

东吴基金管理有限公司关于以通讯方式召开 东吴配置优化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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《东吴配置优化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，东吴配置优化混合型证券投资基金的基金管理人东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议召开的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自 2017 年 11 月 21 日起，至 2017 年 12 月 20 日 17:00 止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2017 年 12 月 21 日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：东吴基金管理有限公司

地址：上海市浦东源深路 279 号

邮编：200135

联系人：贾云鹏

联系电话：4008210588,021-50509888 转 8111

请在信封表面注明：“东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。
投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 4008210588 咨询。

二、会议审议事项

《关于东吴配置优化混合型证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《东吴配置优化混合型证券投资基金转型方案说明书》（附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2017 年 11 月 21 日，即在 2017 年 11 月 21 日下午交易时间结束后，在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份

额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。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.scfund.com.cn）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，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机构公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理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（可参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的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（参照附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的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。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2017 年 11 月 21 日起，至 2017 年 12 月 20 日 17:00 以前（送达时间以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办公地址，并在信封表面注明：“东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下：

基金管理人：东吴基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东源深路 279 号

联系人：贾云鹏

联系电话：4008210588,021-50509888 转 8111

五、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（中国农业银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期第二日（即 2017 年 12 月 21 日）进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的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）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之内送达基金管理人的，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、多选或无法辨认、表决意见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。

（3）如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代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之内送达基金管理人的，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，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

六、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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%)；

2、《关于东吴配置优化混合型证券投资基金转型有关事项的议案》应当由提交有效表决

票的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)通过;

3、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和代理投票授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和本公告的规定,并与注册登记机构记录相符;

4、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五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、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定,本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到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 2013 年 6 月 1 日生效的《中华人民共和国证券投资基金法》的规定,基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点,但权益登记日仍为 2017 年 11 月 21 日。

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做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做出授权,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、本次大会相关机构

1、召集人:东吴基金管理有限公司

联系人:贾云鹏

联系电话:4008210588,021-50509888 转 8111

传真:021-50509884

网址:www.scfund.com.cn

邮编:200135

2、监督人:中国农业银行股份有限公司

3、公证机关:上海市东方公证处

联系方式:021-62154848

联系人:林奇

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

九、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，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、本次基金份额持有人大会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 4008210588 咨询。

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、本公告的有关内容由东吴基金管理有限公司负责解释。

东吴基金管理有限公司

2017 年 11 月 21 日

附件一：《关于东吴配置优化混合型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《东吴配置优化混合型证券投资基金转型方案说明书》

附件一：

关于东吴配置优化混合型证券投资基金转型 有关事项的议案

东吴配置优化混合型证券投资基金基金份额持有人：

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《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国农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，对东吴配置优化混合型证券投资基金（以下简称“东吴配置优化”）实施转型。具体安排可参见《东吴配置优化混合型证券投资基金转型方案说明书》见附件四。

为实施东吴配置优化转型方案，提议授权基金管理人办理本次东吴配置优化转型的有关具体事宜，并根据《东吴配置优化混合型证券投资基金转型方案说明书》对《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》等法律文件进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：东吴基金管理有限公司

2017年11月21日

附件二：

东吴配置优化混合型证券投资基金
基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：			
基金份额持有人证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
基金份额持有人基金账户号：			
受托人（代理人）姓名/名称：			
受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于东吴配置优化混合型证券投资基金转型有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章			
日期：_____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；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；
- 2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，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；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、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见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代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间内送达基金管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。
- 4、本表决票可从本基金管理人网站（www.scfund.com.cn）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托_____先生 / 女士或_____单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2017 年 12 月 20 日的以通讯方式召开的东吴配置优化混合型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。

授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若东吴配置优化混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人姓名或名称（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：

受托人（代理人）姓名或名称（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、此授权委托书可剪报、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。

2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，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；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、受托人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

东吴配置优化混合型证券投资基金转型方案说明书

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《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，基金管理人经与基金托管人中国农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，审议关于东吴配置优化混合型证券投资基金（以下简称“东吴配置优化”）转型有关事项的议案。

2、本次东吴配置优化转型方案需经本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持表决权的 50%以上(含 50%)通过，因此转型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。中国证监会对本次东吴配置优化持有人大会决议的备案，均不表明其对本次转型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。

二、转型方案要点

（一）合同主要修改内容对比

章节	修改前表述	修改后表述
全文	东吴配置优化混合型证券投资基金	东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金
全文	媒体	媒介
前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”）、《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律、法规。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”）、《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。

