华宝基金管理有限公司
关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、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》等法律法规和《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”，本基金的基金份额包括华宝中证 1000 份额，基金代码 162413，场内简称“1000 分级”；华宝中证 1000A 份额，基金代码 150263，场内简称“1000A”；华宝中证 1000B 份额，基金代码 150264，场内简称“1000B”)的基金管理人华宝基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“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(以下简称“本次会议”)，审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”，并对《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)进行修订。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2020 年 10 月 9 日起，至 2020 年 10 月 18 日 17:00 止(投票表决时间以基金管理人收到表决票的时间为准)

3、会议通讯表决票的寄达地点

收件人：华宝基金管理有限公司

地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200120

联系人：唐棠

联系电话：400-700-5588(免长途话费)，400-820-5050(免长途话费)或 021-38924558

传真：021-38505777-985

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明：“华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

基金份额持有人也可将填妥的表决票和所需的相关文件按上述传真号码以传真方式发送至基金管理人。

二、会议审议事项

本次会议审议的事项为《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》(见附件一)。

上述议案的内容说明见《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》(见附件二)。

三、权益登记日

本次会议的权益登记日为 2020 年 9 月 30 日，即该日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(含华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的基金份额持有人)或其授权的代理人均享有本次会议的表决权。

四、表决票的填写和寄交方式

(一)本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过登陆基金管理人网站(www.fsfund.com)下载或从报纸上剪裁、复印表决票。

(二)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（或基金管理人认可的其他印章，下同)，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、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；

3、个人投资者委托他人投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者身份证件正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件(详见附件四)。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托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，应由受托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(详见附件四)。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托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，应由受托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(详见附件四)。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托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、以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

(三)基金份额持有人或其受托人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2020 年 10 月 9 日起，至 2020 年 10 月 18 日 17:00 以前(投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：华宝基金管理有限公司

地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

邮政编码：200120

联系人：唐棠

联系电话：400-700-5588(免长途话费)，400-820-5050(免长途话费)或 021-38924558

传真：021-38505777-985

(四) 投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-700-5588（免长途话费)、400-820-5050(免长途话费)或 021-38924558 咨询。

五、计票

1、本次会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人中国建设银行股份有限公司授权代表的监督下在表决截止日期后 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、华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

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，且在截止时间之前送达基金管理人的，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会议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，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会议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受托人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次会议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，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，传真的以基金管理人传真接收到的时间为准。

(5)授权效力确定规则

1)如果同一基金份额多次以有效书面方式授权的，以最后一次书面授权为准。不能确定最后一次书面授权的，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书面授权为准；最后时间收到的多次书面授权均为表示具体表决意见的，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)如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中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；

3)如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准。

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华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额占权益登记日各自基金份额的二分之一以上(含二分之一)，基金份额持有人大会为有效召开。

2、《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》应当由提交有效表决票的华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

3、本次基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当自决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案。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投权

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次会议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持有的华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额占权益登记日各自基金总份额的二分之一以上(含二分之一)方可举行。如果本次会议不符合前述要求而不能够成功召开，根据《基金法》和《基金合同》的规定，本基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。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)华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额权益登记日各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具出面意见。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。

八、本次会议相关机构

1、召集人：华宝基金管理有限公司

联系地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼

联系人：唐棠

联系电话：021-38505985

传真：021-38505777-985

客户服务电话：400-700-5588(免长途话费)，400-820-5050(免长途话费)或 021-38924558

网址：www.fsfund.com

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

3、公证机构：上海市东方公证处

联系地址：上海市凤阳路 660 号

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

邮政编码：200041

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

注册及办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

联系人：丁媛

九、重要提示

1、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次会议审议的议案，基金管理人将按照中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的要求完成分级基金整改，取消分级运作机制，将华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额按照基金份额参考净值折算为华宝中证 1000 份额。届时，基金管理人将相应变更产品名称、修改基金合同并就取消分级运作和转型安排进行公告。敬请投资者合理安排投资计划。

