1 座 18 层 D1-D2 单元

联系人：客户服务中心

联系电话：4006-988-888

邮政编码：100044

网址：[www.mfcteda.com](http://www.mfcteda.com)

2、基金托管人：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

联系人：朱彦奇

电话：010-66594904

3、公证机关：北京市长安公证处

地址：北京市东城区朝阳门北大街六号首创大厦 7 层

联系人：林永梅



联系电话：010-65543888-8014

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

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

#### 十四、重要提示

1、本次会议将于 2019 年 9 月 27 日上午 10 时召开，届时基金管理人、基金托管人、基金管理人聘请的公证机关人员以及见证律师将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件**提前半小时**至会议地点，以便验证入场。主持人宣布会议开始后，不再对未登记的基金份额持有人进行登记，未登记的持有人不得入场参加会议。

基金份额持有人应当保持会议秩序，服从召集人的引导，除出席会议的基金份额持有人（或代理人）、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外，召集人有权依法拒绝其他人士入场，对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

2、特别提醒各位基金份额持有人在预登记及会议现场登记时，需要提供的是开立持有本基金基金份额的开放式基金账户或深圳证券账户所使用的身份证件及正反面复印件，如若开立有多个账户且使用的是不同的身份证件，需要分别提供各账户对应的身份证件及（或）其正反面复印件。

3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 400-698-8888 咨询。

4、本基金泰达 500A 份额与泰达 500B 份额将于基金份额持有人大会召开之日（2019 年 9 月 27 日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日 10:30 止停牌，如基金份额持有人大会决议生效公告日为非交易日，则下一交易日开市恢复交易。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

5、本通知的有关内容由泰达宏利基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》及其说明书

附件二：《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

泰达宏利基金管理有限公司

2019 年 8 月 28 日

## 附件一：关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人：

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利益，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《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人——泰达宏利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，提议将泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）。基于此次基金转型事宜，对基金合同、托管协议中有关本基金的基金名称、基金的投资目标、投资范围、投资策略、风险收益特征、投资限制、收益分配原则、申购赎回以及其他部分条款进行修改。同时鉴于基金合同、托管协议生效于新《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规实施前，基金合同、托管协议的部分条款已经不能适应法律法规的最新要求，故本次基金合同、托管协议在变更上述事项的同时，对其他部分条款按照现时有效的相关法律法规及中国证监会的有关规定一并进行修改。具体说明见附件《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型方案说明书》。

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、托管协议进行修改并对本基金实施转型。本基金的招募说明书也将进行相应的修改。

以上议案，请予审议。

附件：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型方案说明书

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

# 泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型方案说明书

## 一、声明

1、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利益，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》（以下简称“《运作办法》”）和《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人泰达宏利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，决定召开基金份额持有人大会，讨论并审议《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》。

2、本次基金份额持有人大会需由持有有效的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额不少于本基金在权益登记日各自基金份额总份额的二分之一（含二分之一）以上的持有人出席方可召开，且《关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》需经参加本次持有人大会表决的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额持有人及代理人所持各自表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、持有人大会的决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

## 二、《基金合同》修改方案

### （一）更名

基金名称由“泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金”更名为“泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）”。

## **(二) 调整运作方式、取消分级机制**

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金变更后, 将不再设置基金份额的分级、配对转换和折算机制, 删去相关内容。运作方式变更为上市契约型开放式 (LOF)。

原泰达 500A 份额与泰达 500B 份额只上市交易、不接受申购与赎回; 转换后的泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额可通过销售机构进行日常申购与赎回。

## **(三) 泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的终止上市**

在本次基金份额持有人大会决议生效后, 基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请办理泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的终止上市等相关业务。

## **(四) 变更后基金的基本情况**

- 1、基金名称: 泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)
- 2、基金类型: 股票型
- 3、基金运作方式: 上市、契约型、开放式
- 4、基金份额的上市交易

基金合同生效后, 在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下, 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。

- 5、基金存续期限: 不定期

## **(五) 变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制**

### **1、投资目标**

本基金为股票型指数增强基金, 在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上, 结合增强型的主动投资, 力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%, 年跟踪误差不超过 7.75%, 力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

