

# 南方基金管理股份有限公司

## 关于以通讯方式召开南方创业板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第一次提示性公告

南方基金管理股份有限公司已于 2023 年 3 月 31 日发布了《南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方创业板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》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第一次提示性公告。

### 一、召开会议基本情况

南方基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）依据中国证监会 2016 年 3 月 18 日证监许可[2016]559 号文注册募集的南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 5 月 20 日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方创业板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，基金管理人经与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，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 3 月 31 日起至 2023 年 5 月 30 日 17:00 止（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的送达地点：

地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 37 楼

邮政编码：518017

联系电话：0755-82763814

收件人：南方基金管理股份有限公司产品开发部

请在信封表面注明：“南方创业板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 即南方创业板交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标 ETF”）自 2023 年 3 月 31 日起至 2023 年 5 月 30 日 17:00 止以通讯方式召开基金份额持有人大会，鉴于本基金和目标 ETF 的相关性，在 2023 年 3 月 31 日本基金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。关于目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项及具体投票规则，敬请参见目标 ETF 基金份额持有人大会的相关公告。

## 二、会议审议事项

《关于南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

对上述议案的说明及《基金合同》的详细修订内容请详见附件四《南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修改说明》。

## 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2023年3月31日，权益登记日当天下午交易时间结束后，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并投票表决（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

## 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、复印表决票或登陆基金管理人网站(<http://www.nffund.com>)下载并打印或按以上格式自制表决票。

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经授权的业务公章（以下合称“公章”），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正反面复印件或者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，应由代理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（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；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，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；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，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；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等，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在自 2023 年 3 月 31 日起至 2023 年 5 月 30 日 17:00 止的期间内（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至基金管理人的办公地址，请在信封表面注明：“南方创业板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”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

#### 4、网络授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供官方微信（微信号：南方基金）、官方 APP（APP 名称：南方基金）和官方网站(<http://www.nffund.com>)通道供个人投资者进行授权，由基金管理人根据授权人的表决意见代为行使表决权。

网络授权的起止时间自 2023 年 4 月 4 日起至 2023 年 5 月 26 日 15:00 止（授权时间以系统记录时间为准）。通过网络进行授权的基金份额持有人，应正确填写姓名、证件号码等信息，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人权益。

基金份额持有人通过上述网络授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

#### 5、短信授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人可提供短信通道供基金份额持有人进行授权。基金管理人和本基金的部分销售机构可通过短信平台向预留手机号码的个人投资者发送征集授权短信，持有人回复短信表明授权意见。

短信授权的起止时间自 2023 年 4 月 4 日起至 2023 年 5 月 26 日 15:00 止（授权时间以系统记录的短信接收时间为准），敬请投资者注意。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行授权。如因投票短信通道受阻或通讯故障等不可抗力或非基金管理人人为因素，导致投票短信无法接收到或逾期接收到，短信投票失效，基金管理人不承担责任，基金份额持有人可以选择基

金管理人认可的其他投票方式进行授权。

#### 6、电话授权（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人参与本次大会，基金管理人可开设录音电话授权方式，基金管理人和部分销售机构可通过各自的客服代表与基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由客服代表根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

电话授权的起止时间自 2023 年 4 月 4 日起至 2023 年 5 月 26 日 15:00 止（授权时间以系统记录的电话接通时间为准），敬请投资者注意。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

#### 7、授权的确定原则

##### （1）直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托，又存在直接投票表决，则以直接表决为有效表决，授权委托无效。

##### （2）最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次进行有效授权，无论表决意见是否相同，均以最后一次授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次，不能确定最后一次授权的，按以下原则处理：若多次授权的表决意见一致的，按照该表决意见计票；若多次授权但授权意见不一致或均没有具体表决意见的，视为委托人授权受托人投弃权票。

### 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：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）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期（即 2023 年 5 月 30 日）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。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、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，所提供文件符合本公告规定，且在规定截止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填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或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,或未能在规定截止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,以最后送达日所填写的有效的表决票为准,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送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

## 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二分之一(含二分之一);

2、《关于南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过;

3、直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决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,并与登记机构记录相符;

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表决通过之日起生效。法律法规另有规定的,从其规定。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,基金管理人可在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会,但权益登记日仍为2023年3月31日。根据《基金法》及《基金合同》规定,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)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。

重新召集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表决意见以及各类授权依然有效,但如果表决意见或授权方式发生变化,或者基金份额持有人重新做出授权,则以最新表决意见、授权方式或最新授权为

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：南方基金管理股份有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

