

西部利得基金管理有限公司
关于以通讯方式召开西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资
基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

西部利得基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于 2019 年 12 月 6 日在基金管理人网站（<http://www.westleadfund.com/>）发布了《西部利得基金管理有限公司关于以通讯方式召开西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金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召开西部利得中证 500 等权重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。

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》等法律法规的规定和《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的约定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议修改西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“500 等权重”）基金合同等相关事宜，会议召开的具体如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2019 年 12 月 12 日上午 9:00 起，至 2020 年 1 月 6 日下午 17:00 止（纸质表决票送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：西部利得基金管理有限公司基金份额持有人大会投票处

地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 层

邮政编码：200127

联系电话：400-700-7818（全国免长途话费）

请在信封表面注明：“西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于修改西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同修改方案说明书》（见附件四）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2019 年 12 月 11 日，即 2019 年 12 月 11 日交易时间结束后（暨下午 15:00 后），在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括 500 等权重份额、500 等权重 A 份额和 500 等权重 B 份额的基金份额持有人）或其授权的代理人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议纸质表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录本基金管理人网站（www.westleadfund.com）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（亲笔签字或使用个人印鉴），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经授权的业务章（以下合称“公章”），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事业单位法人登记证书、有权部门的批文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单位公章（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身份证件正反面复印件或者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，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）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定，授权其他个人或机构代表其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告第五条“（三）授权方式”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件；

（4）以上各项中的证件、公章、批文及登记证书等，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纸质表决票和所需的相关文件自 2019 年 12 月 12 日起，至 2020 年 1 月 6 日 17:00 以前通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至下述收件人，请在信封表面注明：“西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”：

收件人：西部利得基金管理有限公司基金份额持有人大会投票处

办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 11 层

邮政编码：200127

联系电话：400-700-7818（全国免长途话费）

投票表决时间以本基金管理人收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以本基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

投票涉及的快递费用由投票人承担。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书，待申购申请确认后，授权委托书自动有效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以登记机构的登记为准。

（二）受托人（代理人）

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面方式授权受托人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（www.westleadfund.com）等方式获取授权委托书样本。

1、基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

（1）个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署授权委托书原件（参见附件三的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件正反面复印件。如受托人为机构，还需提供该受托人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

（2）机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（参见附件三的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构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事业单位法人登记证书、有权部门的批文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明文件正反面复印件。如受托人为机构，还需提供该受托人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文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，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（参见附件三的样本），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。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件正反面复印件；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事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

(3) 以上(1)、(2)项中的公章、批文及登记证书等，以基金管理人的认可为准。

2、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额持有人持有的全部基金份额存在多次有效纸面方式授权，且能够区分授权次序的，以时间在最后的一次授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间有多次有效纸面方式授权的，以表示具体表决意见的纸面授权为准；最后时间收到的多次纸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，视为无效授权。

(2) 基金份额持有人以非纸面方式进行授权的，为无效授权。

(3) 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，视为无效授权。

(4) 如委托人既进行了授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

六、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基金托管人（兴业银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日（即2020年1月6日）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。如监督人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、基金份额持有人持有的每一份基金份额拥有一票表决权。

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本公告规定的收件人的，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、字迹模糊不清、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) 如表决票上的签字或盖章不完整、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本公告规定的收件人的，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，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；快递送达的，以本基金管理人签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

七、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有效表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日 500 等权重份额、500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额各自份额的二分之一（含二分之一）；

2、《关于修改西部利得中证 500 等权重分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》应当由提交有效表决意见的 500 等权重份额、500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额的各自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）通过方为有效；

3、本基金份额持有人大会决议自持有人大会表决通过之日起生效，基金管理人依法将决议报中国证监会备案。法律法规另有规定的，从其规定。

八、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，在基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日 500 等权重份额、500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额各自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。

九、本次大会相关机构

1、召集人（基金管理人）：西部利得基金管理有限公司

联系人：陈眉媚

联系电话：400-700-7818（全国免长途话费）

电子邮件：service@westleadfund.com

网站：www.westleadfund.com

2、基金托管人：兴业银行股份有限公司

联系人：赵欣

联系方式：18221186081

3、公证机关：上海市普陀公证处

联系人：黄彦

联系方式：021-52562233-351

4、律师事务所：上海源泰律师事务所

联系人：刘佳

联系方式：021-51150298

注册及办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

联系电话：（021）51150298

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交纸质表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、为了保护基金份额持有人的利益，加强交易风险警示，维护市场平稳，基金管理人已于 2019 年 12 月 6 日自开市起暂停 500 等权重份额（基金代码：502000，场内简称：500 等权）、500 等权重 A 份额（基金代码：502001，场内简称：500 等权 A）及 500 等权重 B 份额（基金代码：502002，场内简称：500 等权 B）的交易，并于 2019 年 12 月 9 日开市恢复交易。同时，上述三类份额于基金份额持有人大会会计票日（2020 年 1 月 7 日）自开市起暂停交易，并将于下一交易日（2020 年 1 月 8 日）开市恢复交易。