### **2、投资范围**

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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、

中期票据、次级债券、可交换债券、可转换债券等)、债券回购、资产支持证券、股指期货、货币市场工具、同业存单及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资组合中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。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,基金保留的现金或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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的相关规定。

### **3、投资策略**

本基金采用指数增强型投资策略,在控制与比较基准偏离风险的前提下,综合利用多种量化投资模型和指数增强技术,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

#### **(1) 资产配置策略**

本基金以中证 500 指数作为基金投资组合的标的指数,同时,基于流动性管理及策略性投资的需要,本基金也会在控制风险前提下适度投资于债券、股指期货、货币市场工具及其他金融工具。

#### **(2) 股票投资策略**

为严格控制跟踪误差风险,本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主,辅以适度的增强策略。

##### **1) 指数复制策略**

###### **① 定期调整**

本基金将根据中证 500 指数成份股及其权重的定期调整,及时对股票投资组合进行相应调整,以控制投资组合与标的指数构成的偏离,从而实现跟踪误差风险的控制。

###### **② 不定期调整**

当成份股实施增发、配送或使股本发生变动等行为时，基金将根据指数公司的指数修正公告对投资组合进行相应调整；

当成份股发生重大变化时（收购合并、分拆、退市等），基金将根据指数公司的临时调整公告对投资组合进行相应调整；

根据本基金的申购赎回情况，对基金的股票投资组合进行调整，以实现对标的指数的有效跟踪；

因成份股流动性不足、停牌等市场因素影响或法律法规及基金合同限制，基金无法购得相应足够数量的股票时，基金将搭配使用其他合理方法对相应股票进行合理替代并对投资组合进行相应调整；

在其他影响本基金复制并跟踪标的指数的情况下，本基金管理人可根据市场情况，在以跟踪误差最小化的前提下，对基金的投资组合进行合理调整。

### ③特殊情形下的调整

在建仓阶段和基金后续运作过程中，如遇到特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将根据市场情况以跟踪误差最小化为原则，行业、规模、历史表现相似度为标准，采用合理的方法进行适当调整和替代。

## 2) 增强策略

在对中证 500 指数进行有效跟踪的被动投资基础上，综合利用量化投资模型和指数增强技术，灵活地对投资组合进行调整，力争实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。

### ①多因子选股模型

本基金运用多因子选股模型，对基本面长期表现较好的股票进行筛选，并结合市场预判，选出优质个股进行投资。

多因子模型的因子包括：估值，成长，盈利质量，动量，流动性，市场情绪，波动率，市场敏感度等。公司的量化投研团队将对上述因子的有效性、市场逻辑、风格切换等进行持续的跟踪研究，并适时调整模型、因子类别和权重，力争保持模型的长期有效。

### ②风险管理

在风险管理方面，本基金将构建基本面风险模型和统计风险模型，对组合的风险敞口进行评估和管理，力争保持基金长期业绩的高信息比率。

### ③其它辅助增强策略

分析指数调整期间的调入调出个股的市场价格特征，在控制跟踪误差风险的前提下，有针对性地选择基金组合调整时机，以获取超额收益；

选择替代股票时，考查替代股票的投资价值。在满足作为替代股票的标准的前提下，选择具备较高投资价值的个股。

### （3）债券投资策略

本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。结合宏观经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品种互换、回购套利等策略，权衡到期收益率与市场流动性，精选个券并构建和调整债券组合。

### （4）股指期货投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，将利用股指期货剥离多头股票资产部分的系统性风险或建立适当的股指期货多头头寸对冲市场向上风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。

### （5）资产支持证券投资策略

在严格控制投资风险的前提下，本基金将在债券市场宏观分析基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。

### （6）现金管理

在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作的流动性需求。



#### 4、投资限制

##### (1) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- 1) 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；
- 2) 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%；债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- 3) 本基金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- 4) 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%；
- 5) 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%；
- 6) 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%；
- 7) 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%；
- 8) 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；
- 9) 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；
- 10) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；
- 11) 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%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；
- 12) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合

持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，但本基金跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

13) 本基金参与股指期货交易，依据下列标准建构组合：

①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%；

②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）不低于基金资产的 80%；

③本基金在任何交易日日终，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 95%。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；

