

## 汇添富基金管理股份有限公司

### 关于召开上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金 基金份额持有人大会第二次提示性公告

就上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金召开基金份额持有人大会事宜，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）已于 2019 年 6 月 6 日在《证券时报》和基金管理人网站（www.99fund.com）发布了《汇添富基金管理股份有限公司关于召开上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式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，现发布关于召开上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式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、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《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“上海改革发展 ETF”或“本基金”）的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以现场方式召开上海改革发展 ETF 的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

- （一）会议召开时间：2019 年 7 月 8 日上午 9:30
- （二）会议召开方式：现场方式
- （三）会议召开地点：上海市富城路 99 号震旦大厦 20 楼

#### 二、会议审议事项

本次会议审议事项为《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》（见附件一）。

#### 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2019 年 7 月 4 日，即在 2019 年 7 月 4 日交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的上海改革发展 ETF 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。

#### **四、会议的议事程序和表决方式**

(一) 大会主持人宣布会议开始。

(二) 大会主持人宣布出席会议的基金份额持有人和代理人人数及所持有基金份额的总数、占权益登记日基金总份额的比例。

(三) 大会主持人宣布会议议事程序及注意事项。

(四) 大会主持人公布监票人（包括召集人授权的一名监督员和从出席会议的基金份额持有人及代理人中选举的两名监票人）、见证律师、公证机关和公证员。

(五) 大会主持人宣读议案。

(六) 与会人员对议案进行审议讨论，并以提交表决票（见附件二）的方式进行表决。

(七) 监票人在基金份额持有人表决后立即进行清点，公证员对计票过程予以公证。

(八) 大会主持人当场公布计票结果。

(九) 公证员宣读公证词。

(十) 大会见证律师就本次会议召开的程序以及持有人大会形成的决议的合法性、合规性发表法律意见。

#### **五、基金份额持有人出席会议需要准备的文件**

(一) 个人基金份额持有人出席会议的，需要提交本人开立持有上海改革发展 ETF 基金份额的基金账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）原件及正反面复印件。

(二) 个人基金份额持有人委托他人出席会议的，需要提交基金份额持有人签字的授权委托书（见附件三）和基金份额持有人开立持有上海改革发展 ETF 基金份额的基金账户所使用的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身

份的有效证件或证明)正反面复印件。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托人的加盖公章(如有)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(如有)的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)和代表单位出席会议的个人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件及单位授权委托书(出席的受托人非法定代表人的,提供加盖公章(如有)的授权委托书;出席的受托人为法定代表人的,提供加盖公章(如有)的法定代表人身份证明书)。

(三)机构基金份额持有人出席会议的,需要提交该机构开立持有上海改革发展ETF基金份额的基金账户所使用的加盖单位公章(如有)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单位公章(如有)的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)和代表单位出席会议的个人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件及单位授权委托书(出席的受托人非法定代表人的,提供加盖公章(如有)的授权委托书(见附件三);出席的受托人为法定代表人的,提供加盖公章(如有)的法定代表人身份证明书)。

(四)机构基金份额持有人委托他人出席会议的,需要提交基金份额持有人加盖公章(如有)的授权委托书(见附件三)和持有人开立持有上海改革发展ETF的基金账户所使用的加盖单位公章(如有)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单位公章(如有)的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托人的加盖公章(如有)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(如有)的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)和代表受托机构出席会议的个人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件及单位授权委托书(出席的受托人非法定代表人的,提供加盖公章(如有)的授权委托书;出席的受托人为法定代表人的,提供加盖公章(如有)的法定代表人身份证明

书)。

(五) 合格境外机构基金份额持有人出席会议的, 需要提交该机构开立持有上海改革发展 ETF 基金份额的基金账户所使用的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件、取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和代表机构出席会议的个人的有效身份证件原件及正反面复印件, 以及该合格境外机构投资者签署的授权委托书或者证明该个人有权代表该合格境外机构投资者出席会议的其他证明文件。

(六) 合格境外机构基金份额持有人委托他人出席会议的, 需要提交该合格境外机构投资者签署的授权委托书(见附件三)和该机构开立持有上海改革发展 ETF 基金份额的基金账户所使用的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件、取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。如受托人为个人, 还需提供受托人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件; 如受托人为机构, 还需提供受托人的加盖公章(如有)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(如有)的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)和代表受托机构出席会议的个人的身份证件(包括身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)原件及正反面复印件及单位授权委托书(出席的受托人非法定代表人的, 提供加盖公章(如有)的授权委托书; 出席的受托人为法定代表人的, 提供加盖公章(如有)的法定代表人身份证明书)。