前言	<p>三、本基金由东吴保本混合型证券投资基金转型而来。东吴保本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”)核准。</p> <p>中国证监会对东吴保本混合型证券投资基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值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。</p>	<p>三、本基金由东吴配置优化混合型证券投资基金变更而来，东吴配置优化混合型证券投资基金由东吴保本混合型证券投资基金转型而来。东吴保本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”)核准。</p> <p>中国证监会对东吴配置优化混合型证券投资基金变更为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值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。</p>
前言	无	<p>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。</p> <p>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。</p>
释义	1、基金或本基金：指东吴配置优化混合型证券投资基金，本基金由东吴保本混合型证券投资基金转型而来	1、基金或本基金：指东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金
释义	4、基金合同或本基金合同：指《东吴配置优化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	4、基金合同或本基金合同：指《东吴配置优化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
释义	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴配置优化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	5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴配置优化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
释义	6、招募说明书：指《东吴配置优化混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新	6、招募说明书：指《东吴配置优化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		<p>添加 13、《流动性风险规定》：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</p> <p>49、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</p>

		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以及法律法规或中国证监会规定的其他流动性受限资产,如未来法律法规变动,基金管理人在履行适当程序后,可对上述流动性受限资产范围进行调整 50、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,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
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,办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。	21、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	22、销售机构:指东吴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,代为办理基金销售业务的机构	22、销售机构:指东吴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
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买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户	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、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
释义	28、基金合同生效日:指《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》生效起始日,《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效	28、基金合同生效日:指《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效起始日,《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效
释义	38、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为	38、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
释义	41、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基金申购申请的一种投资方式	41、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
释义	50、不可抗力:指本合同当事人不能预	50、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。	见、不能避免且不能克服的客观事件
基金的基本情况	<p>一、基金名称</p> <p>东吴配置优化混合型证券投资基金</p> <p>四、基金的投资目标</p> <p>本基金主要投资于具有持续竞争优势的企业，追求基金资产长期增值。</p>	<p>一、基金名称</p> <p>东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金</p> <p>四、基金的投资目标</p> <p>本基金根据不同市场情况变化，对股票、债券及其他投资品种的配置进行优化调整，追求基金资产长期稳定增值。</p>
基金的历史变革	<p>第四部分基金的历史变革</p> <p>东吴配置优化混合型证券投资基金根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。</p> <p>东吴保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可【2012】506号文核准，自2012年7月11日至2012年8月8日期间公开募集。募集有效认购总户数为9382户，募集资金及其产生的利息共计775,673,452.62元，折合基金份额775,673,452.62份。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，《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年8月13日生效。</p> <p>2015年8月13日，东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满。由于不符合保本基金存续条件，根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满后，东吴保本混合型证券投资基金转型为“东吴配置优化混合型证券投资基金”。自《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》生效之日起，《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。</p>	<p>第四部分基金的历史变革</p> <p>东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金由东吴配置优化混合型证券投资基金变更而来。东吴配置优化混合型证券投资基金根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。</p> <p>东吴保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可【2012】506号文核准，自2012年7月11日至2012年8月8日期间公开募集。募集有效认购总户数为9382户，募集资金及其产生的利息共计775,673,452.62元，折合基金份额775,673,452.62份。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，《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年8月13日生效。</p> <p>2015年8月13日，东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满。由于不符合保本基金存续条件，根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满后，东吴保本混合型证券投资基金转型为“东吴配置优化混合型证券投资基金”。自《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》生效之日起，《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。</p> <p>2017年XX月XX日东吴配置优化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《关于东吴配置优化混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括东吴配置优化混合型证券投资基金调整基金投资范围、投资策略、业绩比较基准、估值方法以及修订基金合同等，并同意将“东吴配置优化混合型证券投资基金”更名为“东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会</p>

		决议自表决通过之日起生效。自基金份额持有人大会决议生效并公告之日起,《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。
基金份额的申购与赎回	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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,具体规定请参见相关公告。</p> <p>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。</p>
基金份额的申购与赎回	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4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,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。</p> <p>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》,赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。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,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>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。不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。</p> <p>6、本基金的申购费用最高不超过申购金额的5%,赎回费用最高不超过赎回</p>	<p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>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,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。</p> <p>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,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>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,其中对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回费用归入基金财产的具体比例详见招募说明书,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。</p> <p>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</p>