④本基金在任何交易日日终，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%；

⑤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%；

14) 本基金基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

15) 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本条所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

16) 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；

17) 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。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第 3) 项、第 8) 项、第 15) 项、第 16) 项外，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。

如果法律法规对上述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。

## （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) 向基金管理人、基金托管人出资；
- 5) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 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、行政法规或者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其他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调整上述规定的，本基金的投资不受上述限制或按照调整后的规定执行。

## 5、风险收益特征

本基金为股票型指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## （六）变更后的基金资产估值

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）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报价（收盘价）估值；估值日无报价的且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的报价（收盘价）估值；如有充分证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

（2）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（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。对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（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唯一估值净价或推荐估值净价。

（3）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日报价（收盘价）减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息（税后）后得到的净价进行估值；估值日无报价的且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的报价（收盘价）估值；如有充分证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

（4）对不存在活跃市场的投资品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。

### 2、处于未上市期间的有价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，以最近一日的报价（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。

### 3、全国银行间市场交易品种的估值

(1) 银行间市场交易不含权的固定收益品种，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。对银行间市场上含权的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(3) 同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

4、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。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

#### 6、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值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商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会

计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### **（七）变更后基金的费率水平**

1、基金管理人的管理费保持不变，仍按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。

2、基金托管人的托管费保持不变，仍按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。标的指数许可使用费的收取下限为每自然季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。

### **（八）变更后基金的收益分配原则**

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

### **（九）变更后基金的申购、赎回**

本基金《基金合同》生效后，投资者可通过场内或场外两种方式对基金份额进行日常的申购与赎回。

#### **1、申购与赎回的场所**

基金投资者可以使用基金账户，通过基金管理人和其他场外销售机构，办理基金份额的场外申购和赎回业务。基金投资者也可使用深圳证券账户通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购和赎回业务，场内销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

#### **2、申购与赎回办理的开放日及时间**

##### **（1）开放日及开放时间**

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### **（2）申购与赎回的开始时间**

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

### 3、申购与赎回的原则

(1) “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

(2) “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

(3) 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

(4) 投资人在场外销售机构赎回基金份额时，赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人场外认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

(5) 场内申购、赎回需遵守深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按照新规定执行；

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 4、申购与赎回的程序

(1) 申购与赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

(2) 申购与赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，



赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### (3) 申购与赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

## 5、申购与赎回的数额限制

(1) 通过基金管理人直销中心申购，单个基金账户单笔首次申购最低金额为10万元(含申购费)，如有认购记录的，则首次申购最低金额不受10万元限制；追加申购最低金额为1,000元(含申购费)；通过基金管理人网上直销系统进行申购，单个基金账户单笔最低申购金额为1元(含申购费)，单笔交易上限及单日累计交易上限请参照网上直销相关说明。通过其他销售机构申购，单个基金账户单笔申购最低金额为1元人民币(含申购费)，销售机构有权在不低于上述规定的前提下，根据自身情况设置。

(2) 投资者可多次申购，本基金对单个投资人累计持有的基金份额不设上限。但单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%(在基金运作过程中因基金份额赎回、基金份额上市交易、基金管理人委托的登记机构技术条件不允许等情形导致被动达到或超过50%的除外)。

(3) 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。具体规定请参见相关公告。

(4) 基金份额持有人赎回时或赎回后，在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 1 份的，基金管理人有权一次将基金份额持有人在該交易账户保留的剩余基金份额全部赎回。

(5) 基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(6) 对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，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则有规定的，从其最新规定办理。

## 6、申购和赎回的费用及其用途

### (1) 申购费用

本基金基金份额在申购时收取基金申购费用。投资者如果有多笔基金份额的申购，适用费率按单笔分别计算。本基金对通过直销中心申购基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