## 六、会议出席对象

(一) 权益登记日登记在册的上海改革发展 ETF 的基金份额持有人或其代理人。

(二) 基金管理人代表。

(三) 基金托管人代表。

(四) 基金管理人聘请的见证律师。

(五) 基金管理人聘请的公证机关人员。

## 七、会议的预登记

(一) 预登记时间：2019年6月19日至2019年7月3日，每个工作日上午9:00至下午4:00。基金管理人将为基金份额持有人办理现场方式预登记或传真方式预登记。

(二) 现场方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人采用现场方式进行预登记的，应当按照本公告第五条的规定提供相关资料。

现场方式预登记地址：上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼，汇添富基金管理股份有限公司直销中心；联系人：陈卓膺。

(三) 传真方式预登记：在预登记时间内，基金份额持有人可凭本公告第五条规定需提供的相关资料的传真件向基金管理人进行预登记，传真号为(021) 50199035 或 (021) 50199036，确认电话为(021) 28932893，传真收件人为：陈卓膺。

(四) 关于预登记的说明：基金管理人可以通过预登记估计持有人到会情况，以便为持有人大会召开进行相应准备，请各基金份额持有人予以积极配合。持有人大会会议入场前仍需按照本公告第五条的规定提供相关资料办理现场会议登记，未能按时依据本公告第五条的规定及重要提示出示及提供相关资料的，不能入场出席会议并表决。

## 八、会议召开的条件

亲自出席会议者持有基金份额持有人的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和本公告的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

## 九、会议的计票

(一) 主持人在会议开始后，宣布在出席会议的基金份额持有人及代理人中选举两名基金份额持有人代表与基金管理人授权的一名监票人共同担任监票人。

(二) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(三) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对投票数进行重新清点;如会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有怀疑,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,重新清点仅限一次。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(四) 计票过程由公证机关予以公证。

## 十、会议决议的条件

(一) 上海改革发展 ETF 基金份额持有人持有的每一份基金份额拥有同等的投票权。

(二) 基金份额持有人应在表决票(见附件二)上填写“同意”、“反对”或者“弃权”。

(三) 基金份额持有人虽提供了符合本会议公告规定的文件,但表决票未填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利,其所持份额数的表决结果均计为“弃权”,其所代表的基金份额仍作为有效票,计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(四) 本次议案如经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二(含三分之二)通过,且中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“上海国企 ETF”)基金份额持有人大会通过《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》后方为有效,即视为表决通过。

(五) 基金份额持有人大会表决通过的事项,将由本基金管理人在自通过之日起 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持有人大会表决通过之日起生效。

## 十一、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》的规定,本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的有效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。

## 十二、本次持有人大会相关机构

- 1、召集人（基金管理人）：汇添富基金管理股份有限公司
- 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
- 4、见证律师：上海市通力律师事务所

## 十三、重要提示

（一）本次会议将于 2019 年 7 月 8 日上午 9:30 召开，届时基金管理人、基金托管人和基金管理人聘请的见证律师、公证机关人员将对与会人员资格的合法性进行审查并予以登记，请出席会议人员务必按照本公告的要求，携带必需的文件到达会议地点，以便验证入场。

（二）基金份额持有人应当保持会议秩序，服从召集人的引导，除出席会议的基金份额持有人（或代理人）、会务人员、聘任律师和公证机构及召集人邀请的人员以外，召集人有权依法拒绝其他人士入场，对于干扰基金份额持有人大会秩序、寻衅滋事和侵犯其他基金份额持有人合法权益的行为，召集人有权采取措施加以制止并及时报告有关部门查处。

（三）特别提醒各位基金份额持有人在预登记及会议现场登记时，需要提供的是开立持有上海改革发展 ETF 基金份额的基金账户所使用的相关证件及（或）其复印件，如若开立有多个账户且使用的是不同的证件，需要分别提供各账户对应的相关证件及（或）其复印件。

（四）如基金份额持有人授权他人出席本次大会后，又亲自出席本次大会进行投票表决的，以其本人亲自投票的表决意见为准。

（五）基金管理人将在基金份额持有人大会召开前发布提示性公告，就基金

份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

(六) 本公告的有关内容由汇添富基金管理股份有限公司解释。

#### 十四、会务常设联系人姓名及联系电话

持有人可通过以下方式联系召集人（基金管理人）获取相应信息：

联系机构：汇添富基金管理股份有限公司客服中心

联系电话：400-888-9918

Email: service@99fund.com

公司网站: www.99fund.com

会务常设联系人：陈卓膺

联系电话：(021) 28932893

传真：(021) 50199035 或 (021) 50199036

电子信箱: chenzhuoying@htffund.com

汇添富基金管理股份有限公司

二〇一九年六月十一日

附件一：《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》

附件二：《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式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：《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并方案说明书》

