

华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型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》等法律法规的规定和《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关规定，华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）的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，审议《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》。

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2017 年 8 月 28 日起，至 2017 年 9 月 26 日 17:00 止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2017 年 9 月 27 日。

4、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：华泰柏瑞基金管理有限公司客户服务部

地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层客户服务部

邮政编码：200135

联系电话：400-888-0001

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》（以下简称《议案》），《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2017 年 8 月 28 日，即在 2017 年 8 月 28 日交易时间结束后，在华泰柏瑞基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均享有本次基金份额持有人大会的表决权。

四、投票方式

1、本次会议仅接受纸质投票，表决票样本见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理

人网站 (<http://www.huatai-pb.com>) 下载等方式获取表决票。

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，并提供本人身份证件复印件；

(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相关的业务专用章，下文所称公章亦同），并提供加盖公章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的事业单位法人登记证书、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) 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五、授权（三）授权方式 1、纸面方式授权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。

3、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会议投票表决起止时间内（自 2017 年 8 月 28 日起，至 2017 年 9 月 26 日 17:00 止，以本基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址（上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层客户服务部），并建议在信封表面注明：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用。

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基金份额持有人大会，使基金份额持有人在本次基金份额持有人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。

基金份额持有人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在华泰柏瑞基金管理有限

公司登记在册为准。

（二）受托人

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。

为使基金份额持有人的权利得到有效行使，建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加的受托人名单。

（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。

基金份额持有人向他人授权的，授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（<http://www.huatai-pb.com>）下载等方式获取授权委托书样本。

1、纸面方式授权

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

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的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章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的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

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（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章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的事业单位法人登记证书、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明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章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的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（2）纸面授权文件的送达

纸面授权文件应与表决票一同于会议投票表决起止时间内通过专人送交或邮寄的方式送达至本公告规定的地址，基金份额持有人也可在授权截止时间前至基金管理人的柜台办理授权，填写授权委托书，并提交基金份额持有人身份证明文件，或将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人营业机构。投资者通过直销柜台办理基金交易业务时，直销柜台将为投资者提供纸面方式授权的服务。

为保护投资者利益，投资者在交易时，不论投资者是否授权或选择何种授权方式，均不影响交易的进行。

2、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额多次以有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，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。

3、对基金管理人的授权开始时间及截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为 2017 年 8 月 28 日至 2017 年 9 月 26 日 17:00 时。将纸面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人指定地址的，授权时间和有效性判断均以收到时间为准。

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授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 纸面表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准。2017 年 8 月 28 日前及 2017 年 9 月 26 日 17:00 以后送达收件人的纸面表决票，均为无效表决。

(2) 纸面表决票的效力认定

纸面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。

如纸面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基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的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。

基金份额持有人重复提交纸面表决票的，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：

- i.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；
- ii.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；
- iii.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，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

七、决议生效条件

- 1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；
- 2、《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》应当由提交有效表决票的基金份额持有人和其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过；
- 3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自生效之日起 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。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》和《基金合同》的规定，本次持有人大会需要到会者在权益登记日持有的有效的基金份额，不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）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，根据《基金法》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）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。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：华泰柏瑞基金管理有限公司

客服电话：400-888-0001

联系人：汪莹白

联系电话：(021)38601630

电子邮件：rainbow.wang@huatai-pb.com

传真：（021）50103016

网址：<http://www.huatai-pb.com>

2、公证机构：上海市东方公证处

地址：上海市静安区凤阳路 660 号

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

3、律师事务所：上海通力律师事务所

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

十、重要提示

- 1、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。
- 2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过华泰柏瑞基金管理有限公司网站（<http://www.huatai-pb.com>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电 400-888-0001 咨询。
- 3、本公告的有关内容由华泰柏瑞基金管理有限公司解释。

附件一：《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件四：华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同条款的修订对照表

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日

附件一：

《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》

华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人：

为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》、《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《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关约定，经与华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人提议将华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金，同时修改投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等相应基金合同条款。具体说明见附件四《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同条款的修订对照表》。

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人根据基金份额持有人大会决议对《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行修改，并办理本次转型的相关具体事宜。

