

# 华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开 华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF) 基金份额持有人大会的第一次提示性公告

华宝基金管理有限公司已于 2025 年 12 月 2 日在《上海证券报》、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二次召开华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(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,现发布关于以通讯方式二次召开华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)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

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”)已以通讯方式组织召开了华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)(基金简称:华宝标普香港上市中国中小盘指数(LOF),场内简称:香港中小LOF,A类基金份额代码:501021,C类基金份额代码:006127;以下简称“本基金”)的基金份额持有人大会(以下简称“第一次持有人大会”),投票期间为2025年8月14日起至2025年8月31日17:00止,审议《关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案》。由于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未达到第一次持有人大会权益登记日基金总份额的二分之一,未达到法定的基金份额持有人大会召开条件,故第一次持有人大会召开失败,详情请阅本基金管理人于2025年9月2日发布的《华宝基金管理有限公司关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会会议情况的公告》。

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《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的

有关规定,《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告》的有关规定,第一次持有人大会未能成功召开的,基金管理人可以在原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,就原定审议事项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)基金份额的持有人参加方可召开。确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

本基金管理人经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式重新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《关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案》,本次大会的权益登记日仍为2025年8月13日(第一次持有人大会权益登记日),权益登记日持有本基金基金份额的基金份额持有人有权参与投票。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:自2025年12月2日起至2026年1月4日17:00止(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57楼

邮政编码:200120

联系人:唐棠

联系电话:400-700-5588, 400-820-5050

通过专人送交、邮寄送达的,请在信封表面注明:“华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决专用”。

## 二、会议审议事项

《关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案》(见附件一)。

上述议案的说明请参见《〈关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案〉的说明》（见附件二）。

### 三、权益登记日

本次会议的权益登记日为2025年8月13日（第一次持有人大会权益登记日），即该日下午交易时间结束后，在本基金登记机构（A类基金份额：中国证券登记结算有限责任公司，C类基金份额：华宝基金管理有限公司）登记在册的全体基金份额持有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录基金管理人网站（[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载并打印或从报纸上剪裁、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，并提供个人投资者有效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，还需提供受托人的有效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，还需提供受托人的有效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，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，还需提供受托人的有效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等，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于前述会议投票表决起止时间内（以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达方式送达至本公告列明的地点，并在信封表面注明：“华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

（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 或 400-820-5050 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。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、权益登记日登记在册的基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，且每一基金份额享有平等的表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，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、无法辨认、意愿无法判断或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，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。

(5) 根据第一次持有人大会的相关公告，基金份额持有人在第一次召集的基金份额持有人大会所投的有效表决票在本次会议时依然有效，但如果基金份额持有人重新进行投票的，则以最新的有效表决票为准。

(6) 授权效力确定规则

1) 最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人多次以有效书面方式授权的，以最后一次书面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次，不能确定最后一次书面授权的，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) 直接表决优先规则

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。

3) 根据第一次持有人大会的相关公告，除非授权文件另有载明，第一次召集的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在本次会议时依然有效，但如果授权方式发生变化或基金份额持有人重新做出授权，则以根据本公告规定的授权效力确定规则确定的最新有效授权为准。

## 六、会议决议生效条件

1、本人直接出具意见或授权他人代表出具意见的，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三分之一（含三分之一）。

2、《关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案》应当经参加本次基金份额持有人大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效。

3、本次基金份额持有人大会的决议，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。

## 七、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 57 楼

联系人：唐棠

联系电话：021-38505888

客户服务电话：400-700-5588、400-820-5050

网址：[www.fsfund.com](http://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：北京市西城区金融大街 25 号

联系电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

3、公证机关：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

## 八、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、本次会议有关公告可通过本基金管理人网站（www.fsfund.com）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 或 400-820-5050 咨询。

3、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

2025 年 12 月 3 日

附件一：《关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案》

附件二：《〈关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案〉的说明》

附件三：《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决票》

附件四：《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人授权委托书》

附件一：

**关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)  
修改基金合同等有关事项的议案**

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(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，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《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)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，提议以通讯方式召开华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会，审议修改基金名称、以港股通模式运作、增加未来条件许可情况下的基金模式转换条款、调整赎回费率有关事项，并相应修改《基金合同》、《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)招募说明书》等法律文件。具体变更方案请见附件二《〈关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案〉的说明》。

