

**南方基金管理股份有限公司**  
**关于以通讯方式召开南方中证 500 交易型开放式指数证券**  
**投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会的**  
**第二次提示性公告**

南方基金管理股份有限公司已于 2020 年 3 月 12 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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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二次提示性公告。

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”）依据中国证监会证监许可[2009]755 号文核准募集的南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）于 2009 年 9 月 25 日成立。2013 年 2 月 6 日，基金管理人管理的中证 500 交易型开放式指数证券投资基金成立。根据《南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，已将南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）变更为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，即南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（以下简称“本基金”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金管理人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 2020 年 3 月 12 日起至 2020 年 4 月 27 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：0755-82763888

收件人：南方基金管理股份有限公司

请在信封表面注明：“南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

## 二、会议审议事项

《关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）开展转融通证券出借业务及调整赎回费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《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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 2020 年 3 月 12 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 2020 年 3 月 12 日起至 2020 年 4 月 27 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：“南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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 2020 年 3 月 13 日起至 2020 年 4 月 24 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 2020 年 3 月 13 日起至 2020 年 4 月 24 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 2020 年 3 月 13 日起至 2020 年 4 月 24 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（中国农业银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日（即 2020 年 4 月 27 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。基金管理人或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、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）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、《关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)开展转融通证券出借业务及调整赎回费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和其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)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

根据《基金法》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。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 2020 年 3 月 12 日。

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。

#### 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：张海波

成立时间：1998 年 3 月 6 日

电话：(0755) 82763888

传真：(0755) 82763889

2、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

3、公证机构：北京市中信公证处

公证员：甄真

联系方式：(010) 81139046

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

#### 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、本基金管理人已于 2020 年 3 月 12 日披露召开南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金份额持有人大会的公告，为保护基金份额持有人的利益，本基金将在计票日（2020 年 4 月 29 日）当日上午开市起至持有人大会表决结果公告日上午 10 点 30 分停牌。

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([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（均免长途话费）咨询。

南方基金管理股份有限公司

2020 年 3 月 14 日

附件一：

## 关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF） 开展转融通证券出借业务及调整赎回费并修订基金合同有关事项的议案

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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农业银行股份有限公司协商一致，提议对南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（以下简称“本基金”）开展转融通证券出借业务，在基金合同中增加转融通证券出借业务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；将本基金 A 类基金份额场内赎回费率和场外赎回费率均调整为持有 7 日以内费率为 1.5%，持有 7 日（含）至 30 日为 0.5%，持有 30 日（含）至 180 日为 0.25%，持有 180 日（含）以上为 0；将 C 类基金份额赎回费率调整为持有 7 日以内费率为 1.5%，持有 7 日（含）以上费率为 0（注：投资者份额持有时间记录规则以基金登记机构最新业务规则为准，具体持有时间以基金登记机构系统记录为准）；并在基金合同中新增基金合同自动终止条款如下：“《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 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人可以终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会”，同时根据最新的法律法规和监管要求更新基金合同中的部分表述。本基金需对《基金合同》修改的内容详见附件四：《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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三分之二以上（含三分之二）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《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同修改说明》对《基金合同》进行修改，并在调整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：

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF） 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"/> 其他（请填写证件类型）：		
证件号码			
联系人			
联系电话			
审议事项	关于南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）开展转融通证券出借业务及调整赎回费并修订基金合同有关事项的议案		
表决意见	同意	反对	弃权
基金份额持有人/代理人签名或盖章			
年 月 日			
说明： 1、因公证工作的需要，请您准确填写联系电话； 2、请以打“√”方式选择表决意见； 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； 4、必须选择一种且只能选择一种表决意见； 5、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，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； 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。			



附件三:

<b>南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF)</b> <b>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"/> 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 (证件号码: _____) 代表本人 (或本机构) 参加以 2020 年 4 月 27 日为投票截止日且以通讯会议方式召开的南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金份额持有人大会, 并全权代为行使本人/本机构于权益登记日所持有的南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 全部基金份额对所有议案的表决权。</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本基金基金份额持有人大会结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的, 以最多两次重新召开基金份额持有人大会为限, 本授权继续有效。本授权不得转授权。</p>
授权人签名或盖章	
年 月 日	
说明: 1、因公证工作的需要, 请您准确填写联系电话; 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额, 则其授权无效; 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授权委托书。	