2、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。

3、根据深圳证券交易所的业务规则，华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将于本公告发布之日(2020 年 9 月 9 日)开市起停牌至当日 10:30，并将自 2020 年 10 月 19 日(计票日)开市起停牌至基金份额持有人大会决议生效公告日 10:30(如基金份额持有人大会决议生效公告发布日为非交易日，则发布日后首个交易日开市时复牌)。

4、本次会议有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-700-5588(免长途话费)、400-820-5050(免长途话费)或 021-38924558 咨询。

5、基金管理人将在发布本公告后 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就本次会议相关情况做必要说明，请予以留意。

6、本次基金份额持有人召开期间，投资人可以按照本基金招募说明书的相关规定正常办理申购、赎回、转托管及场内份额配对转换业务，业务受理不受影响。相关业务受理若有变化，详见基金管理人发布的相关公告。

7、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或者未能通过本次会议审议的议案，根据《基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金可能会重新召开基金份额持有人大会。

8、本次公告的有关内容由华宝基金管理有限公司负责解释。

华宝基金管理有限公司

2020 年 9 月 9 日

附件一：《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》

附件二：《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》

附件三：华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件四：授权委托书(样本)

附件一：《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)基金份额持有人：

根据市场环境变化，为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》等法律法规和《华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)有关规定，经本基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议将本基金转型为华宝中证 1000 指数证券投资基金，并相应修改《基金合同》。基于此次本基金由分级基金转为普通指数基金事宜，按照现时有效的相关法律法规和中国证监会的有关规定对《基金合同》进行修订，修订内容包括删去基金份额的分级与净值计算规则、场内份额配对转换、份额折算、上市交易等基金份额分级相关条款，变更基金名称，修改基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配以及其他部分条款。具体转型方案请见附件二《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》、附件《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同(草案)》。

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次基金转型及《基金合同》修改的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在转型实施前，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排、份额转换安排等事项的转型实施安排并提前公告。

以上议案，请予审议。

华宝基金管理有限公司

2020 年 9 月 9 日

附件二：《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》

华宝中证 1000 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)于 2015 年 6 月 4 日成立并正式运作。为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》等法律法规和《华宝中证 1000 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，本基金管理人华宝基金管理有限公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型及《基金合同》修改事宜，将本基金转型为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”，并对《基金合同》进行修订。

《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》应当经参加大会的华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的基金份额持有人或其代理人各自所持华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效，故(关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案)存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。中国证监会对本次会议表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或本基金、华宝中证 1000 指数证券投资基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

一、基金转型方案要点

(一)更名

基金名称由“华宝中证 1000 指数分级证券投资基金”更名为“华宝中证 1000 指数证券投资基金”(以下简称“华宝中证 1000 指数基金”)。

(二)不再设置基金份额的分级、折算、配对转换与上市交易等机制

华宝中证 1000 指数基金拟由本基金转型而来，转型后由分级基金转为普通指数基金，因而不再设置基金份额的分级、折算、配对转换与上市交易等机制，删去相关内容，包括基金份额的分级与净值计算规则、场内份额的配对转换、基金份额折算、基金的上市交易等章节以及其他相关条款。

(三)转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，本基金将安排不少于 20 个交易日的选择期(具体以基金管理人届时发布的公告为准)。选择期期间，基金份额持有人可以选择卖出华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额或者赎回华宝中证 1000 份额。对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额将最终转换为华宝中证 1000 指数基金基金份额。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

在选择期期间选择赎回的，仍适用本基金的赎回费率和赎回费计入基金财产的比例。

由于本基金在选择期期间需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《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、转入、转出、配对转换或调整赎回方式等。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

(四)向深圳证券交易所申请本基金的华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额终止上市交易

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，向深圳证券交易所申请本基金的华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额终止上市交易。本基金转型后，华宝中证 1000A 份额以及华宝中证 1000B 份额全部转换为非上市的华宝中证 1000 指数基金基金份额，不再进行上市交易。