以上提案，请予审议。

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017年8月28日

附件二：

授权委托书

本人（或本机构）持有了华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）的基金份额，就华泰柏瑞基金管理有限公司2017年8月28日在指定媒介公布的《华泰柏瑞基金管理有限公司关于以通讯方式召开华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》所述需基金份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划）：

审议事项 同意 反对 弃权

《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》

本人（或本机构）特此授权_____代表本人（或本机构）参加审议上述事项的基金份额持有人大会，并按照上述意见行使表决权。本人（或本机构）同意受托人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，则本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：_____

委托人证件号码（填写）：_____

委托人基金账户卡号（填写）：_____

以上表决意见代表委托人本证券账户下全部基金份额的表决意见，委托人所持基金份额数以持有人大会权益登记日为准。

签署日期：年月日

授权委托书填写注意事项：

1. 本授权委托书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》要求的授权委托书。
2. 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。
3. 如委托人未在授权委托书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书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。
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。

附件三：

华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型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/营业执照号或统一社会信用代码）：

基金账户号

审议事项 同意 反对 弃权

《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》

基金份额持有人（或受托人）签名或盖章：

年月日

说明：

1、请以打方式在审议事项后注明表决意见。

2、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本基金账户下全部基金份额的表决意见。

3、纸面表决票的效力认定以大会公告为准。

4、基金账户号不填写但不影响持有人身份认定的，不影响表决票效力。

附件四：

《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同条款的修订对照表》

章节 《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》条款 《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同（草案）》条款

全文 指定媒体 指定媒介

前言 三、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型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。

中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

三、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型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。

中国证监会对华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

释义 1、基金或本基金：指华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

4、基金合同或本基金合同：指《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型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

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型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《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

1、基金或本基金：指华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

4、基金合同或本基金合同：指《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型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

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型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《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

释义 7、基金份额发售公告：指《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
删除

释义 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，并经 2012 年 12 月 28 日经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 8、《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，2012 年 12 月 28 日经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〉修改的《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

释义 21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，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 20、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，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

释义 26、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换或转托管业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 25、基金交易账户：指销售机构为投资

人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换或转托管业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

释义 27、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 26、基金合同生效日：指《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日

释义 29、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月 删除

释义 37、认购：指在基金募集期内，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 删除

基金的基本情况 一、基金名称

华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 一、基金名称

华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

基金的基本情况 四、基金的投资目标

本基金将深入挖掘国企改革所带来的投资机会，精选受益于国企改革的相关证券，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。 四、基金的投资目标 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活的合理资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。

基金的基本情况 五、基金的最低募集份额总额及金额

本基金募集份额总数不低于 2 亿份，募集金额总额不低于 2 亿元。

六、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。

本基金认购费的具体费率按招募说明书的规定执行。 删除

无 第四部分基金份额的发售

第五部分基金备案 删除第四部分、第五部分两章节

基金的历史沿革 增加 第四部分基金的历史沿革

一、基金的历史沿革

华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金由华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来。根据 2015 年 7 月 3 日在中国证监会《关于准予华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1499 号）和 2016 年 11 月 8 日中国证监会证券基金机构监管部《关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函[2016]2727 号）准予注册。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金自 2017 年 2 月 13 日起至 2017 年 2 月 14 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，《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 16 日生效。

自 20**年**月**日至 20**年**月**日华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》，内容包括：

- 1、将华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金转型为华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金，同时修改投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等相应基金合同条款；
- 2、降低本基金的管理费率。

上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自 20**年**月**日起，由《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

基金的存续 增加 第五部分基金的存续

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的，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

基金份额的申购与赎回 二、申购和赎回的开放日及时间

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。 二、申购和赎回的开放日及时间

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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。

基金份额的申购与赎回 五、申购和赎回的数量限制

- 4、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。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。 五、申购和赎回的数量限制

4、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等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

基金份额的申购与赎回 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

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，针对基金投资者定期和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基金的申购费率和赎回费率。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

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基金的申购费率和赎回费率。

基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

增加

7、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 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。 七、拒绝或暂停申购的情形