附件一：

关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题  
交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案

上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金份额持有人：

为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，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《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议将上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金与中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金合并。具体合并方案的情况说明详见附件四《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并方案说明书》。

为实施上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金与中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的合并方案，提议授权基金管理人办理本次合并方案的具体有关事宜。

以上议案，请予审议。

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

二〇一九年六月十一日

附件二：

上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金  
基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称： \_\_\_\_\_

证件号码（身份证件/营业执照）： \_\_\_\_\_

证券账户账号/基金账户卡号： \_\_\_\_\_

持有基金份额数量： \_\_\_\_\_

如为受托出席会议并表决的，请填写：

受托人的姓名/名称： \_\_\_\_\_

受托人证件号码（身份证件/营业执照）： \_\_\_\_\_

审议事项	表决结果		
关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案	<input type="checkbox"/> 同意	<input type="checkbox"/> 反对	<input type="checkbox"/> 弃权

基金份额持有人/受托人签名或盖章

2019 年 月 日

说明：

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见。

2、以上表决意见是持有人或其受托人就持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。

3、表决票未填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持份额数的表决结果均计为“弃权”。

4、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印，亦可在会议现场领取。

附件三：

授权委托书

兹全权委托 先生/女士/公司单位代表本人或本机构出席于 2019 年 7 月 8 日以现场方式召开的上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

若在规定时间内就同一议案重新召开上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人姓名或名称：

委托人证件号码（身份证件/营业执照）：

证券账户账号/基金账户卡号：

受托人姓名或名称：

受托人证件号码（身份证件/营业执照）：

委托人签字/盖章：

签署日期：2019 年 月 日

说明：

- 1、页末签字栏中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。
- 2、以上授权是持有人就其持有的本基金全部份额向受托人所做授权。
- 3、其他签字栏请视情形选择填写，凡适合的栏目均请准确完整填写。
- 4、持有人多次授权，且能够区分先后次序的，以最后一次授权为准；持有人多次授权，无法区分授权次序的，视为同意其授权的机构之一为受托人。
- 5、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。

#### 附件四：

### 中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并方案说明书

#### 一、声明

1、为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，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》（以下简称“《运作办法》”）和《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金（以下简称“上海改革发展 ETF”或“本基金”）的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会变更注册申请，决定召开基金份额持有人大会，讨论并审议《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》。

2、本次基金份额持有人大会需由持有有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）的持有人出席方可召开，且《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》需经参加本次持有人大会表决的基金份额持有人（或代理人）所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过，同时，中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“上海国企 ETF”）基金份额持有人大会通过《关于中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并有关事项的议案》后方为有效，因此存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

## 二、上海改革发展 ETF 与上海国企 ETF 合并方案要点

### （一）集中赎回期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，上海改革发展 ETF 将安排 20 个交易日的集中赎回期（具体以基金管理人届时发布的公告为准）。集中赎回期内，上海改革发展 ETF 的赎回业务以及场内交易业务均照常办理。

基金份额持有人在集中赎回期内可选择卖出或赎回持有的上海改革发展 ETF 份额，对于在集中赎回期内未作出选择的基金份额持有人，其持有上海改革发展 ETF 的基金份额将于份额转换基准日进行转换，最终转换为上海国企 ETF 的基金份额。

在集中赎回期期间，上海改革发展 ETF 仍按照基金合同约定的运作方式进行运作，但由于上海改革发展 ETF 需应对赎回等情况，基金管理人提请基金份额持有人同意在集中赎回期内豁免本基金《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。

### （二）调仓期的相关安排

集中赎回期后，上海改革发展 ETF 进入 10 个交易日的调仓期，基金管理人将对上海改革发展 ETF 暂停申购、赎回、场内交易等业务的办理，同时对上海改革发展 ETF 的投资组合进行调整，因此，为了更好的实施基金合并方案，基金份额持有人同意在集中赎回期后、正式实施合并前及合并操作过程中豁免上海改革发展 ETF 基金合同中约定的投资组合比例限制、投资策略等相关投资条款，并且同意在极端行情市场流动性不足的情况下基金管理人有权适当调整调仓期。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以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、场内交易等业务的办理。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