3、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，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、上述基金份额持有人大会有关公告可通过西部利得基金管理有限公司网站（www.westleadfund.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热线 400-700-7818（全国免长途话费）咨询。

5、本基金份额持有人大会召开期间，本基金日常申购赎回业务照常进行，投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。

6、本公告的有关内容由西部利得基金管理有限公司负责解释。

特此公告。

附件一：《关于修改西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》

附件二：《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额持有人大会授权委托书》

附件四：《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同修改方案说明书》

西部利得基金管理有限公司

2019年12月9日

附件一：

**关于修改西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金
基金合同有关事项的议案**

西部利得中证500等权重指数分级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》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，提议根据《西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金基金合同修改方案说明书》的相关内容对本基金基金合同进行修改，修改内容包括本基金的基金名称、基金类别、运作方式、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、投资限制、估值对象、估值方法、收益分配原则等相关事项，将“西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金”变更为“西部利得中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”。

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办理本次基金合同修改的有关具体事宜，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。

以上提案，请予审议。

西部利得基金管理有限公司

2019年12月6日

附件二：

西部利得中证 500 等权重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/统一社会信用代码）			
基金账号/上海证券账户号			
审议事项：关于修改西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案			
表决结果	同意	反对	弃权
基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章			
年 月 日			
说明： 1、请以“√”标记在审议事项后标明表决意见。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持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选、字迹模糊不清、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”。表决票上的签字/盖章不完整、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本公告规定的收件人的，将视为无效表决。 2、同一基金份额持有人拥有多个基金账号/上海证券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，应当填写基金账号/上海证券账户号，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西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金全部份额。 3、同一持有人在同一基金账号/上海证券账户号中持有 500 等权重不同份额类别，纸质投票上的表决意见默认适用于所持有的全部类别的基金份额。 4、本表决票可从相关网站（ www.westleadfund.com ）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。			

附件三：

西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金份额持有人大会
授权委托书

兹委托 先生/女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2020 年 1 月 6 日的以通讯开会方式召开的西部利得中证 500 等权重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。前述授权有效期自委托人签字或盖章之日起至本次基金份额持有人大会结束之日止。若本基金二次召集审议相同议案的持有人大会，则本授权继续有效。前述授权有效期至二次召集基金份额持有人大会会议结束之日止。

委托人姓名/名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/统一社会信用代码）：

受托人姓名/名称（签字/盖章）：

受托人证件号码（身份证件号/统一社会信用代码）：

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

- 1、基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。
- 2、以上授权是基金份额持有人就其在权益登记日持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。
- 3、同一基金份额持有人拥有多个基金账号/上海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，应当填写基金账号/上海证券账户号，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 500 等权重所有份额。
- 4、本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。
- 5、如本次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。

附注：基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（www.westleadfund.com）等方式获取授权委托书样本，在填写完整并签字/盖章后有效。

附件四：

西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金基金合同 修改方案说明书

一、重要提示

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）有关规定，基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于修改西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

2、本次《关于修改西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》需经参加大会的各类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，因此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。

3、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，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”或“500等权重”）持有人大会决议的备案，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、调整方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“西部利得中证500等权重指数分级证券投资基金”变更为“西部利得中证500指数增强型证券投资基金（LOF）”。

（二）取消设置基金份额的分级、折算与合并分拆等机制

本基金取消分级运作机制。在基金份额持有人大会审议通过后，500等权重A份额、500等权重B份额将根据转型方案的约定全部转换为西部利得中证500指数增强型证券投资基金（LOF）份额，因而也不再设置基金份额的分级、折算、合并分拆等机制。

（三）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，500 等权重将在转型正式实施前安排选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转出或者卖出），具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

选择期期间，500 等权重份额的交易、赎回，500 等权重 A 份额与 500 等权重 B 份额的交易、合并业务照常办理，不受影响；500 等权重的申购、分拆、定期定额投资及转托管业务（包含系统内转托管及跨系统转托管）将暂停，具体恢复时间详见基金管理人届时发布的相关公告。基金份额持有人在 500 等权重正式实施转型前，可选择卖出 500 等权重份额、500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额或赎回 500 等权重份额，对于在选择期内未做出选择的基金份额持有人，其持有的 500 等权重份额、500 等权重 A 份额或 500 等权重 B 份额将于份额转换基准日进行转换，最终将转换为西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）份额。在选择期期间，由于 500 等权重份额需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免 500 等权重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、转出或调整赎回方式等。