删除

删除

6、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数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。

7、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、7 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指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，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。

基金份额的申购与赎回 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

6、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

发生上述 1、2、3、5、6、7 项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，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赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

删除

发生上述1、2、3、5、6项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，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赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。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。

基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；

基金合同当事人及权利义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；

基金合同当事人及权利义务 (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

基金合同当事人及权利义务 (24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，

基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还

基金认购人； 删除

基金合同当事人及权利义务 三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用； 三、基金份额持有人

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(4) 缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

基金份额持有人大会 一、召开事由

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，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准； 一、召开事由

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，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

基金份额持有人大会 2、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：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用； 2、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：

删除

基金份额持有人大会 (6) 在符合有关法律法规，并且对持有人利益无实质性不利影响的前提下，经中国证监会允许，基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、

转换、非交易过户、转托管等业务的规则； (5) 在符合有关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

基金份额持有人大会 (7) 对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

(6) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

(二) 基金托管人的更换程序

6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金

托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值； 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

（二）基金托管人的更换程序

6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值和净值；

基金的投资 一、投资目标

本基金将深入挖掘国企改革所带来的投资机会，精选受益于国企改革的相关证券，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。 一、投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极灵活的合理资产配置，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的持续稳健增值。

基金的投资 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，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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）。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于本基金界定的国企改革主题方向的相关证券比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。 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，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

基金的投资 三、投资策略

（一）资产配置策略

本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合国企改革主题相关行业的发展状况包括相关行业的国家政策变化情况及行业发展状况等行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，在严格控制投资组合风险的前提下，调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。

（二）股票投资策略

1、国有企业的定义

国有企业是指企业的资本全部或主要由国家投入，其全部资本或主要股份归国家所有。在中国，国有企业还包括由地方政府投资参与控制的企业。

国有企业的分类：（1）特殊法人企业：由政府全额出资并明确其法人地位，由国家通过专门的法规和政策来规范，不受公司法规范。这类国有企业被赋予强制性社会公共目标，直接提供公共服务；（2）国有独资公司：由政府全额出资，受公司法规范。这类国有企业以社会公共目标为主，经济目标居次，主要是自然垄断企业和资源类企业；（3）国有控股公司：由政府出资控股，受公司法规范。这类国有企业兼具社会公共目标和经济目标，以经济目标支撑社会公共目标，主要是准自然垄断企业和国民经济发展的支柱产业。

2、国企改革主题的界定

本基金所指的国企改革主题的上市公司界定如下：（1）受益于制度改革的国有企业，包括通过国资监管体制改革、产权制度改革（如兼并重组、整合上市、混合所有制改革等）以及国企管理制度改革（如经营机制、激励机制改革等）等多种方式，提高运营效率和竞争力的国有上市公司；（2）鉴于国企改革的影响范围之宽、涉面之广，受益于行业准入、国退民进等相关主题的非国有企业同属国企改革主题投资范围。未来若出现其他受益于国企改革进程的上市公司，本基金也应在深入研究的基础上，将其列入核心股票库。

3、行业配置策略

本基金将综合考虑政府管制政策、混合所有制改革推进情况、相关行业的产业整合以及转型、行业激励和约束机制及股权多元化等因素，进行股票资产在各行业间的配置。

4、个股选择策略

本基金将采用自上而下与自下而上相结合的分析方法，通过扎实的案头基本面分析工作以及密切的实地调研工作，深入研究相关个股对于改革措施的受益程度以及持续周期，对于受益程度较深、持续周期较长的个股，本基金将进行重点配置。

本基金将结合定性分析以及定量分析，筛选最大程度受益于国企改革红利、经营效率提高且兼具长期成长性和价格安全边际的上市公司股票进行投资。

（1）定性分析

在定性分析中，本基金将筛选具有改革预期、良好的公司治理结构以及有独特、可鉴别的企业核心竞争力的上市公司。

1) 具有改革预期：本基金将重点关注中央国有企业以及已公布国企改革实施意见的地区所属地方国有企业，在深入行业分析以及实地调研的基础上，寻找具有改革预期的个股进行重点配置。

