

# 华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会的第一次提示性公告

华安基金管理有限公司决定以通讯开会方式召开上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会，并于2022年12月28日在中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csse.gov.cn/fund>)、《证券时报》及本公司网站([www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn))发布了《华安基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金份额份额持有人大会的公告》，为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

## 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管理办法》和《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金份额合同》的有关规定，上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上证龙头ETF”或“本基金”的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“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，审议《关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》。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2月13日起，至2023年2月20日17:00止(以本基金管理人收到表决票时间为为准)。

### 3.会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：华安基金管理有限公司上证龙头ETF基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

邮政编码：200120

联系人：刘昕玥

联系电话：021-38969729

4.鉴于本基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“联接基金”的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会并参与表决。具体内容详见本公司相关规定。

### 二、会议审议事项

本次基金份额持有人大会拟审议的事项为《关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》(以下简称“《议案》”，详见附件一)。

上述议案的内容详见《〈关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等相关事项的议案〉的说明》(详见附件四)。

### 三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2023年2月13日，即2023年2月13日下午交易时间结束后，在本基金登记结算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。

在2023年2月13日交易时间结束后，在联接基金注册登记机构登记在册的联接基金基金份额持有人可直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

### 四、表决票的填写和寄交方式及授权

1.本次会议表决票样本详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录基金管理人网站([www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn))、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csse.gov.cn/fund>)下载并打印表决票。

### 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(以下简称“公章”)，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正明文件，以及该合格境外机构投资者加盖公章(如有)的营业执照、商业登记证或其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡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，并提供个人投资者身份证件复印件，以及填妥的授权委托书原件(详见附件三)。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理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)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。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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加盖公章(如有)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证券账户卡复印件，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。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理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)。

(5)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代理人需将填妥的表决票和所需的的相关文件自2023年2月13日起，至2023年2月20日17:00以前(以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送达或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“上证龙头ETF基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人的办公地址及联系方式如下：

收件人：华安基金管理有限公司上证龙头ETF基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

邮政编码：200120

联系人：刘昕玥

联系电话：021-38969729

4.投资者如有任何疑问，可致电本公司客户服务电话40088-50099(免长途话费)咨询。

5.本部分内容同时适用于本基金基金份额持有人和联接基金基金份额持有人。基金份额持有人可接受本基金基金份额持有人和联接基金基金份额持有人的委托，以本基金基金份额持有人或联接基金基金份额持有人代理人的身份参加本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

### 五、计票

1.本次通讯会议的计票方式为：由本基金基金管理人授权的两名监督员在本基金托管人(中国工商银行股份有限公司)授权代表的监督下在所通知的表决截止日期后2个工作日内进行计票，并由公证机关对计票过程予以公证。

2.本基金基金份额持有人享有表决权。

3.联接基金基金份额持有人的表决权。

在每份参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数量乘以该基金份额持有人持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按四舍五入的原则保留到整数位。

### 4.表决票效力的认定原则

(1)表决票填写完整清晰，所提供的文件符合本会议通知的规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，视为有效表决票；有效表决票按表决意见计人相应的表决结果，其所代表的基金份额计人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选、多选、模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计人有效表决票，并按“弃权”计人对应的表决结果，其所代表的基金份额计人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，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计人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)送达时间同为同一天的，如果能判断收到时间先后的，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；若无法判断收到时间先后的，则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为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

#### 六、决议生效条件

1. 基金份额持有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高于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；  
2. 本次议案须经参加会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；  
3. 2023年2月13日至2023年2月20日以通讯方式召开的联接基金的基金份额持有人大会会议议程，以及基金份额持有人大会会议议程的修改的事项；  
4. 本次基金份额持有人大会审议并表决通过的事项，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定的事项项目基金份额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《基金法》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持有的基金份额占权益登记日基金总份额的一半分之一以上（含50%）且不能出席的，如果基金份额持有人未出席持有人大会且不能出席而不能够成功召开，本基金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和联接基金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本基金基金份额持有人、联接基金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、会议费用