### （三）基金份额的转换

基金管理人可根据上海改革发展 ETF 的投资组合调整情况确定份额转换基准日。基金管理人在份额转换基准日将上海改革发展 ETF 的基金份额转换成上海国企 ETF 的基金份额。转换后，投资者持有的上海国企 ETF 的基金份额数 = 上海改革发展 ETF 的基金份额数 × 份额转换基准日上海改革发展 ETF 的基金份额净值 / 份额转换基准日上海国企 ETF 的基金份额净值。

为保证持有人利益，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人制定基金份额转换规则并仅在份额转换环节根据实际情况提高份额转换基准日所依据的基金份额净值精度，详细基金份额转换说明及规则见届时相关公告。

#### （四）上海改革发展 ETF 的后续安排

自份额转换基准日次日起，上海改革发展 ETF 终止上市。在上海改革发展 ETF 与上海国企 ETF 完成资产合并和份额转换后，原《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》失效，在份额转换基准日登记在册的上海改革发展 ETF 的基金份额持有人成为上海国企 ETF 的基金份额持有人，并成为《中证上海国企交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》的当事人。

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在本次基金份额持有人大会决议生效后，按照上海证券交易所的业务规则申请上海改革发展 ETF 终止上市等业务。

#### （五）合并及合并完成后基金资产的运作

从份额转换基准日起，上海改革发展 ETF 与上海国企 ETF 进入合并操作，基金管理人将完成上海改革发展 ETF 基金份额的变更登记、2 只基金资产的合并以及 2 只基金会计账簿的合并等基金合并相关的必须操作。基金管理人可以根据本次基金合并拟采取的技术方案，确定基金份额的变更登记、资产合并以及会计账簿合并的时间点。

本次基金合并完成后，原上海改革发展 ETF 的基金资产将与原上海国企 ETF 的基金资产合并构成新的上海国企 ETF 的基金资产进行运作。

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法律法规的规定及《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金与上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金合并方案说明书》以上合并方案要点实施合并方案。

### 三、基金管理人就合并方案相关事项的说明

#### （一）上海改革发展 ETF 的历史沿革

上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金已于 2017 年

3月1日经中国证监会《关于准予上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】302号）准予注册募集，并于2017年10月26日获得中国证监会证券基金机构监管部《关于同意上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金延期募集备案的函》（机构部函【2017】2461号）。

上海改革发展ETF于2017年11月22日至2017年11月24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，2017年12月1日《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》生效。

## （二）基金合并的可行性

### 1、基金合并不存在法律障碍

《中华人民共和国证券投资基金法》第七十八条规定，“按照基金合同的约定或者基金份额持有人大会的决议，基金可以转换运作方式或者与其他基金合并”。

《中华人民共和国证券投资基金法》第八十六条规定，“基金份额持有人大会应当有代表二分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的，召集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基金份额的持有人参加，方可召开。

基金份额持有人大会就审议事项作出决定，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过；但是，转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。”

《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十九条也规定，“基金转换运作方式或者与其他基金合并，应当按照法律法规及基金合同约定的程序进行。实施方案若未在基金合同中明确约定的，应当经基金份额持有人大会审议通过。基

金管理人应当提前发布提示性通知，明确有关实施安排，说明对现有基金份额持有人的影响以及基金份额持有人享有的选择权（如赎回、转出或者卖出），并在实施前预留至少二十个开放日或者交易日供基金份额持有人做出选择”。

《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》“第十部分 基金份额持有人大会”中“一、召开事由”规定：

“1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会规定或基金合同另有约定的除外：

……

（7）本基金与其他基金的合并；”

“第十部分 基金份额持有人大会”中“六、表决”规定：“

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除《基金合同》另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。”

因此，上海改革发展 ETF 与上海国企 ETF 的合并不存在法律方面的障碍。

## 2、基金合并不存在技术障碍

上海改革发展 ETF 与上海国企 ETF 合并，将同时进行基金份额的变更登记和基金财产的合并。上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司及其上海分公司和基金管理人已就本次基金合并有关事项进行了充分准备，技术可行。在完成合并后，原上海改革发展 ETF 的基金份额持有人可在上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间按照《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定办理申购、赎回以及场内交易等业务，因此不会导致基金份额持有人无法变现基金份额的情况发生。本次基金合并不存在技术障碍。

### （三）上海改革发展 ETF 发起式资金的安排

上海改革发展 ETF 是发起式基金，在募集期间，基金管理人运作自有资金认购 10,000,000.00 份基金份额，并承诺发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。该部分发起资金一并转入并折算为上海国企 ETF 的基金份额，按照上海改革发展 ETF 的基金成立日，即从 2017 年 12 月 1 日计算，至少持有至 2020 年 12 月 1 日。