申购费率具体如下表所示：

|                                 |  |          |
|---------------------------------|--|----------|
| 场外申购费率(通过基金管理人的直销中心申购本基金的养老金客户) | 申购金额(M, 含申购费)                              | 费率       |
|                                 | M < 50 万                                   | 0.30%    |
|                                 | 50 万 ≤ M < 250 万                           | 0.25%    |
|                                 | 250 万 ≤ M < 500 万                          | 0.15%    |
|                                 | 500 万 ≤ M < 1000 万                         | 0.10%    |
|                                 | M ≥ 1000 万                                 | 1000 元/笔 |
| 场外申购费率(本基金其他投资者)                | 申购金额(M, 含申购费)                              | 费率       |
|                                 | M < 50 万                                   | 1.20%    |
|                                 | 50 万 ≤ M < 250 万                           | 1.00%    |
|                                 | 250 万 ≤ M < 500 万                          | 0.60%    |
|                                 | 500 万 ≤ M < 1000 万                         | 0.40%    |
|                                 | M ≥ 1000 万                                 | 1000 元/笔 |
| 场内申购费率                          | 深圳证券交易所会员单位应按照场外申购费率(本基金其他投资者)设定投资者的场内申购费率 |          |

本基金基金份额的申购费用应在投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

## (2) 赎回费用

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 天的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并上述赎回费全额计入基金资产，对持续持有期不少于 7 天的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

赎回费率具体如下表所示：

|        | 连续持有期限（日历日）  | 费率    |
|--------|--|-------|
| 场外赎回费率 | 1 天~6 天  | 1.5%  |
|        | 7 天（含）~365 天   | 0.5%  |
|        | 366 天（含）~730 天   | 0.25% |
|        | 731 天（含）以上   | 0     |
| 场内赎回费率 | 本基金的场内赎回费率为固定赎回费率 0.5%（对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费），并将上述赎回费全额计入基金资产 |       |

(3) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(4) 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下，对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调整基金申购费率、调低基金赎回费率。

(5) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则、操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

(6) 办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳

证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 8、申购与赎回的登记

(1) 基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

(2) 投资者 T 日申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

(3) 投资者 T 日赎回基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

(4) 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前在指定媒介上公告。

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其配套准则等法律法规陆续颁布和实施，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的产品特征修订基金合同的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此修订基金合同。

### （十）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金将安排不少于 20 个交易日的选择期（具体期限以基金管理人届时发布的公告为准），以供基金份额持有人做出赎回、卖出等选择。

对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额将在份额转换基准日进行转换，最终转换为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额。

在选择期期间选择赎回的，适用泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

在选择期期间，泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金仍按照基金合同约定的运作方式进行运作。由于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

### （十一）基金份额的转换

转型选择期届满的次一工作日为份额转换基准日，同日泰达 500A 份额、泰达 500B 份额终止上市。基金管理人在份额转换基准日将泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金的各类基金份额转换成泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额。

在份额转换基准日，在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额将转换为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的场内份额，在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的泰达中证 500 份额将转换为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的场外份额。本次基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：1、将泰达 500A 份额与泰达 500B 份额转换成泰达中证 500 份额的场内份额；2、将泰达中证 500 份额的场内份额和场外份额分别转换成泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的场内份额和场外份额。

转换后，泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的基金份额数 = 泰达中证 500 份额数

泰达 500A 份额转换成泰达中证 500 份额的份额数 =

$$\frac{NUM_{500A}^{\text{前}} \times NAV_{500A}^{\text{前}}}{NAV_{500}^{\text{前}}}$$

泰达 500B 份额转换成泰达中证 500 份额的份额数 =

$$\frac{NUM_{500B}^{\text{前}} \times NAV_{500B}^{\text{前}}}{NAV_{500}^{\text{前}}}$$

其中：

$NUM_{500A}^{\text{前}}$ : 泰达 500A 份额转换前份额数;

$NUM_{500B}^{\text{前}}$ : 泰达 500B 份额转换前份额数;

$NAV_{500A}^{\text{前}}$ : 泰达 500A 份额转换前单位资产净值;

$NAV_{500B}^{\text{前}}$ : 泰达 500B 份额转换前单位资产净值;

$NAV_{500}^{\text{前}}$ : 泰达中证 500 份额转换前单位资产净值。

泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额的场内份额经转换后的份额数采用取整计算（最小单位为 1 份），取整后的余额计入基金资产。故基金份额转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额与泰达 500B 份额场内份额的持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