2) 良好的公司治理结构：重点从公司股权结构、激励制度、组织框架、董事会与管理层的独立性、信息透明度等方面定性分析。

3) 独特、可鉴别的企业核心竞争力：体现在规模、管理、技术、品牌、营销、资源、渠道网络、创新能力等一个或多个方面。

（2）定量分析

本基金将结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深入挖掘，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行分析，为选择具备成长性、能够创造价值、具有合理估值的上市公司个股提供依据。

（三）固定收益资产投资策略

本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

固定收益资产包括债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等。

本基金管理人将在限定的投资范围内，基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策实施情况等因素对固定收益资产的影响，结合市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况进行合理的

利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

（四）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。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，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，力求取得最优的风险调整收益。

（五）资产支持证券投资策略

在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

（六）其他金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

三、投资策略

（一）资产配置策略

本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。

（二）股票投资策略

本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的风险。

本基金将自上而下的趋势投资和自下而上的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。

1、行业配置策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的行业配置方法构建投资组合，综合考虑以下因素，进行股票资产在各行业间的配置。

（1）国家经济政策

本基金将积极关注政府未来的产业发展规划方向，以及配套的国家财政与税收政策、货币政策、产业政策、贸易政策、汇率政策等政策的变化，分析国家政策对主题行业的影响，重点投资于受益于国家政策变化、预期收益率较高的行业。

（2）经济周期

经济周期对各个行业的影响不尽相同，本基金主要从两个角度把握经济周期带来的投资机会：一是充分分析过往历史数据，找出经济周期对行业景气度影响的共性规律；二是将对当前所处经济周期阶段进行前瞻性分析，根据各行业在经济周期各阶段的预期表现，进行行业配置与调整，为投资者追求超额收益。

（3）各行业的发展前景

本基金将重点关注各行业的发展进程，捕捉行业科技技术、制造工艺、商业模式、人才结构等因素的最新变化，从而预测各行业的发展前景，发掘具有广阔发展潜力的行业，并相应对基金资产的行业配置进行调整。

（4）各行业基本面的变化

本基金将对影响各行业基本面的因素进行跟踪分析，预期各行业基本面变化的拐点，超配基本面即将发生有利变化的行业，低配基本面即将发生不利变化的行业。

（5）各行业的相对估值水平

本基金将对各行业的相对估值水平进行动态分析，增加被市场低估的行业配置比例，降低盈利低于预期的行业配置比例。

（6）市场需求趋势

各行业市场需求的变化趋势不同，有的表现为刚性需求，有的呈现较大弹性，导致不同行业成长性出现差异。本基金将重点投资市场需求稳定或保持较高增长的行业。

（7）行业竞争格局

各行业内部的竞争格局不同，行业利润率存在较大差异。本基金将重点投资行业进入壁垒较高、利润率稳定或保持增长的行业。

2、个股选择策略

本基金股票资产以基金面良好的上市公司为投资对象，基于行业配置的要求，对股票进行分类和筛选，选择各行业龙头企业和价值被低估的企业作为重点关注对象。

（1）行业龙头企业。一般指在该行业里股本、市值、规模、市场占有率居前的代表性企业。这些企业由于规模巨大，市场占有率高，所以其自身发展对全行业有重大影响，往往引领全行业的发展方向和兴衰。

（2）成长性企业。一般指那些在较长时期内，具有持续挖掘未利用资源的能力、不同程度地表现出整体

扩张的态势、未来发展预期良好的企业。

(3) 价值低估企业。通过深入分析研究市场和股票价格变动的诸多因素，综合判断企业的内在价值。如果企业股票价格没能反映其真实价值或潜在价值，则视之为价值低估企业。

(三) 固定收益资产投资策略

本基金固定收益资产投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

固定收益资产包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等。

本基金管理人将在限定的投资范围内，基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策实施情况等因素对固定收益资产的影响，结合市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

(四) 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发配售等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易等情形下将主动投资权证。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，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价，力求取得最优的风险调整收益。