<p>金额的 5%。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 2 个工作日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 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收投资人的申购申请。 3、证券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、基金管理人认为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。 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>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</p>	<p>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 2 个工作日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>增加: 7、当发生大额申购情形时,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。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 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。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。 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、基金管理人认为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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 <p>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全部或部分被拒绝的,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。</p> <p>八、暂停赎回、拒绝赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时,基金管理人可暂停、拒绝接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:</p> <ol style="list-style-type: none"> 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值
--	---

	<p>款项：</p> <p>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收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p> <p>3、证券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。</p> <p>5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形时，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。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。</p>	<p>情况时，基金管理人可暂停、拒绝接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。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。</p> <p>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。</p> <p>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投资人的赎回申请。</p> <p>6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>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，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。</p>
<p>基金份额的申购与赎回</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权</p>

	<p>撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。</p>	<p>并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。若发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人应当采取具体措施对其进行延期办理赎回。</p> <p>对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“(1) 全部赎回”或“(2) 部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</p> <p>对于超过上述比例的部分，基金管理人应当根据前段“(2) 部分延期赎回”的相关内容，对超过上述比例的部分进行延期赎回。</p> <p>(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p>
基金份额的申购与赎回	十五、基金的冻结和解冻	十五、基金份额的冻结和解冻
基金份额的申购与赎回	无	<p>十六、基金份额的转让</p> <p>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</p>

基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所: 上海市浦东新区源深路 279 号 (200135)</p> <p>法定代表人: 任少华</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>住所: 上海市浦东新区源深路 279 号</p> <p>法定代表人: 王炯</p>
基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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:</p> <p>(16) 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、转换和非交易过户的业务规则;</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>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:</p> <p>(16) 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、转换和非交易过户等业务规则;</p>
基金合同当事人及权利义务	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人: 刘士余</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人: 周慕冰</p>
基金合同当事人及权利义务	<p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的权利包括但不限于:</p> <p>(4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的义务包括但不限于:</p> <p>(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定, 召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;</p> <p>(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务, 基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;</p>	<p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的权利包括但不限于:</p> <p>(4) 根据相关市场规则, 为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户, 为基金办理证券、期货交易资金清算;</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的义务包括但不限于:</p> <p>(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定, 召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;</p> <p>(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务, 基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;</p> <p>(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;</p>
基金合同当事人	<p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的权利包</p>	<p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的权利包括但不限</p>

<p>人及 权利 义务</p>	<p>括但不限于： （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会； （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> <p>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： （1）认真阅读并遵守《基金合同》； （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险； （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；</p>	<p>于： （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会； （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；</p> <p>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： （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件； （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，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； （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；</p>
<p>基金 份额 持有 人大 会</p>	<p>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： （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>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； （2）法律法规要求增加的基金费用的收取； （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式； （4）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改； （5）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化； （6）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。</p>	<p>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： （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求调整该等报酬标准的除外；</p> <p>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 （1）法律法规要求增加的基金费用的收取； （2）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式； （3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改； （4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化； （5）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。</p>
<p>基金 份额 持有 人大</p>	<p>二、会议召集人及召集方式 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书</p>	<p>二、会议召集人及召集方式 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起</p>

会	<p>面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。</p> <p>4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。</p>	<p>10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p> <p>4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。</p>
基金份额持有人大会	<p>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</p> <p>1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：</p> <p>（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，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；</p>	<p>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。</p> <p>1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：</p> <p>（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，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；</p> <p>（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登</p>

<p>(2) 经核对, 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 50% (含 50%)。</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时, 通讯开会的方式视为有效:</p> <p>(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后, 在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;</p> <p>(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人 (如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人) 到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人 (如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人) 和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见; 基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的, 不影响表决效力;</p> <p>(3) 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不小于在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%);</p> <p>(4) 上述第 (3) 项中直接出具书面意</p>	<p>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)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 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到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一 (含三分之一)。</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时, 通讯开会的方式视为有效:</p> <p>(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后, 在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;</p> <p>(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人 (如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人) 到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人 (如果基金托管人为召集人, 则为基金管理人) 和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见; 基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的, 不影响表决效力;</p> <p>(3) 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不小于在权益登记日基金总份额的二分之一 (含二分之一); 若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一, 召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 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 (含三分之一) 以上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;</p>
---	---