#### 四、基金合并的主要风险及预备措施

##### （一）合并方案被持有人大会否决的风险及预备措施

在设计合并方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金合并方案进行适当的修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

##### （二）集中赎回期内的流动性风险及预备措施

在持有人大会决议生效后，上海改革发展 ETF 进入集中赎回期，在投资者提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。针对上述情形，基金管理人将审慎设置“必须现金替代”股票以及当日的赎回上限，确保在赎回上限内的投资者赎回申请正常受理。

##### （三）不能及时完成调仓的风险及预备措施

集中赎回期结束后，基金管理人将对上海改革发展 ETF 的投资组合进行调整，在调整过程中，可能会面临由于成份股停牌或流动性差等原因使上海改革发展 ETF 无法在 10 个交易日内完成调整的风险。为了使得上海改革发展 ETF 资产并入上海国企 ETF 的冲击尽量小，上海改革发展 ETF 尽量在调仓期内调整投资组合使其接近上海国企指数，也是为了更好保护上海国企 ETF 持有人利益不受损，如果遇到极端行情市场流动性不足，基金管理人有权适当调整调仓期。

##### （四）上海改革发展 ETF 折算过程中投资者资产损失的风险及预备措施

在折算过程中可能会存在由于估值精度以及四舍五入等问题，导致投资者折算后持有的基金资产金额与折算前的基金资产金额有一定差额。针对上述情形，基金管理人将提高这 2 只 ETF 在份额转换基准日的估值精度，尽可能降低折算前后投资者持有的基金资产差额。

（五）上海改革发展 ETF 折算过程中投资者无法查询基金份额和基金份额净值的风险

由于在份额折算过程中，上海改革发展 ETF 会同时办理基金的摘牌退市和基金份额的退登记工作，将导致投资者从份额折算基准日当天晚上至份额折算全部完成的时间内，无法查询原有基金份额和基金份额净值。在完成份额折算后，

基金管理人将及时公告折算结果，并按照《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定披露基金份额净值。

#### （六）基金合并后运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金合并后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

### 五、风险提示

#### 1、合并过程中，上海改革发展 ETF 暂停申赎、交易、估值的风险

由于本基金在实施合并方案的过程中，基金管理人会根据相关法律法规和实际情况暂停申购、赎回或场内交易业务，以及暂停基金估值，投资者会在一定期间内无法赎回持有的上海改革发展 ETF 基金份额，或无法查看持有的基金份额及净值。

#### 2、合并实施前后的规模波动风险

由于基金合并属于基金重大变更事项，可能会存在合并实施前后，基金规模波动的风险。

#### 3、合并方案实施后因份额折算导致持有人持有基金份额数量变化的风险

本次基金合并方案中，涉及上海改革发展 ETF 基金份额折算为上海国企 ETF，由于在份额转换基准日当天，两只基金的基金份额净值存在差异，可能存在折算后的上海国企 ETF 基金份额数量少于原上海改革发展 ETF 持有的基金份额数量，甚至有可能小于上海国企 ETF 的最小申购赎回单位，那么投资者面临持有的基金份额只能在场内卖出，不能赎回的风险。

#### 4、合并后跟踪指数变化而发生的投资范围、投资策略变化的风险

本基金在完成合并后，原上海改革发展 ETF 的基金份额持有人将成为《中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的当事人，相较上海改革发展 ETF 的投资安排，跟踪标的指数发生变化导致投资范围、投资策略变化。

5、上海改革发展 ETF 作为融资融券担保物，在基金合并过程中名义价值暂时显著降低从而间接导致该等投资者经济损失的风险

上海改革发展 ETF 若被作为融资融券担保物的，在本次基金合并操作过程中，发生上海改革发展 ETF 暂停交易、暂停估值、份额转换等情形的，将导致

其作为担保物的名义价值显著降低，造成担保物价值与其融资融券债务之间的比例低于维持担保比例，融资融券客户将可能被证券公司要求追加担保物，如无法按照融资融券业务约定的时间、数量追加担保物时，将可能面临担保物被证券公司强制平仓的风险，进而可能会给该等投资者造成经济损失。

6、上海改革发展 ETF 不纳入股票质押回购的补充质押物和约定式购回证券交易标的证券的风险

本次持有人大会决议生效后，上海改革发展 ETF 将申请摘牌退市，为了保护持有人利益，本基金将不申请纳入股票质押回购的补充质押物和约定购回式证券交易的标的证券。因此投资者面临无法将上海改革发展 ETF 作为补充质押物以及用于约定式购回证券交易业务的风险。