法定代表人：周易

成立时间：1998 年 3 月 6 日

电话：(0755) 82763888

传真：(0755) 82763889

2、基金托管人：中国银行股份有限公司

3、公证机构：深圳市深圳公证处

公证员：丁青松、卢润川

联系方式：(0755) 83024185、(0755) 83024187

4、见证律师事务所：上海通力律师事务所

#### 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，提前寄出表决票。

2、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 ([www.nffund.com](http://www.nffund.com)) 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 400-889-8899 咨询。

3、本公告的有关内容由南方基金管理股份有限公司解释。

南方基金管理股份有限公司

2023 年 4 月 1 日

附件一：

## **关于南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金 修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案**

南方创业板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：

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《南方创业板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，本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议对南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）修改投资范围，在《基金合同》的投资范围中增加转融通证券出借业务，删除中小板、权证，并相应调整投资策略、投资限制、估值方法、费用收支、信息披露等相关内容。对《基金合同》修改的内容详见附件四：《南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修改说明》。

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。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

本议案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人或代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过。本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，基金管理人将根据本议案及《南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同修改说明》对《基金合同》进行修改，并在调整实施前披露修改后的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件，同时基金管理人在调整前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订相关调整实施安排规则并提前公告。

以上议案，请予审议。

附件二：

| 南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金<br>基金份额持有人大会表决票   |  |    |    |
|---|--|----|----|
| 基金份额持有人名称   |  |    |    |
| 证件类型  | <input type="checkbox"/> 身份证/ <input type="checkbox"/> 营业执照/ <input type="checkbox"/> 其他（请填写证件类型）： |    |    |
| 证件号码  |  |    |    |
| 联系人   |  |    |    |
| 联系电话  |  |    |    |
| 审议事项  | 同意   | 反对 | 弃权 |
| 关于南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案   |  |    |    |
| 关于南方创业板交易型开放式指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案   |  |    |    |
| 基金份额持有人/代理人签名或盖章  |  |    |    |
| 年 月 日   |  |    |    |
| <p>说明：1、因公证工作的需要，请您准确填写联系电话；</p> <p>2、请以打“√”方式选择表决意见；</p> <p>3、表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见；</p> <p>4、必须选择一种且只能选择一种表决意见；</p> <p>5、如表决票上的表决意见未选、多选、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合会议公告规定的，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基金份额持有人大会表决的基金份额总数；</p> <p>6、本表决票可从南方基金管理股份有限公司官方网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印；</p> <p>7、若本基金和/或目标ETF在本次基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会，上述表决继续有效。</p> |  |    |    |



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为准。

附件三：

| <b>南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金<br/>基金份额持有人大会代理投票授权委托书</b> |  |
|---|--|
| 授权人名称   |  |
| 授权人证件类型   | <input type="checkbox"/> 身份证/ <input type="checkbox"/> 营业执照/ <input type="checkbox"/> 其他（请填写证件类型）：   |
| 授权人证件号码   |  |
| 授权人联系电话   |  |
| 授权事项  | <p style="text-align: center;">兹委托_____先生 / 女士 / 机构（证件号<br/>码：_____）代表本人（或本机构）<br/>参加以 2023 年 5 月 30 日为投票截止日且以通讯会议方式<br/>召开的南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基<br/>金基金份额持有人大会，并全权代为行使本人/本机构于权<br/>益登记日所持有的南方创业板交易型开放式指数证券投资<br/>基金联接基金（以下简称“本基金”）全部基金份额对本基<br/>金和目标 ETF 基金份额持有人大会所有议案的表决权。</p> <p style="text-align: center;">本授权委托书的有效期为委托人签字或盖章之日起至<br/>本基金和目标 ETF 基金份额持有人大会结束之日止。若相<br/>关基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，<br/>以最多两次重新召开基金份额持有人大会为限，除本人（或<br/>本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。本授权不得<br/>转授权。</p> |
| 授权人签名或盖章  | 年 月 日  |
| 说明：   | <p>1、因公证工作的需要，请您准确填写联系电话；</p> <p>2、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<br/>额，则其授权无效；</p> <p>3、此授权委托书通过剪报、复印或按以上格式自制并在填写完整且签字盖章<br/>后均为有效；基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及基金合同要求的<br/>授权委托书；</p> <p>4、若本基金和/或目标 ETF 在本次基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、</p>  |

6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会，上述授权继续有效。但如果授权方式发生变化或者本基金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。

