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相关事项的提示性公告

华宝基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定以通讯方式召开华宝中证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”）的基金份额持有人大会，会议投票表决起止时间为自2020年10月9日起，至2020年10月18日17:00止。为保护投资者利益，现基金管理人提示如下：

一、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。

二、本基金1000A份额与1000B份额将于基金份额持有人大会计票日（2020年10月19日）开市起至基金份额持有人大会决议生效公告日10:30分停牌。如基金份额持有人大会决议生效公告日为非交易日，则下一交易日开市恢复交易。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

三、投资者可通过以下途径咨询详情：
华宝基金管理有限公司
客户服务电话：400-700-5588、400-820-5050、021-38924558
网站：www.fsfund.com

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。

投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

华宝基金管理有限公司
2020年9月11日

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第二次提示性公告

华宝基金管理有限公司已分别于2020年9月9日、2020年9月10日在《证券日报》、华宝基金管理有限公司官网（http://www.fsfund.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）发布了《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》和《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第一次提示性公告》。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第二次提示性公告。

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授权

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书面意见。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11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，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议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或注册上市的股票）、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：

$H=E\times 0.50\%\div$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：

$H=E\times 0.10\%\div$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：

$H=E\times 0.02\%\div$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、登记结算等各项费用。

（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。基金管理人可以在必要的情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

本次基金份额持有人大会如确实未能通过本次会议审议的议案，根据《基金法》及《基金合同》的有关规定，本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。

（三）基金转型后遭遇大规模赎回的流动性风险

为应对基金转型可能引发的大规模赎回，本基金会尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。

（四）预防及控制基金转型过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，对于基金转型过程中可能发生的较大规模的申购赎回或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，科学有效地控制基金的市场风险。

四、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：
华宝基金管理有限公司
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
网站：www.fsfund.com

华宝基金管理有限公司
2020年9月9日

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

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/证券账号：			
审议事项：	同意	反对	弃权
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			
基金份额持有人（或受托人）签名或盖章： 2020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所填基金账户号/证券账号所持全部基金份额的表决意见。2、“基金账户号”指持有本基金场外华宝中证1000份额的基金账户号，“证券账号”指持有本基金场内华宝中证1000份额、华宝中证1000A份额和华宝中证1000B份额的证券账号。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，应当填写基金账户号/证券账号，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本基金所有份额。3、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。4、签名或盖章部分填写不完整、不清晰的表决票计为无效表决票。			

基金份额持有人可通过登陆基金管理人网站下载（www.fsfund.com）或从报纸上剪裁、复印本表决票。

附件四：
授权委托书

兹委托　　先生/女士/　　机构代表本人/本机构参加投票截止日为2020年10月18日的以通讯方式召开的华宝中证1000指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。若华宝中证1000指数分级证券投资基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人姓名/名称（签字/盖章）：
委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：
基金账户号/证券账号：
受托人姓名/名称（签字/盖章）：
受托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：
委托日期：　　年　　月　　日

附注：（1）本授权委托书中“委托人证件号码”，指基金份额持有人在开立基金账户/证券账户时所使用的证件号码或其现行有效的更新。（2）此授权委托书剪报、复印或按以上格式或内容自制在填写完整并签字盖章后均为有效。（3）“基金账户号”指持有本基金场外华宝中证1000份额的基金账户号，“证券账号”指持有本基金场内华宝中证1000份额、华宝中证1000A份额和华宝中证1000B份额的证券账号。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，应当填写基金账户号/证券账号，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本基金所有份额。（4）受托人的表决意见代表委托人基金账户/证券账户下全部基金份额的表决意见。

附件：《华宝中证1000指数证券投资基金基金合同（草案）》

华宝基金管理有限公司
华宝中证1000指数证券投资基金
基金合同（草案）
基金管理人：华宝基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

第一部分　前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

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》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

三、华宝中证1000指数证券投资基金由华宝中证1000指数分级证券投资基金变更注册而来，华宝中证1000指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。

中国证监会对华宝中证1000指数分级证券投资基金募集的注册及华宝中证1000指数分级证券投资基金变更为本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

第二部分　释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指华宝中证1000指数证券投资基金，由华宝中证1000指数分级证券投资基金转型而来

2、基金管理人：指华宝基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同：指《华宝中证1000指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充，本基金合同由《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》修订而成

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华宝中证1000指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《华宝中证1000指数证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《华宝中证1000指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，销售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指华宝基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位

25、场外：指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构进行基金份额申购和赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