(五)基金份额的转换

本基金管理人将在基金份额持有人大会决议生效后，对华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额进行份额的转换。华宝中证 1000 份额的场外份额将转换为华宝中证 1000 指数基金的场外份额，华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额将在终止分级运作后以份额折算基准日华宝中证 1000 份额的基金份额净值为基准按照各自的基金份额参考净值折算成华宝中证 1000 指数基金的场内份额，华宝中证 1000 份额的场内份额转换为华宝中证 1000 指数基金的场内份额。转换完成后，基金份额持有人持有的基金份额数将按照转换规则相应增加或减少。

华宝中证 1000A 份额和华宝中证 1000B 份额的份额折算计算公式：

华宝中证 1000A 份额(或华宝中证 1000B 份额)的折算比率=份额折算基准日华宝中证 1000A 份额(或华宝中证 1000B 份额)的基金份额参考净值/份额折算基准日华宝中证 1000 份额的基金份额净值

华宝中证 1000A 份额(或华宝中证 1000B 份额)基金份额持有人持有的折算后华宝中证 1000 指数的场内份额数=基金份额持有人持有的折算前华宝中证 1000A 份额(或华宝中证 1000B 份额)的份额数×华宝中证 1000A 份额(或华宝中证 1000B 份额)的折算比率

华宝中证 1000 份额、华宝中证 1000A 份额、华宝中证 1000B 份额基金份额持有人持有的转型后华宝中证 1000 指数的基金份额数的具体计算和基金份额转换的具体安排详见基金管理人届时发布的公告。

(六)“第十二部分 基金的投资”章节中增加进行融资和转融通的相关内容，删除投资权证的相关内容。

1、修改前，本基金的投资范围为：“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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证、股指期货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)。”

修改后，华宝中证 1000 指数的投资范围为：“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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、资产支持证券、股指期货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)。”

本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通证券出借等相关业务。”

2、根据投资范围的变化补充融资和转融通的投资策略，删除权证的投资策略，具体如下：

增加了：“6、转融通投资策略

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。

7、融资投资策略

参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成的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。”

删除了：“本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，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、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。”

3、根据投资范围的变化补充融资和转融通投资限制，删除权证的投资限制，具体如下：

增加了：“(12)本基金参与转融通证券出借业务，需遵守下列规定：

1)出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%；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；

2)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%；

3)最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

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；

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不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；”和

“(16)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%；”

删除了：“(3)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%；

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(5)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%；”

(七)风险收益特征的变更

由于不再设置基金份额的分级，删除了风险收益特征中分级份额的内容。修改前，本基金的风险收益特征为：“本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，华宝中证 1000A 份额具有较低风险、收益相对稳定的特征；华宝中证 1000B 份额具有较高风险、较高预期收益的特征。”

修改后，华宝中证 1000 指数基金的风险收益特征为：“本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。”

(八)转型后的基金估值方法

华宝中证 1000 指数基金的估值方法，具体如下：

“1、证券交易所上市的有价证券的估值

(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；

(2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日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；

(3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日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进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价作为估值全价；

(5)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

交易所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；

(6)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，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

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，以最近一日的市价(收盘价)估值；

(2)首次公开发行未上市的股票和固定收益品种，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)在发行时明确一定期限限售期的股票，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、全国银行间债券市场交易的固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、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。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。

5、基金参与融资与转融通证券出借业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。

6、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。

7、当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、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，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果接约定对外予以公布。”

(九)转型后基金的费用

1、基金管理人的管理费

华宝中证 1000 指数基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

华宝中证 1000 指数基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、标的指数使用相关费用

华宝中证 1000 指数基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议的约定计提标的指数许可使用费，具体如下：

“指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

H=E×0.02%÷当年天数

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度 5 万元。指数许可使用费将按照指数许可协议的约定进行支付。

如果指数使用许可协议约定的标的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在规定媒介进行公告。”

4、申购费用和赎回费用

(1)申购费率

华宝中证 1000 指数采取前端收费模式收取基金申购费用。投资者可以多次申购华宝中证 1000 指数，申购费率按每笔申购申请单独计算。华宝中证 1000 指数的场外申购费率表如下，场内申购费率由场内销售机构参照场外申购费率执行。