1. 召集人（基金管理人）：华安基金管理有限公司  
2. 基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
3. 公证机关：上海市东方公证处  
联系人：傅某  
联系电话：021-62154848

4. 律师事务所：上海市通力律师事务所

#### 九、重要提示

1. 本基金管理人作为联接基金的基金管理人，不以联接基金的名义代表联接基金的基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人的身份出席本基金持有人大会并参加表决。

2. 本次基金份额持有人大会审议的转型事宜获表决通过，本基金将转型为华安上证50交易型开放式指数证券投资基金，在华安上证50交易型开放式指数证券投资基金合同生效后进入调仓期，调仓期内基金停牌，暂停办理申购赎回，无意外持仓。

3. 对于调仓期内停牌的股票，基金管理人在其复牌后调整为上证50指数成份股，在此之前暂停上证50基金的赎回申请并暂停赎回申请时间，提前寄出表决票。

4. 上述基金份额持有人大会有公告通过华安基金管理人网站（www.huamaan.com.cn）或中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csirc.gov.cn/fund）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40088-50099（免长途话费）咨询。

5. 若在大会召开之日前一工作日表决权通过，则无论本次基金份额持有人大会决议通过，表决权持有人大会决议通过。

6. 本次基金份额持有人大会召开期间，基金管理人可根据相关法律法规及基金合同约定，申请本基金停牌或复牌，具体日期安排详见基金管理人届时发布的相关公告。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

7. 本次基金份额持有人大会召开期间，基金管理人可根据相关法律法规及基金合同约定，申请本基金停牌或复牌，具体日期安排详见基金管理人届时发布的相关公告。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

8. 本次基金份额持有人大会召开期间，本基金的申购赎回业务基本按照若本基金停牌期间停牌时间不超过一个自然日的有关业务办理，具体请见基金管理人公告。若超过一个自然日的，基金管理人将暂停办理申购赎回业务，并授权基金管理人根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况暂停申购、赎回或调整赎回方式等。敬请基金份额持有人关注本基金暂停赎回期间的流动性风险。

9. 本公告的有关内容由华安基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《上证龙头企业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》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于上证龙头企业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》

华安基金管理有限公司 2022年12月28日

附件一：《关于上证龙头企业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》

华安上证龙头企业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

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《上海证券龙头企业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，本基金管理人经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议对上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金进行转型，基金名称变更为“华安上证50交易型开放式指数证券投资基金”，并修改标的指数、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制、收益分配政策、信息披露、费用水平、收益分配原则、估值方法等有关规定。

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》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

华安基金管理有限公司

2022年12月28日

附件二：

上证龙头企业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

(适用于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人)

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)：  
基金账户号(基金账户号)：

审议事项：  
同意 反对 弃权

关于上证龙头企业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

基金份额持有人签名或盖章

年 月 日

说明：1.对于“√”、“×”、“~”三种表决意见，基金份额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所持有的全部联接基金份额(权益登记日所登记的基金份额)的表决意见。  
2. 表决意见未选、多选、漏选、模糊不清或相互矛盾的(且其他各项符合会议通知规定的)表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持基金份额不计入表决权数。  
3. 本表决票中“基金账户”指持有上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额的基金账户。同一张表决票上出现多个基金账户，且账户名称相同的，视为同一表决权；账户名称不同的，视为多个表决权。  
4. 在计算基金份额持有人持有的表决权数时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金总份额的基础上乘以该持有人持有的基金份额数。若持有人持有的基金份额数为零，则该持有人不享有表决权。

本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站(www.huamaan.com.cn)，中国证监会基金电子披露网站( http://eid.csirc.gov.cn/fund )下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。

上证龙头企业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

(适用于华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人)

