

# 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.csrc.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基金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运作管理办法》和《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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“本基金托管人”）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。具体内容详见本公告相关规定。

## 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）。

上述议案的内容说明详见《<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、复印附件二或登录本基金管理人网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.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其他证明文件，以及该合格境外机构投资者加盖公章（如有）的营业执照、商业登记证或者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）通过专人送交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办法如下：

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，可致电本基金管理人客户服务电话 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。基金管理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，并由公证机关对其计票过程予以公证。

### 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、联接基金基金份额持有人的表决权

在计算参会份额和计票时，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乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

### 4、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，且在截止时间之前送达指定联系地址的，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、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 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决议通过，是本基金份额持有人大会决议生效的前提；

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自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代表的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）方可举行。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本基金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、本次大会相关机构

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：傅匀

联系方式：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全体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代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

2、若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，无意持有华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的投资者请做好退出安排。

3、对于调仓期内停牌的股票，本基金管理人在其复牌后调整为上证 50 指数成份股，在此之前可能导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

4、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。

5、上述基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站（[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)）或中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.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。

6、若 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审议的事项未获表决通过，则无论本基金份额持有人大会决议事项是否通过，本基金份额持有人大会决议不生效。

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，具体日期安排请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全天停牌则相应暂停该日申购赎回业务的原则处理，具体请见相关公告。若相关业务有其他变化，请详见基金管理人届时发布的相关公告。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。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转型及修改基金合同等相关事项的议案>的说明》

华安基金管理有限公司

2022年12月29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转型及修改基金合同等相关事项的议案》

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《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,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、业绩比较基准、风险收益特征、费率水平、收益分配原则、估值方法等相关事项。具体说明可详见附件四《<关于上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金转型及修改基金合同等相关事项的议案>的说明》。

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）：			
证券账户号/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转型及修改基金合同等相关事项的议案			
基金份额持有人/代理人签名或盖章			
年 月 日			
说明： 1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。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持有的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。 2、表决意见未选、多选、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，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”，计入有效表决票。签字/盖章部分不完整、不清晰的，将视为无效表决。 3、本表决票中“证券账户号/基金账户号”，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证券账户号/基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类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，应当填写账户号，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上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金所有份额。			

(本表决票可剪报、复印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.csrc.gov.cn/fund>) 下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。)



的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

（本表决票可剪报、复印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.csrc.gov.cn/fund>）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）



授权委托书填写注意事项:

1、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；

2、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，指基金份额持有人认购、申购或在证券交易所买卖本基金时的证件号码或该证件号码的更新；对于联接基金持有人，指联接基金份额持有人认购、申购联接基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

3、本授权委托书中“证券账户号”，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证券账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类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，应当填写证券账户号，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上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金所有份额。

4、本授权委托书中“基金账户号”，指持有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基金份额的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金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，应当填写基金账户号，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所有份额。

5、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；

6、以上授权是持有人就其持有的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累计收益）向代理人所做授权；

7、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。

## 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转型及修改基金合同等相关事项的议案》的说明

《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，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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，决定以通讯方式召开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》。本次上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金变更事宜经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

本次上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金变更方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，因此变更方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。参加基金份额持有人大会表决的基金份额持有人为权益登记日登记在册的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，本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额须占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）。

基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且自本次基金份额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。中国证监会对本次上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金变更方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次修改方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

具体方案如下：

### 一、方案要点

#### （一）更名

基金名称由“上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金”更名为“华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金”。

(二) 变更后基金的基本情况

- 1、基金名称：华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金的类别：股票型证券投资基金。
- 3、标的指数：上证 50 指数。
- 4、基金的运作方式：交易型开放式。
- 5、基金的投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
- 6、基金存续期限：不定期。

(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

1、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

2、投资范围

本基金的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成份股、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、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券等）、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）、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相关规定）。

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。

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。

基金的投资组合比例为：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%，且不低于非现金基金资产的 80%。股指期货及其他金融

工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围会做相应调整。

### 3、投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

#### （1）组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

#### （2）替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、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将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、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，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。为此，本基金将以市场利率趋势研判为主，基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、骑乘策略和利差套利策略等对高流动性、低风险的债券品种进行主动投资。

#### （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、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，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

本基金在参与融资、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、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

#### 4、投资限制

（1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的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%；

（2）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%；

（3）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%；

（4）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%；

（5）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%；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(9) 本基金投资股指期货将遵守下列要求：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%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(10) 基金总资产不超过基金净资产的 140%；

(11) 本基金参与融资将遵守下列要求：本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(12) 本基金参与转融通证券出借业务将遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，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；

(13)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(15)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。

除上述第(6)、(13)、(14)项外，因证券或期货市场波动、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本基金基金合同生效之日起开始。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对上述投资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。

## 5、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：上证 50 指数收益率。

本基金为交易型开放式指数基金，将紧密跟踪标的指数，努力追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金标的指数变更的，相应更换基金名称和业绩比较基准，并在报中国证监会备案后及时公告。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在规定媒介公告。若标的指数变更对基金投资

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，经基金管理人与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后在规定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示。

## 6、风险收益特征

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、债券型基金和混合型基金。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收益特征。

### （四）变更后的基金资产估值方法

#### 1、证券交易所上市的权益类证券的估值

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以及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；

#### 2、处于未上市期间的权益类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，以最近一日的市价（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、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、交易所市场交易的固定收益品种（指在上海证券交易所、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、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、资产支持证券、同业存单等债券品种，下同）的估值：

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（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进行估值；

(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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息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，确定公允价格；

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，以活跃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情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动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，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照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估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（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。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。

5、同一证券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。

6、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、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。

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。

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。

#### （五）变更后基金的费率水平

1、管理费率：0.15%。

2、托管费率：0.05%。

3、申购费和赎回费

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，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

#### （六）变更后基金的收益分配原则

1、基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，基金管理人可以进行收益分配；

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标的指数同期累计报酬率。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式为现金分红；

4、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行

适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### （七）授权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，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金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修订基金合同。

#### （八）《华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的生效

自 2023 年 2 月 23 日起，原《上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效，《华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效。本基金管理人将公告《华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效的具体事项。

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现行有效的法律法规的规定及《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》的方案要点修订基金合同并实施转型方案。

## 二、基金管理人就方案相关事项的说明

### 1、上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金的历史沿革

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《关于核准上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可【2010】1203 号文）核准募集，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。

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金自 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 18 日起正式生效。上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金自成立以来运作平稳。

2、基金管理人将严格按照基金份额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。

### 3、关于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以及律师费等相关费用可从基金资产列支。

## 三、基金份额持有人大会决议生效

本次基金份额持有人大会决议自基金份额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。基金管理人将在决议生效后依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

基金管理人根据基金份额持有人大会授权办理有关具体事宜，包括但不限于确定本基金转型为华安上证 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等法律文件进行修订，在华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金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，调仓期结束后复牌并恢复办理基金份额的申购赎回等，并及时公告。

## 四、其他

投资者可以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。