（四）基金份额的转换

本次基金份额的转换主要可分成以下两个步骤进行：

1、将 500 等权重 A 份额与 500 等权重 B 份额转换成 500 等权重份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以 500 等权重份额的基金份额净值为基准，500 等权重 A 份额、500 等权重 B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成 500 等权重份额的场内份额。500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）基金份额持有人持有的转换后 500 等权重份额的场内份额在折算过程中产生的不足 1 份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统随机排列。中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统按照排列顺序，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。

份额转换计算公式如下：

500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的转换比例=份额转换基准日 500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的基金份额净值/份额转换基准日 500 等权重份额的基金份额净值

500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）基金份额持有人持有的转换后 500 等权重份额的场内份额=基金份额持有人持有的转换前 500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的份额数×500 等权重 A 份额（或 500 等权重 B 份额）的转换比例

2、将 500 等权重份额转换成西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）份额

在 500 等权重 A 份额与 500 等权重 B 份额转换为 500 等权重份额的场内份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将 500 等权重份额的场内份额和场外份额统一转换为份额净值为 1.0000 元的西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）份额。基金份额转换后，场外的西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的份额数，保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金资产，场内份额折算过程中产生的不足 1 份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统随机排列。中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统按照排列顺序，依次均登记为 1 份，直至完成全部折算。

份额转换的计算公式如下：

转换后西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的份额数=500 等权重份额数×份额转换基准日 500 等权重份额的基金份额净值/1.0000

转换后西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）的份额净值为 1.0000 元。

上述具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（五）基金合同的生效

自本基金基金份额转换完成之日起，《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》同时失效，西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金正式变更为西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）。上述具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（六）修改基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征

1、修改基金的投资目标

原文为：

“本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对中证 500 等权重指数的有效跟踪。力争将本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的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，以分享中国经济的长期增长成果，实现基金资产的长期增值。”

拟修改为：

“本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。”

2、修改基金的投资范围

原文为：

“投资于具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（不含中小企业私募债）、债券回购、资产支持证券、权证、央行票据、货币市场工具、银行存款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（但需符合中国证监会的相关规定）。其中，中证 500 等权重指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%，现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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。”

拟修改为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、国债、

央行票据、金融债、地方政府债、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、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)。

本基金可以参与融资和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：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更基金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。”

3、修改基金的投资策略

原文为：

“本基金主要采用完全复制法，按照在中证 500 等权重指数中的成份股的构成及其基准权重构建股票投资组合，以拟跟踪中证 500 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1、资产配置策略

本基金管理人主要按照中证 500 等权重指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定

各类资产的具体配置比例。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

2、股票投资策略

(1) 股票组合构建原则

本基金通过复制指数的方法，根据中证 500 等权重指数成分股组成及其基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 500 等权重指数的效果可能带来影响时，基金管理人将根据市场情况，采取合理措施控制基金的跟踪误差。

在特殊情况下，本基金将选择其他股票或股票组合对标的指数中的股票加以适当替换，这些情况包括但不限于以下情形：

- 1) 法律法规的限制；
- 2) 标的指数成份股流动性严重不足，或因受股票停牌的限制等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股；
- 3) 本基金资产规模过大导致本基金持有某些股票比例过高；
- 4) 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
- 5) 预期标的指数的成份股即将调整。

为了减小跟踪误差，本基金按照主营业务相近、市值相近、相关性较高及 β 值相近等原则来选择替代股票。

(2) 股票组合调整方法

本基金将采用完全复制法构建股票投资组合，根据中证 500 等权重指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。同时，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发等因素的变化，对股票投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与中证 500 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

3、债券投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。
本基金对债券进行配置的原则是：安全性与流动性优先，且兼顾收益性。

本基金在满足安全性与流动性的前提下，通过对国内外宏观经济形势的把握和系统分析国内财政政策与货币市场政策等因素变化对债券市场的影响，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合，进行个券选择。”

拟修改为：

“本基金以中证 500 指数为标的指数，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，结合“自下而上”的选股方式对投资组合进行积极的管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。

本基金可以将标的指数成份股及备选股之外的股票纳入基金股票池，并构建主动型投资组合。

1、大类资产配置策略

本基金采取积极的大类资产配置策略，通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，实现投资组合动态管理最优化。