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)：

基金账户号(基金账户号)：

审议事项：  
同意 反对 弃权

关于上证龙头企业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

基金份额持有人签名或盖章

年 月 日

说明：1.对于“√”、“×”、“~”三种表决意见，基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表联接基金份额持有人所持有的全部联接基金份额(权益登记日所登记的基金份额)的表决意见。  
2. 表决意见未选、多选、漏选、模糊不清或相互矛盾的(且其他各项符合会议通知规定的)表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持基金份额不计入表决权数。  
3. 本表决票中“基金账户”指持有上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额的基金账户。同一张表决票上出现多个基金账户，且账户名称相同的，视为同一表决权；账户名称不同的，视为多个表决权。  
4. 在计算基金份额持有人持有的表决权数时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金总份额的基础上乘以该持有人持有的基金份额数。若持有人持有的基金份额数为零，则该持有人不享有表决权。

本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站(www.huamaan.com.cn)，中国证监会基金电子披露网站( http://eid.csirc.gov.cn/fund )下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。

上证龙头企业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

(适用于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人)

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)：

基金账户号(基金账户号)：

审议事项：  
同意 反对 弃权

关于上证龙头企业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

基金份额持有人签名或盖章

年 月 日

说明：1.对于“√”、“×”、“~”三种表决意见，基金份额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所持有的全部基金份额(权益登记日所登记的基金份额)的表决意见。  
2. 表决意见未选、多选、漏选、模糊不清或相互矛盾的(且其他各项符合会议通知规定的)表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持基金份额不计入表决权数。  
3. 本表决票中“基金账户”指持有上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额的基金账户。同一张表决票上出现多个基金账户，且账户名称相同的，视为同一表决权；账户名称不同的，视为多个表决权。  
4. 在计算基金份额持有人持有的表决权数时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金总份额的基础上乘以该持有人持有的基金份额数。若持有人持有的基金份额数为零，则该持有人不享有表决权。

本表决票可剪报、复印或登录基金管理人网站(www.huamaan.com.cn)，中国证监会基金电子披露网站( http://eid.csirc.gov.cn/fund )下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。

上证龙头企业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

(适用于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人)

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)：

基金账户号(基金账户号)：

审议事项：  
同意 反对 弃权

关于上证龙头企业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

基金份额持有人签名或盖章

年 月 日

3、本授权委托书中“个人委托人身份证件号码”，对于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金持有人持有的基金份额持有人认购、申购或赎回时所采用的基金账户的证件号码或该证件号码的更新；对于联接基金份额持有人，指联接基金份额持有人认购、申购或赎回时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

4、本授权委托书中“基金份额持有人拥有多个此类证券账户号”，指同一类型开放式指数证券投资基金基金份额持有人持有的证券账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类证券账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写证券账户号，其他情况可不填写。

5、本授权委托书中“上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金所有份额”，指同一类型的上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金所有份额。

6、本授权委托书中“本人”指持有人本人，其配偶、子女、父母、配偶的父母、子女的配偶、兄弟姐妹、配偶的兄弟姐妹、配偶的父母的兄弟姐妹、配偶的兄弟姐妹的配偶、配偶的父母的兄弟姐妹的配偶、配偶的兄弟姐妹的配偶的父母。

7、本授权委托书为机构的应当由名称后加盖公章，个人则为本人签字。

8、本授权委托书若无上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金或其联接基金全部份额（含截至权益登记日的未付管理费收益）向代理人所做授权，其授权无效。

附件四：《关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金转型及修改基金合同的议案》

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同于2010年11月18日生效，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。根据市场环境变化，为更好地满足持有人利益，经与基金管理人协商一致，拟对上证龙头企业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，经与基金托管人协商一致，对基金合同进行修改，具体修改内容见《关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金转型及修改基金合同等相关事项的议案》，本次上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金变更基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予注册。