附件四：

## 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

### 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”）旗下的南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（以下简称“本基金”）由南方中证 500 指数证券投资基金（LOF）变更而来。经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，本基金拟开展转融通证券出借业务，在基金合同中增加转融通证券出借业务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；将本基金 A 类基金份额场内赎回费率和场外赎回费率均调整为持有 7 日以内费率为 1.5%，持有 7 日（含）至 30 日为 0.5%，持有 30 日（含）至 180 日为 0.25%，持有 180 日（含）以上为 0；将 C 类基金份额赎回费率调整为持有 7 日以内费率为 1.5%，持有 7 日（含）以上费率为 0（注：投资者份额持有时间记录规则以基金登记机构最新业务规则为准，具体持有时间以基金登记机构系统记录为准）；并在基金合同中新增基金合同自动终止条款如下：“《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 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人可以终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会”，同时根据最新的法律法规和监管要求更新基金合同中的部分表述。需修改的合同条款列示如下：

章节	修订前	修订后
1、前言		（五）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、市场风险和信用风险等转融通业务特有风险。
2、释义		70、转融通证券出借业务：是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
5、基金备案	三、基金存续期内的基金份额持有	三、基金存续期内的基金份额持有

	<p>人数量和资金数额</p> <p>基金合同生效后的存续期内,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,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人,或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元,基金管理人应当及时向中国证监会报告,说明出现上述情况的原因并提出解决方案。</p> <p>法律法规另有规定的,从其规定。</p>	<p>人数量和资金数额</p> <p>《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 万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 50 个工作日出现前述情形的,基金管理人可以终止基金合同,无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。</p>
9、基金合同当事人及权利义务	<p>(13)根据国家有关规定,在法律法规允许的前提下,以基金的名义依法为基金融资、融券;</p>	<p>(13)根据国家有关规定,在法律法规允许的前提下,以基金的名义依法为基金进行融资融券和转融通证券出借业务;</p>
14、基金的投资	<p>本基金主要投资于中证 500ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券、及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中投资于中证 500ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内),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、应收申购款等,权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。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</p>	<p>本基金主要投资于中证 500ETF、标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券、及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中投资于中证 500ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%(已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内),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、应收申购款等。</p> <p>基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。</p> <p>如基金投资需要,本基金在履行适当程序后,可以投资衍生工具等其</p>

	<p>履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p>	<p>他投资品种, 无需召开持有人大会审议。基金管理人将根据相关法律法规规定, 对相关调整予以公告并及时更新基金法律文件。</p> <p>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。</p>
<p>14、基金的投资</p>		<p>(五) 转融通证券出借业务投资策略</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, 应综合考虑市场情况, 例如出借证券停牌的风险、出借指数成分股调出指数的风险; 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, 衡量变现难度。在分析上述因素的基础上, 合理确定出</p>

		<p>借证券的范围、期限和比例。</p> <p>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，并在更新的招募说明书中体现相关调整。</p>
14、基金的投资	<p>5、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；</p> <p>6、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第 1、2 项外，在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>4、本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：</p> <p>（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纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；</p> <p>（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 50%；</p> <p>（3）最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；</p> <p>（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；</p> <p>5、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；</p> <p>6、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；</p> <p>7、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第 1、2 项外，在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资</p>

		<p>组合不符合上述投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。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第 4 项规定的，基金管理人不得新增出借业务。</p>
<p>14、基金的投资</p>	<p>十、基金的融资、融券及转融通 本基金可以根据有关法律法规和政策的規定进行融资、融券。</p>	<p>十、基金的融资、融券及转融通 证券出借业务 本基金可以根据有关法律法规和政策的規定进行融资和转融通证券出借业务，在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，参与融资业务以及通过证券金融公司办理转融通证券出借业务，以提高投资效率并进行风险管理，无需召开基金份额持有人大会。基金参与融资和转融通证券出借等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法、人员及系统配备、风险管理制度、出借业务的相关安排及其他相关事项按照中国证监会的規定及其他相关法律法规的要求执行。 未来若法律法规或监管部门允许公开募集证券投资基金开展融券业务，在履行适当程序后，本基金可以开展融券业务，本基金管理人将根据相关法律法规規定，对相关调整予以公告并及时更新基金法律文件。</p>

16、基金资产的估值	<p>三、估值对象</p> <p>基金依法拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、权证及其他基金资产。</p>	<p>三、估值对象</p> <p>基金依法拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券及其他基金资产。</p>
16、基金资产的估值	<p>4、权证估值办法：</p> <p>（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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。</p> <p>（2）首次发行未上市的权证，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>（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。</p> <p>（4）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（3）项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（3）项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>	<p>4、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。</p>

	(5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。	
16、基金资产的估值	九、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项、权证估值方法的第(4)项、股票指数期货合约估值方法的第(2)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	九、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项、股票指数期货合约估值方法的第(2)项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
17、基金的费用与税收		11、因参与融资融券和转融通证券出借业务而产生的各项合理费用;
17、基金的费用与税收	4、上述(一)中4到11项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。	4、上述(一)中4到12项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
20、基金的信息披露		本基金参与转融通证券出借业务,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。
20、基金的信息披露		(26)基金合同生效后,连续30、40、45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人民币5000万元的情形时;

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。