26、场内：指通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用交易系统办理基金份额申购、赎回等业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

27、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人开放式基金账户和/或深圳证券账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为华宝基金管理有限公司或接受华宝基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

29、登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统。通过场外销售机构申购的基金份额登记在本系统

30、证券登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统。通过场内会员单位申购的基金份额登记在本系统

31、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户，用于记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户，记录在该账户下的基金份额登记在登记结算系统

32、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务导致基金份额变动及结余情况的账户

33、深圳证券账户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在证券登记系统

34、基金合同生效日：指《华宝中证1000指数证券投资基金基金合同》生效日，原《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起终止

35、基金转型实施日：指基金管理人公告的华宝中证1000指数分级证券投资基金转型为华宝中证1000指数证券投资基金的实施日期。《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加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章，并经华宝中证1000指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会决议通过，自基金转型实施日起生效，《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效

36、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

37、存续期：指原《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》生效至《华宝中证1000指数证券投资基金基金合同》终止之间的不定期期限

38、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

39、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

40、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

41、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

42、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

43、《业务规则》：指深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、华宝基金管理有限公司、基金销售机构的相关业务规则及其不时做出的修订

44、标的指数：指中证1000指数，及其未来可能发生的变更

45、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

46、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

47、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

48、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作，包括系统内转托管和跨系统转托管

49、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售机构之间或证券登记系统内不同会员单位之间进行转托管的行为

50、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记系统间进行转托管的行为

51、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

52、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

53、元：指人民币元

54、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

55、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

56、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

57、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

58、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

59、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

60、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

61、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

62、转融通证券出借业务：指本基金以一定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出借证券，中国证券金融股份有限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

63、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分　基金的基本情况

一、基金名称
华宝中证1000指数证券投资基金

二、基金的类别
股票型证券投资基金

三、基金的运作方式
契约型开放式

四、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。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

五、基金存续期限
不定期

六、标的指数
本基金的标的指数为中证1000指数。

第四部分　基金的历史沿革

一、本基金的历史沿革

华宝中证1000指数证券投资基金由华宝中证1000指数分级证券投资基金转型而来。

华宝中证1000指数分级证券投资基金经中国证监会2015年4月20日《关于准予华宝兴业中证1000指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】664号）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。

华宝中证1000指数分级证券投资基金自2015年5月25日至2015年5月29日进行公开募集，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，《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》于2015年6月4日起正式生效。

华宝中证1000指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于202X年X月X日表决通过了《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》，同意华宝中证1000指数分级证券投资基金取消分级运作机制、由分级基金转为普通指数基金，修改基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配等内容，基金名称相应变更为“华宝中证1000指数证券投资基金”并修订《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》，华宝中证1000指数分级证券投资基金之华宝中证1000份额、华宝中证1000A份额及华宝中证1000B份额均转换为华宝中证1000指数证券投资基金基金份额。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于202X年X月X日正式实施基金转型，自基金转型实施日起，《华宝中证1000指数分级证券投资基金基金合同》失效且《华宝中证1000指数证券投资基金基金合同》同时生效，华宝中证1000指数分级证券投资基金正式变更为华宝中证1000指数证券投资基金。

第五部分　基金的存续

一、基金份额的变更登记

基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金基金份额的更名以及必要信息的变更。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《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5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形之一的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第六部分　基金份额的申购与赎回

本基金基金合同生效后，投资人可通过场外或场内两种方式对基金份额进行申购与赎回。

一、申购和赎回场所

本基金的场外申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。投资人需使用中国证券登记结算有限责任公司（深圳）开放式基金账户办理基金份额场外申购、赎回业务。

办理基金份额场内申购、赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。投资人需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理基金份额场内申购、赎回业务。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购、转托管时基金份额登记的先后次序进行顺序赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待；

6、场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资者账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等损失。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。

投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T＋7日（包括该日）内支付赎回款项。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消失的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

4、基金管理人可以在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务的确认及办理的时间和程序进行调整，并提前公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2、基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3、基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、投资者每个基金交易账户的最低基金份额余额限制、单个投资者累计持有的基金份额上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限、本基金总规模限额和单日净申购比例上限等。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

6、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制等，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、本基金在申购时收取申购费，本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。申购份额的计算方式及余额处理方式详见招募说明书。

3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。

5、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。赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低本基金的申购费率和赎回费率。

8、当本基金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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

9、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

8、指数编制单位或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。

9、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形。

10、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、8、11项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，对于场外赎回申请，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请场外赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

九、巨额赎回的情形及处理方式

（下转D12版）