2、股票投资策略

本基金采取指数复制结合相对增强的投资策略，在严格控制偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。

（1）指数复制策略

本策略采取全样本复制的方式，按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合。

1) 被动型投资组合的构建

基金管理人将根据标的指数的成份股和备选股及其权重进行相应的买卖操作，使得被动型投资组合的构建与标的指数基本一致。若出现较为特殊的情况(例如成份股或备选成股流动性不足等)，本基金将采用替代性的方法构建被动型投资组合，使得被动型投资组合尽可能跟踪标的指数，减小跟踪误差。

2) 被动型投资组合的调整

本基金为开放式基金，由于开放日基金的申购、赎回、转换等业务对标的指数跟踪带来的影响，标的指数成份股及备选成份股的定期或不定期调整以及相应权重的调整等影响，使得被动型投资组合需要适时进行个股或权重的调整。

3) 风险估测模型

指数化投资力求跟踪误差最小，主动性投资则需要适度风险预算的支持。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，将投资组合风险有效控制在预算范围内。

本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于标的指数的偏离风险。

本基金对标的指数的跟踪目标是力争使基金份额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%，年跟踪误差不超过 7.75%。

(2) 指数增强策略

本策略以国际市场上广泛认可的多因子模型框架为基础，结合中国股票市场的特定规律筛选有效因子，对因子进行多角度评价后构建多因子模型，并根据市场流动性、基金规模、因子衰减速度等因素进行组合优化，构建股票投资组合。

1) 筛选有效因子

通过对投资理论的理解，对中国市场特定规律的研究，本基金管理人从市场可获得的公开大数据中寻找出对股票收益率有预测能力的因子，经过全面且深入的因子剖析后提炼出可靠因

子，以期在未来能够形成对股票优劣的区分能力。随着市场的变化，有预测能力的因子也在动态变化。因子来源包括研究员预期，市值，技术面，成长，估值。

- 研究员预期

根据研究员对上市公司未来盈利估算以及股票表现评价构成因子。

- 市值

根据上市公司的总市值进行筛选。

- 技术面

根据股票的量价信息构成因子，包括股票累计收益率，股票收益率偏度，股票相对于指数协同度等。

- 成长

根据上市公司公告的财报、业绩快报、业绩预告计算其净利润同比增长率以刻画其成长性。

- 估值

根据市净率 P/B、市盈率 P/E、股息率 D/P、市销率 P/S 等指标衡量股票目前估值水平。

2) 因子评价

每一个因子都代表了一种选股逻辑。因子评价体系通过一系列量化指标深入理解因子性质及适用的市场环境。其中包括因子组合表现，因子流动性溢价，因子稳定系数，因子衰减速度等。因子评价结果是确定因子权重的重要依据。

- 因子组合表现

利用因子分值构建多空组合，该组合称之为因子组合。因子组合的风险因子敞口为零。以因子组合表现的稳定程度衡量该因子的区分能力。

- 因子流动性溢价

因子有效性可能来源于其对流动性的补偿，即低流动性股票在未来有较高收益的现象。在较大规模的基金管理前提下需控制因子流动性溢价。

- 因子稳定系数

因子稳定系数衡量因子评分的稳定程度，因子较高的稳定性意味着投资组合的低换手率。

● 因子衰减速度

每一期因子评分的因子区分度会随着时间的推移而衰减，通过研究因子衰减速度可以衡量因子有效期，并配合恰当的换仓频率。因子衰减速度较快会导致很高的换手率，应当规避。

3) 多因子汇总

基金管理人根据优化算法确定因子权重基准，再根据对市场环境的判断，基金规模，市场流动性等进行微调。多因子根据因子权重进行叠加后形成对每只股票的总体评分，以此对股票的优劣进行判断。

4) 构建投资组合

首先根据业绩基准指数中的股票指数进行行业配置，以对跟踪误差形成约束，再利用多因子评分以及量化优化算法确定个股权重。参考市场流动性、基金规模、因子衰减速度等因素后找到最为合适的换仓频率，每隔一段时间对投资组合进行重新构建。

3、债券投资策略

本基金可投资于国债、金融债、央行票据、地方政府债券等债券品种，基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、短期金融工具等产品的比例，构造债券组合。

在选择国债品种中，本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险，根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合；在选择金融债品种时，本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。

4、股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

5、同业存单投资策略

本基金根据对存单发行银行的信用资质和存单流动性进行分析，严控信用风险底线的前提下，根据信用资质、流动性、收益率的综合考虑，选择具有良好投资价值的存单品种进行投资。信用资质分析，采用外部评级机构和内部评级相结合的方式，对信用风险进行审慎甄别。