本次上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同修改参加参加会议的基本份额持有人人数达到基金总份额的50%以上（含50%）时，因此次修改参加参加会议的基本份额持有人人数未达到基金总份额的50%以上（含50%），但参加参加会议的基本份额持有人数达到基金总份额持有人大会表决通过的可能时，参加参加会议的基本份额持有人大会表决通过的基金基本份额持有人数达到基金总份额的50%以上（含50%），且基金管理人书面同意时，基金管理人将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金管理人在履行适当程序后，本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务，基金管理人将根据法律法规的规定参与其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（三）变更后基金的投资目标、投资范围、投资策略和投资限制等投资相关

指标跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

2、投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、衍生工具（股指期货等）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、中期票据、短期融资券、分离交易可转债、资产支持证券、可交换债券）、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相关规定的比例限制。

基金管理人在履行适当程序后，本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

基金管理人在履行适当程序后，本基金将根据法律法规的规定参与其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（1）组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按标的指数成份股及其权重构建基金的投资组合。

（2）替代性策略

对于出现流动性不足，因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金管理人无法买入该成份股时，基金管理人将通过投资成份股、合成成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

（3）股指期货投资策略

本基金投资股指期货的目的是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、易于风险管理的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更有效地实现基金的收益目标，实现投资目标。

（4）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，使其资金得到更加充分的利用，使投资者获得更多的投资收益。本基金主要利用利率走势判断为主，辅之于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风险可控的前提下，灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略、骑乘策略和信用策略等品种进行主动投资。

（5）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和限额市场交易策略，通过分析比较不同券种的收益率水平、信用风险、流动性等因素，利用利率走势判断为主，辅之于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风

险可控的前提下，将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围内，选择风险较低的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（6）融资及转融通证券出借业务投资策略

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（7）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（8）转融通证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（9）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（10）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（11）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（12）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（13）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（14）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（15）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（16）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（17）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（18）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（19）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（20）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（21）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（22）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（23）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（24）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（25）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（26）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（27）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（28）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（29）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（30）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（31）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

（32）资产支持证券出借业务

本基金选择投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，并持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不超过基金资产净值的10%。

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；  
⑭本基金不投资于股票类证券以及中国证监会认定的其他主体为交易对象的金融产品。本基金管理人将通过制度和流程对上述限制进行管理。

(5)法律法规及中国证监会规定的《基金合同》约定的其他投资限制。  
除上述第(6)、(13)、(14)项外，因证券市场波动、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导致的被动投资，以及中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，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，本基金的投资策略应当符合基金合同的规定。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。  
基金管理人应按照基金合同的规定，定期向基金托管人提供基金的资产组合报告，以供基金托管人检查监督。

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金相似的混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险特征。

本基金为股票型基金，将坚定地跟踪标的指数，努力追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，通过严格的投资纪律和科学的资产配置，力争实现基金净值的长期稳定增值。

本基金为股票型基金，将坚定地跟踪标的指数，努力追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，通过严格的投资纪律和科学的资产配置，力争实现基金净值的长期稳定增值。  
本基金将根据所处的权证类型（包括股票权证），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；且最近交易日经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发布大幅调整市价的，以最近交易市价作为公允价值；如果估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）不存在，或由于非交易原因导致当日无市价的，按最近交易市价（收盘价）估值；如果估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）不存在，或由于非交易原因导致当日无市价的，则采用估值技术确定公允价值。

2.对于上市期间的权益类证券正券区分如下情况处理：

①首次公开发行股票和上市的股票：以最近交易日的收盘价作为公允价值；

②首次公开发行股票的可转换债券：采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本价估值；

③流通受限股票：包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、首次公开发行上市后的限售期内股票、限售期内通过大宗交易取得的股票、因司法冻结和强制扣划取得的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3.交易所市场交易的固定收益品种：在上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行票据、政策性银行票据、同业存单、短期融资券、中期票据、公司债、商业银行金融债、可转换债券、资产支持证券、同业存单、债券回购等品种的公允价值。

(1)对在交易所市场上市的固定收益品种(没有规定的除外)，选取第三方估值机构提供的估值。

(2)对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日是应收利息计算日，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；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，确定公允价值。