## **（十二）《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的生效及后续安排**

本基金份额持有人大会决议生效后，关于《泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效及《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》同时失效的时间安排，请详见基金管理人届时发布的相关公告。

泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同生效后，基金管理人将根据相关规定办理泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的申购赎回等业务。基金合同生效后，在本基金符合法律法规规定的上市条件的情况下，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。详见后续公告。

(十三) 综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型方案说明书》以上变更方案要点修订基金合同并实施变更方案。

### 三、基金管理人就方案相关事项的说明

#### (一) 泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金的历史沿革

泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）由泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型而来。

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可[2011]1338 号文核准募集，基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金自 2011 年 10 月 24 日至 2011 年 11 月 25 日公开募集，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，《泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 1 日生效。

#### (二) 基金变更的可行性

##### 1、法律层面不存在障碍

根据《基金合同》约定，“(六) 开会方式……。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。”，“(八) 表决……2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### (1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

##### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。”

本次持有人大会需以现场方式召开，审议的事项须经特别决议通过。

在同时符合以下条件时，现场开会的方式视为有效：

(1) 亲自出席会议者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、本基金合同和会议通知的规定；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额各自基金份额不少于本基金在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）。

对于特别决议需经参加大会的泰达中证 500 份额、泰达 500A 份额、泰达 500B 份额的基金份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会按照《基金法》第八十六条的规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。

因此，泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金变更的方案符合基金合同和有关法律法规的规定。

## **2、基金变更不存在技术障碍**

泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金变更后，将进行基金份额变更登记。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。基金变更不存在技术障碍。

## **四、基金转型的主要风险及预备措施**

本基金转型为泰达宏利中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的方案存在被基金份额持有人大会否决的风险。

基金管理人已对主要持有人进行了走访，认真听取了持有人意见，拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后，我们还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对修改方案进行适当的修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本方案未获得持有人大会批准，基金管理人计划按照有关规定重新向持有人大会提交议案。



基金变更后运作过程中的相关运作风险,基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通,避免基金变更后基金运作过程中出现相关操作风险和管理风险。

基金变更后风险等级变化的风险,由于基金变更后投资范围、运作方式等发生较大变化,影响基金的风险收益特征,同时不同的销售机构采用的风险评价方法也不同,因此存在基金变更前后风险等级不一致的可能。提示投资者关注。

## **五、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: 泰达宏利基金管理有限公司

联系电话: 400-698-8888

网址: [www.mfcteda.com](http://www.mfcteda.com)

## 附件二：泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称：\_\_\_\_\_

证件号码（身份证件/营业执照）：\_\_\_\_\_

开放式基金账户号/深圳证券账户：\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

如为受托出席会议并表决的，请填写：

受托人的姓名/名称：\_\_\_\_\_

受托人证件号码（身份证件/营业执照）：\_\_\_\_\_

| 审议事项                             | 表决结果                        |                             |                             |
|----------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 关于泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案 | <input type="checkbox"/> 同意 | <input type="checkbox"/> 反对 | <input type="checkbox"/> 弃权 |

基金份额持有人/受托人签名或盖章

2019年9月27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“√”，同一议案只能表示一项意见。
- 2、以上表决意见是持有人或其受托人就持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。
- 3、表决票未填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持份额数的表决结果均计为“弃权”。
- 4、本表决票可从相关网站下载、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/公司单位代表本人或本机构出席于 2019 年 9 月 27 日召开的泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使本人/本机构于权益登记日所持有的泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）全部基金份额对所有议案的表决权。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本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。

委托人姓名或名称：

委托人证件号码（身份证件/营业执照）：

开放式基金账户号/深圳证券账户：

受托人姓名或名称：

受托人证件号码（身份证件/营业执照）：

委托人签字/盖章：

签署日期：2019年 月 日

说明：

- 1、页末签字栏中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。
- 2、其他签字栏请视情形选择填写，凡适合的栏目均请准确完整填写。
- 3、持有人多次授权，且能够区分先后次序的，以最后一次授权为准；持有人多次授权，无法区分授权次序的，视为同意其授权的机构之一为受托人。
- 4、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。
- 5、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、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。