申购金额	申购费率
100 万以下	1.0%
大于等于 100 万，小于 200 万	0.6%
200 万(含)以上	每笔 1000 元

申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于华宝中证 1000 指数的市场推广、销售、登记费等各项费用。

(2)赎回费率

华宝中证 1000 指数基金的场外赎回费率表如下，场内赎回费率由场内销售机构参照场外赎回费率执行。

持有期限	赎回费率
少于 7 日	1.5%
大于等于 7 日，少于 6 个月	0.50%
大于等于 6 个月	0

注：①此处一月按 30 日计算

②华宝中证 1000 指数转型前华宝中证 1000 指数分级证券投资基金基金份额持有人的基金份额持有期限将计入其持有华宝中证 1000 指数的基金份额的持有期限。

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 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产，对于持有期大于等于 7 日的投资者收取的赎回费将赎回费总额的 25%计入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

(十)转型后基金的收益分配原则

华宝中证 1000 指数基金的收益分配原则，具体如下：

“1、本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告；

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投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投资方式免收再投资的费用；如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，参照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。具体权益分配程序等有关事项参照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。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，并于变更实施日前在规定媒介上公告，且不需召开基金份额持有人大会。”

(十一)其他修改

除上述主要内容的调整需要修改《基金合同》以外，考虑到自《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》、《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信息披露管理办法》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华宝中证 1000 指数的产品特征修订基金合同的相关内容。

(十二)《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》的生效

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次基金转型及《基金合同》修改的有关具体事宜，包括但不限于根据《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项议案的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施转型前披露修改后的基金法律文件；提议授权基金管理人在转型实施前，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排、份额转换安排等事项的转型实施安排并提前公告。

《华宝中证 1000 指数证券投资基金基金合同》经基金管理人和基金托管人双方公章以及双方法定代表人或授权代表签章，自基金转型实施日起生效，《基金合同》自同一日起失效。

二、基金管理人对基金转型及《基金合同》修改相关情况的说明

(一)历史沿革

本基金经 2015 年 4 月 20 日中国证监会证监许可【2015】664 号文准予募集，基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《基金合同》于 2015 年 6 月 4 日起正式生效。

(二)基金转型法律方面的可行性

本基金由分级基金转型为普通指数基金，删去《基金合同》中基金份额的分级与净值计算规则、场内份额配对转换、份额折算、上市交易等基金份额分级及上市交易相关条款，变更基金名称，修改基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配以及其他部分条款。本次对《基金合同》的修改事宜符合《基金合同》第十二部分“基金份额持有人大会”的规定，根据《基金合同》第二十四部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，“变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。”且本次基金份额持有人大会决议按特殊决议处理，须经参加大会的华宝中证 1000 份额持有人、华宝中证 1000A 份额持有人、华宝中证 1000B 份额持有人或其各自代理人在各自份额类别内所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可生效。因此，本次基金转型相应修改《基金合同》不存在法律方面的障碍。

(三)基金转型运作方面的可行性

为实现基金转型的平稳过渡，本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、登记、系统准备方面进行了深入研究，经与基金托管人的沟通和协作，做好了基金转型的相关准备。本次基金转型不存在技术方面的障碍。

(四)基金管理人修订合同的可行性

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》。

三、基金转型的主要风险及预备措施

(一)基金持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次基金持有人大会需要参加大会的华宝中证 1000 份额持有人、华宝中证 1000A 份额持有人、华宝中证 1000B 份额持有人或其各自代理人所代表的基金份额占权益登记日各自基金份额的二分之一以上(含二分之一)方可举行。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，基金管理人将通过各种渠道联系基金份额持有人，积极邀请基金份额持有人自行或委托他人进行投票。

如有必要，基金管理人将推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如在投票表决截止日后，因不符合上述条件本次基金份额持有人大会确实未能成功召开，那么根据《基金法》和《基金合同》，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就本次大会议案二次召集基金份额持有人大会。

(二)转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范《基金合同》的修订方案被持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对《基金合同》的修订方案进行适当的调整，并重新公告。