(五) 资产支持证券投资策略

在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

(六) 股指期货投资策略

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

（七）融资业务的投资策略

本基金还可以在条件允许的情况下在履行适当的程序后参与融资业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

基金的投资 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）本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%，其中投资于本基金界定的国企改革主题的上市公司相关证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；

（2）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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票资产的投资比例占基金资产的 0-95%；

（2）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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；

基金的投资 （16）本基金参与股指期货投资的，需遵循下述比例限制：

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入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）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

（16）本基金参与股指期货投资，需遵循下述比例限制：

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）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3）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%；

基金的投资 增加 （18）本基金在条件允许的情况下可参与融资业务，在任何交易日日终，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%；

基金的投资 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，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，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，但须提前公告，无需经基金份额持有人大会审议。除上述第（12）项另有约定外，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，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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；如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本基金，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，但须提前公告，无需经基金份额持有人大会审议。

基金的投资 2、禁止行为

上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定，如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；基金管理人应提前三个交易日公告，此调整无需召开基金份额持有人大会。 2、禁止行为

上述禁止行为是基于基金合同生效时法律法规而约定，如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。

基金的投资 3、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。 3、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，符合中国证监会的规定，并履行披露义务。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

基金的投资 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证国有企业改革指数收益率 55%+上证国债指数收益率 45%。

本基金为灵活配置混合型证券投资基金，股票投资比例为 0-95%，因此在业绩比较基准中股票投资部分权重为 55%，其余为债券投资部分。

本基金主要投资于国企改革主题的上市公司股票，中证国有企业改革指数能有效反映国企的投资价值，对国企改革主题的股票具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。上证国债指数以国债为样本，按照发行量加权而成，具有良好的债券市场代表性，因此选取上证国债指数作为债券投资部分的业绩比较基准。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者市场推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整，并报中国证监会备案并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 50%+中债综合指数收益率 50%。

本基金为灵活配置混合型证券投资基金，股票投资比例为 0-95%，因此在业绩比较基准中股票投资部分权重为 50%，其余为债券投资部分。

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，抗操纵性强，并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场、不同发行主体和期限，能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。综合考虑基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中债综合指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金，或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，或者市场推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，与基金托管人协商一致，并按照监管要求履行适当程序后，对业绩比较基准进行相应调整，并由基金管理人报中国证监会备案并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

基金资产估值 八、特殊情况的处理

2、由于不可抗力，或证券、期货交易所、登记结算公司及存款银行发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

八、特殊情况的处理

2、由于不可抗力，或证券、期货交易所、登记结算公司、存款银行等机构发送的数据错误等原因，基金

管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

基金费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \times \text{当年天数}$$

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

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \times \text{当年天数}$$

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

基金费用与税收 上述一、基金费用的种类中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。 上述一、基金费用的种类中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

基金费用与税收 五、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率和基金托管费率，无需召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过，但法律法规要求提高该等报酬标准或费率的除外。 删除

基金的会计与审计 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露； 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

基金的信息披露 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

(一) 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安

排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请在中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

五、
公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒介上；基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金的信息披露 （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定媒介上登载基金合同生效公告。 删除

基金的信息披露 （四）基金资产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

（五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有

关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。 (二) 基金资产净值、基金份额净值

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

(三) 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。

基金的信息披露 (六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

(四) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

如报告期内出现单一投资者持有基金份额数的比例超过基金份额总数 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。

基金的信息披露 (七) 临时报告

7、基金募集期延长； (五) 临时报告

删除

基金的信息披露 23、本基金发生巨额赎回并延期支付； 22、本基金发生巨额赎回并延期办理；

基金的信息披露 增加 (八) 参与融资业务的信息披露

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露基金参与融资交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

基金的信息披露 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益决定延迟估值时；出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况；
- 4、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

八、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

违约责任 一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。

但是如发生下列情况，当事人免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、基金管理人由于按照基金合同规定投资或不投资造成的损失等；

4、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非基金管理人、基金托管人过错造成的意外事故。 一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失。

但是如发生下列情况，当事人免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、基金管理人由于按照基金合同规定投资或不投资造成的损失等。

基金合同的效力 基金合同是基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。 基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字。