为实施本次方案，提议授权基金管理人办理本次《基金合同》修改的有关具体事宜，包括但不限于根据《〈关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案〉的说明》对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，并在实施变更前披露修改后的基金法律文件。

以上议案，请予审议。

华宝基金管理有限公司

2025年12月2日

## 附件二：《关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案》的说明

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)于2016年6月24日成立并正式运作。为更好地满足投资者需求,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《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“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《基金合同》修改等事宜。

《关于华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)修改基金合同等有关事项的议案》应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持份额表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效,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议自表决通过之日起生效。基金管理人自表决通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决议通过后,本基金管理人可根据市场情况确定本基金变更正式实施的具体时间,具体安排将由基金管理人在相关公告中列明。

中国证监会对本次基金份额持有人大会决议的备案,均不表明其对本次合同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。

### 一、基金变更方案要点

#### (一) 修改基金名称

由于标普香港上市中国中小盘指数已变更为港股通指数,本基金拟由QDII基金变更为以港股通形式运作(即仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资),基金名称相应修改为“华宝港股通标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)”。

#### (二) 变更为以港股通形式运作

本基金拟由QDII基金变更为以港股通形式运作,对《基金合同》涉及的投

资、估值、申赎、费用等相关章节内容进行修订，并拟参与融资和转融通证券出借业务，主要修订内容包括：

1、将“第十三部分 基金的投资”中“二、投资范围”、“三、投资策略”和“四、投资限制”调整如下：

#### “二、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、备选成份股、国内依法发行上市的非成份股（包括港股通标的股票和其它中国证监会允许投资的股票）、存托凭证、债券（包括国内依法发行的国债、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）、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证券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的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。

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、备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。本基金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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。”

#### “三、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。

##### 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。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

## 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。

本基金在投资的过程中，造成跟踪误差的原因主要有以下几方面：

- (1) 基金日常运作过程中必须保有一定比例的现金资产；
- (2) 基金投资组合的权重与目标指数的成份股的权重可能在调整周期当中出现不一致；
- (3) 基金补券过程中股票买卖价格与股票收盘价存在差异；
- (4) 各种交易费用及基金运作过程中所产生的费用和开支；
- (5) 成份股红利再投资；
- (6) 换汇过程中使用的实际汇率与估值汇率的差异等。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析，为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。

同时，为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下，开展证券借贷业务以及投资于金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股，使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

## 4、债券投资策略

本基金可适当参与债券投资，目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益，降低基金的跟踪误差。

## 5、可转债投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析的基础上，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，以达到紧密跟踪标的指数的目的。

#### 6、存托凭证投资策略

本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 7、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，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，控制信用风险和流动性风险的前提下，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。

#### 8、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。

#### 9、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。

正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。

本基金将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。

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公告。”

### “四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%；

(3) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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，持有的买入股指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，持有的卖出股指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%；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；

(4) 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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 本基金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；

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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；

(12) 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基金合同约定的投资范围保持一致；

(13) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(14) 本基金参与融资，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%；

(15) 本基金参与转融通证券出借业务的，应当符合下列要求：

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应纳入《流动性规定》所述流动性受限证券的范围；

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%；

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；

(16) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(17) 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 (2)、(8)、(11)、(12)、(15) 项外，因证券/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。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第 (15) 项规定的，基金管理人不得新增出借业务。

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合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。”

2、将“第十五部分 基金资产估值”中“三、估值方法”调整如下：

### “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价格进行估值；

(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价格或推荐估值价格进行估值；

(4) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照估值日第三方估值机构提供的价格估值；

(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。

(6) 对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值价格或推荐估值价格，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。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。

2、处于未上市期间及流通受限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，采用估值技术确定公允价值；首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值；

(3) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的有价证券，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值；

(4) 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、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价格估值。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价格或推荐估值价格估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值价格或推荐估值价格，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（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或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