附件四：

## 南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金 基金合同修改说明

南方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）旗下的南方创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）于2016年5月20日成立。经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，本基金拟修改投资范围，在基金合同的投资范围中增加转融通证券出借业务，删除中小板、权证，并相应调整投资策略、投资限制、估值方法、费用收支、信息披露等相关内容。修改前后的合同条款列示如下：

| 章节      | 修订前   | 修订后   |
|---------|---|---|
| 第一部分 前言 | <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> | <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是<u>《中华人民共和国民法典》</u>、《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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“<u>《流动性风险管理规定》</u>”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> <p><u>八、本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与转融通证券出借业务，可能存在流动性风险、市场风</u></p> |

|                   |   |   |
|-------------------|---|---|
|                   |   | 险和信用风险等转融通业务特有风险。   |
| 第二部分 释义           |   | <u>62、转融通证券出借业务：指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务</u>   |
| 第七部分 基金合同当事人及权利义务 | <p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>法定代表人：杨小松（代为履行法定代表人职责）</p> <p>（二）基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；</p>         | <p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>法定代表人：周易</p> <p>（二）基金管理人的权利与义务</p> <p>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：</p> <p>（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券和转融通证券出借业务；</p>                 |
| 第十二部分 基金的投资       | <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。此外，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以及存托凭证（下同）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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</p> | <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票以及存托凭证（下同）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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</p> |

|  |  |   |
|--|--|---|
|  | <p>债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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)、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金可投资存托凭证。</p>  | <p>券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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)、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金可投资存托凭证。</p> <p><u>本基金根据相关规定可参与转融通证券出借业务。</u></p> |
|  | <p>三、投资策略</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标,本基金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、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>(五) 权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时,将通过权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向</p> | <p>三、投资策略</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标,本基金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、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p>        |

|  |   |  |
|--|---|--|
|  | <p>权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。</p> <p>基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。</p> | <p><u>（八）转融通证券出借业务投资策略</u></p> <p>本基金在参与转融通证券出借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，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通证券出借业务对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>本基金参与转融通证券出借业务的，应综合考虑市场情况，例如出借证券停牌的风险、出借指数成份股调出指数的风险；综合考虑基金持有人类型与结构，例如个人投资者占比、持有人份额集中度等因素，衡量出现大额集中赎回可能性；综合考虑基金历史申赎情况，例如大额赎回份额占总份额的比例、申赎情况与市场涨跌之间的关联等，防范大额赎回风险；综合考虑出借证券流动性情况，衡量变现</p> |
|--|---|--|

|  |   |  |
|--|---|--|
|  |   | <p>难度。在分析上述因素的基础上，<u>合理确定出借证券的范围、期限和比例。</u></p>  |
|  | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（3）若本基金参与股指期货交易的，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，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、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%；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；</p> <p><del>（4）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%；</del></p> <p><del>（5）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过</del></p> | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（3）若本基金参与股指期货交易的，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%；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；</p> |



|  |  |   |
|--|--|---|
|  | <p>该权证的 10%；—</p> <p>—(6) 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%；—</p> <p>除上述第 (2)、(7)、(8)、<br/>(13) 项另有约定外，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。</p> | <p><u>(15) 本基金参与转融通证券出借业务的,应当符合下列要求:</u></p> <p><u>1) 本基金在任何交易日日终,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;</u></p> <p><u>2) 本基金在任何交易日日终,参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 50%;</u></p> <p><u>3) 证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天,平均剩余期限按市值加权平均计算;</u></p> <p><u>4) 最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元;</u></p> <p>除上述第 (2)、(4)、(5)、(10)、<br/>(15) 项另有约定外，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。<br/><u>本基金参与转融通证券出借业务,因证券市场波动、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</u></p> |
|--|--|---|

|                 |   |   |
|-----------------|---|---|
|                 |   | <u>(15) 项规定的，基金管理人不得新增出借业务。</u>   |
| 第十四部分<br>基金资产估值 | <p>三、估值方法</p> <p>2、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），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或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。</p> <p>3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(2) 首次公开发行未上市或未挂牌转让的股票、债券和权证，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；</p> | <p>三、估值方法</p> <p>2、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（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或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。</p> <p>3、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(2) 首次公开发行未上市或未挂牌转让的股票、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；</p> <p><u>9、基金参与转融通证券出借业务的，应参照相关法律法规和中国证券投资基金业协会发布的相关规定进行估值，确保估值的公允性。</u></p> |
| 第十五部分           | 一、基金费用的种类   | 一、基金费用的种类   |

|                          |   |   |
|--------------------------|---|---|
| <p>基金费用与税收</p>           | <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第4-10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> | <p>10、因参与转融通证券出借业务而产生的各项合理费用；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4-11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p>                                   |
| <p>第十八部分<br/>基金的信息披露</p> | <p>五、公开披露的基金信息</p>  | <p>五、公开披露的基金信息</p> <p><u>本基金参与转融通证券出借业务的，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与转融通证券出借交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等，并就报告期内本基金参与转融通证券出借业务发生的重大关联交易事项做详细说明。</u></p> |

本基金基金合同摘要将根据以上调整进行相应修订。  
特此说明。