(3)对在交易所市场挂牌转让的债券，按估值日收盘价减去用估值法确定的公允价值，在估值法难以可靠计量的情况下，按成本价估值；对存在活跃市场的债券，按估值日的公允价值。

(4)对于市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的，采用估值技术确定其公允价值；对于不存在

市场估值或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

4.对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第二章“估值机构提供的相应品种”中的规定估值；对全国银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三章“估值机构提供的相应品种当期的唯一估值净价或推荐估值净价估值”。对于含权债券买入返售的估值方法，参照当期的唯一估值净价或推荐估值净价估值；对于含权债券卖出返售的价格进行估值；对银行间市场上不含权的固定收益品种，采用估值法确定其公允价值。

5.对在交易所市场挂牌转让的债券，对不存在活跃市场的债券，按估值日的公允价值。

6.本基金同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7.如果确有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原则估值。

8.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。

9.基金管理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，共同商议解决办法，避免不公平对待不同投资者。

根据法律法规及基金合同，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，基金托管人基金会计责任由基金托管人担任，因此就与本基金有关的基金会计问题，如经基金管理人与基金托管人协商一致后，基金管理人可以以其基金资产净值的计算结果对外予以公布。

1.管理费率：0.15%。

2.托管费率：0.05%。

3.赎回费率为：赎回费用由赎回基金份额的申购人承担，赎回费用归入基金财产，赎回费用收取金额由赎回人承担。

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0.5%的标准收取佣金，其中包含申购或赎回费用。

（六）基金收益分配原则及方法

1.在符合有关基金分红条件的前提下，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率不低于标的指数同期累计报酬率。

2.在符合有关基金分红条件的前提下，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近近标的指数同期累计报酬率。

3.本基金收益分配方式为现金分红。

4.本基金份额净值可能低于面值。

5.每份基金份额享有同等分配权。

6.在不违背法律法规及基金合同的规定，且对基金份额持有人利益要求履行适当影响的前提下，基金管理人可以在按约定原则，但不低于基金合同规定的比例和范围调整基金收益分配原则。

7.基金管理人拟提前基金份额持有人大会，召集基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会决定基金收益分配方案。

8.基金管理人修订基金合同。

除上述主要内容的调整需要修改基金合同以外，基金管理人需根据现行有效的法律法规及基金合同的相关内容，向基金托管人申请基金资产净值计算规则的修订及基金合同的修订，基金管理人向基金托管人申请基金资产净值计算规则的修订及基金合同的修订，基金管理人就方案向相关事项的议案。

1. 上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2010年9月1日《关于核准华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》批准，由华安基金管理有限公司[2010]1203号文核准备案，基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

2. 基金份额持有人根据持有的基金份额，向基金管理人申购对应的证券投资基金。自2010年10月25日至2010年11月12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，“上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同”于2010年11月12日生效。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理财行业改革发展的需要，对基金合同进行修订，基金管理人拟提请基金份额持有人大会对基金合同进行修订，基金管理人就方案向相关事项的议案。

3. 基金管理人将严格按照基金持有人大会决议以及法律法规的规定修订基金合同，修订后的基金合同已经基金管理人和基金托管人签字盖章，并已经中国证监会变更注册。

4. 本次基金份额持有人大会费用的说明。

根据《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会费用用以及律师费等相关费用可从基金资产列支。

5. 本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

6. 法律法规另有规定的，从其规定。基金管理人在决议生效后依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定公告相关信息，包括但不限于确定本基金转码为华安上证50交易型开放式指数证券投资基金的具体时间，根据本次审议事项对基金合同进行修订，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理财行业改革发展的需要，对基金合同进行修订，基金管理人拟提请基金份额持有人大会对基金合同进行修订，基金管理人就方案向相关事项的议案。

7. 其他。

投资者可以通过登录华安基金管理有限公司网站([www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn))或拨打华安基金管理有限公司客户服务热线40088-50099,021-38969999咨询相关情况。

特此公告。