4、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与基金托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

#### 5、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 6、投资股指期货合约的估值方法

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、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。

8、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

9、本基金参与融资和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。

#### 10、存托凭证的估值

本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

#### 11、汇率

估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

12、税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

13、在任何情况下，基金管理人如采用上述第 1-12 项规定的方法对基金资产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。

14、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。

15、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。

16、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，基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后，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。”

3、将第七部分 基金份额的申购与赎回中“四、申购与赎回的程序”的赎回款项支付时限调整为：

“投资者赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。如遇外汇市场暂停交易、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制、延迟支付赎回款项或交易清算规则发生变更等特殊情形，赎回款项支付时间可相应调整。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。”

4、将第七部分 基金份额的申购与赎回中“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”的第 1 点调整为：

“1、本基金的基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。”

### **(三) 调整未来条件许可情况下的基金模式转换相关内容：**

1、在“第九部分 基金份额持有人大会”的“一、召开事由”中增加如下条款：

“2、在不违背法律法规规定和《基金合同》约定，对基金份额持有人利益无实质性影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

.....

（3）若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》；”

2、在“第十三部分 基金的投资”中增加如下条款：

“七、未来条件许可情况下的基金模式转换

若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人可在履行适当程序后使本基金采取 ETF 联接基金模式进行运作并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会，但须与基金托管人协商一致后履行相关程序并提前公告。”

**（四）基金赎回费率调整：**

根据《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）招募说明书》的约定，本基金的赎回费率设置如下：

“2、赎回费用

本基金 A 类基金份额的赎回费率如下：

持有基金份额期限（Y）	赎回费率
Y<7 日	1.5%
7 日≤Y<6 个月	0.50%
6 个月≤Y<1 年	0.25%
Y≥1 年	0

注：1 年指 365 日

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。对于收取的持续持有期少于 7 日的投资人的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。对于收取的持续持有期大于等于 7 日的投资人的赎回费，基金管理人将赎回费的 25%应当归入基金财产，其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。

本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：

持有基金份额期限	赎回费率 (%)
小于 7 日	1.50%
大于等于 7 日，小于 30 日	0.50%
大于等于 30 日	0%

对 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。”

**调整为：**

“2、赎回费用

本基金 A 类和 C 类份额赎回费率表如下，其中 A 类份额场内赎回费率与场外赎回费率相同。

持有基金份额期限	赎回费率
小于 7 日	1.50%
大于等于 7 日	0%

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。对于收取的持续持有期少于 7 日的投资者的赎回费，基金管理人将其全额计入基金财产。”

**(五) 增加摆动定价机制相关条款**

**(六) 增加侧袋机制相关条款**

**(七) 除上述变更方案要点外，基金管理人将现行法律法规、监管要求及基金实际运作情况一并修改《基金合同》。基金管理人将相应修订更新《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）托管协议》及《华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金（LOF）招募说明书》等法律文件。**

**二、基金管理人对于《基金合同》修改相关情况的说明**

**(一) 历史沿革**

本基金于 2016 年 3 月 29 日获得中国证监会注册批复（证监许可【2016】626 号），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。经中国证监会确认，《基金合同》于 2016 年 6 月 24 日起正式生效。

**(二) 基金变更法律方面的可行性**

本次对《基金合同》的修改事宜符合《基金合同》“第九部分 基金份额持有

人大会”的规定，对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的事项，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。因此，本次基金相应修改《基金合同》不存在法律方面的障碍。

### （三）基金管理人修订基金合同的可行性

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、400-820-5050

网站：[www.fsfund.com](http://www.fsfund.com)



附件四：

华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人  
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 2026 年 1 月 4 日的以通讯方式二次召开的华宝标普香港上市中国中小盘指数  
证券投资基金(LOF)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。

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）：

委托人基金账户号/证券账户号：

受托人（代理人）姓名/名称（签字/盖章）：

受托人（代理人）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）同一基金份额持有人拥有多个基金账户号/证券账户号且需要按照不同账  
户持有基金份额分别授权的，应当填写基金账户号/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，以上授权将被视为是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额向代理人  
所做授权。