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。”

4、修改基金的投资限制

原文为：

“1、投资比例限制

(1) 本基金投资于中证 500 等权重指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金资产的 80%，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%；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%；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%；

(2) 本基金投资于现金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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

(3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，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；

(4) 债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(5) 本基金总资产不得超过本基金净资产的 140%；

(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) 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%；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%；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本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(9) 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；

(10) 法律法规或监管部门规定的其他投融资比例限制。

除第（2）、（6）、（8）、（9）项以外，因证券市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

本基金应在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。期间，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。

如果法律法规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，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。”

拟修改为：

“1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

(5) 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；

(6) 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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(7) 基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

(8) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，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%；本基金在任何交易日日终，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%；本基金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%；

2) 本基金在任何交易日日终，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 95%；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）、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 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；

(9) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；

(10) 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(11) 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；

(12) 本基金参与融资业务后，在任何交易日日终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%；

(13) 本基金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；

(14) 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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第(2)、(10)、(11)项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，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。期间，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另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合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、修改基金的风险收益特征

原文为：

“本基金为股票型指数基金，预期风险大于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额看，西部利得中证 500 等权重 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；西部利得中证 500 等权重 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。”

拟修改为：

“本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。”

本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。”

（七）修改基金资产估值对象、估值方法

1、修改基金资产估值对象

原文为：

“基金所拥有的股票、债券、权证、央行票据、现金等资产及负债。”

拟修改为：

“基金所拥有的股票、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。”

2、修改基金资产估值方法

原文为：

“本基金按以下方式进行估值：

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、权证等），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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，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，按最近交易日的收盘价估值。

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) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息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，按最近交易日债券收盘价减去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；

(4) 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。交易所上市的资产支持证券，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。

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市价（收盘价）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、债券和权证，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) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，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、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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、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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。”

拟修改为：

“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，最近交易日后经济环境未发生重大变化且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固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定。

(3) 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。

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) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，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债券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、股指期货合约按照结算价估值，如估值日无结算价且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日结算价估值。

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、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。

当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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。

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。”

(八) 修改基金费用

1、修改基金费用的种类

原文为：

“1、基金管理人的管理费；

- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后的标的指数使用费；
- 4、基金上市费用；
- 5、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 6、《基金合同》生效以后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、《基金合同》生效以后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 9、基金的资金汇划费用；
- 10、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 11、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。”

拟修改为：

- “1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券/期货账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费用；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。”

2、修改基金的指数许可使用费表述

原文为：

“根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议，本基金标的的指数使用费年费率为 0.02%。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数使用费收取下限为每季度 5 万元（《基金合同》生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。标的指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

如与指数编制方的指数使用协议约定的收费标准、支付方式等发生变更，按照变更后的费率、支付方式执行，此项无需召开基金份额持有人大会。”

拟修改为：

“本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数使用许可费计提方法支付指数使用许可费。指数使用许可费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数使用许可费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。”

3、删除费用调整部分约定

拟删除：

“四、基金管理费和基金托管费的调整

调高基金管理费率、基金托管费率(但根据法律法规的要求提高该等报酬费率标准的除外),须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。”

(九) 修改基金收益分配原则

原文为:

“在存续期内,本基金(包括西部利得中证 500 等权重份额、西部利得中证 500 等权重 A 份额、西部利得中证 500 等权重 B 份额)不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过,并经中国证监会备案后,如果终止西部利得中证 500 等权重 A 份额与西部利得中证 500 等权重 B 份额的运作,本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。”

拟修改为:

“1、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,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;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循上海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;

2、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;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利的影响下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。”

(十) 信息披露等其他内容修改

为使《基金合同》适应《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等新的法律法规要求和业务需要，在根据上述转型方案的要点修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他部分条款一并进行了修改。

(十一) 授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同等法律文件修改的有关具体事宜

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同修改方案说明书》对《基金合同》等法律文件进行补充修改，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，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、份额折算安排等事项的转型实施安排规则并提公告。

三、本基金基金合同修改的主要风险及预备措施

(一) 预防基金合同修改方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范基金合同修改方案被基金份额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，在履行相关程序后进行适当修订，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。

如基金合同修改方案未获得基金份额持有人大会批准，则基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交新的有关基金合同修改方案的议案。

(二) 预防基金合同修改后基金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，避免基金合同修改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。

四、反馈及联系方式

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议，欢迎及时反馈给本基金管理人。

联系人：陈眉媚

联系电话：400-700-7818

传真：(021) 38572750

网站：www.westleadfund.com