	<p>见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人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》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；</p> <p>(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。</p> <p>无</p>	<p>(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人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》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。</p> <p>删除</p> <p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p> <p>4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。</p>
基金份额持有人大会	<p>五、议事内容与程序</p> <p>2、议事程序</p> <p>(1) 现场开会</p> <p>在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。</p>	<p>五、议事内容与程序</p> <p>2、议事程序</p> <p>(1) 现场开会</p> <p>在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。</p>
基金份额持有人大会	<p>六、表决</p> <p>1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决</p>	<p>六、表决</p> <p>1、一般决议，一般决议须经参加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；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事</p>

	议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。	项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。
基金份额持有人大会	无	九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，经与基金托管人协商一致，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	<p>一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形</p> <p>（一） 基金管理人职责终止的情形有下列情形之一的，基金管理人职责终止：</p> <p>4、法律法规和《基金合同》规定的其他情形。</p> <p>（二） 基金托管人职责终止的情形</p> <p>4、法律法规和《基金合同》规定的其他情形。</p>	<p>一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形</p> <p>（一） 基金管理人职责终止的情形有下列情形之一的，基金管理人职责终止：</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p> <p>（二） 基金托管人职责终止的情形</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p>
基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>（一） 基金管理人的更换程序</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案；</p> <p>（二） 基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金持有人提名；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案；</p> <p>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。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>（一） 基金管理人的更换程序</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>（二） 基金托管人的更换程序</p> <p>1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名；</p> <p>4、备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须报中国证监会备案；</p> <p>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。新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值；</p>
基金份额的登记	<p>三、基金登记机构的权利</p> <p>基金登记机构享有以下权利：</p> <p>5、法律法规规定的其他权利。</p>	<p>三、基金登记机构的权利</p> <p>基金登记机构享有以下权利：</p> <p>5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p>
基金份额	<p>四、基金登记机构的义务</p> <p>4、对基金份额持有人的基金账户信息</p>	<p>四、基金登记机构的义务</p> <p>4、对基金份额持有人的基金账户信息负有</p>

<p>的登记</p>	<p>负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但监管部门和司法强制检查情形除外；</p> <p>7、法律法规规定的其他义务。</p>	<p>保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；</p> <p>7、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。</p>
<p>基金的投资</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金主要投资于具有持续竞争优势的企业，追求基金资产长期增值。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金投资范围限于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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、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的相关规定）。</p> <p>本基金投资组合的资产配置范围为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例为 30%—80%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为 20%—70%；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%。</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金根据不同市场情况变化，对股票、债券及其他投资品种的配置进行优化调整，追求基金资产长期稳定增值。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金投资范围限于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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债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的相关规定）。</p> <p>本基金投资组合的资产配置范围为：股票投资占基金资产的比例为 0—95%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。</p>
<p>基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 行业配置策略</p> <p>在中国经济成长和结构转型的发展过程中，不同时期各行业显示的景气度将不同。该基金采用定性和定量相结合的方法，动态优选不同经济周期阶段的景气行业。首先对行业进行定性筛选，该基金主要从市场需求、技术进步、政策变动、行业整合等因素，同时结合行业的特性，把握各行业发展趋势和市场波动特征，优选出预期超越市场平均收益</p>	<p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将积极主动的投资风格与严谨规范的选股方法相结合，综合运用“自上而下”和“自下而上”的投资方法进行行业配置和个股选择；在对宏观经济运行、行业景气变化以及上市公司成长潜力进行定量评估、定性分析和实地调研的基础上，优选重点行业中基本面状况健康、具有估值优势、成长性良好、定价相对合理的股票进行投资，以谋求超额收益。</p>

<p>率的行业，其次使用定量方法对行业配置比例进行优化。该基金采用行业配置模型为行业配置比例提供参考，该基金的投资研究团队将根据定量分析结果对定性研究的结果进行调整之后，形成最终的资产配置方案。</p> <p>(2) 股票配置策略</p> <p>本基金将按照、但不限于以下七个成长性指标、五个价值性指标以及“东吴基金企业竞争优势评价体系”，衡量上市公司的成长性、价值性和竞争性，精选具有综合优势的上市公司。</p> <p>A、成长性模块</p> <p>本基金将按照、但不限于以下七个成长性指标对上市公司的成长性进行筛选，精选出具有综合成长性优势的上市公司。</p> <p>表 15-1: 成长模块衡量成长性定量指标</p>	<p>新增：</p> <p>4、可转换债券投资策略</p> <p>对于本基金中可转债的投资，本基金主要采用可转债相对价值分析策略。</p> <p>由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。其次，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析，这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等，形成对基础股票的价值评估。本基金将可转债自身的基本面分析和其基础股票的基本面分析结合在一起，最终确定投资的品种。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、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基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以获得长期稳定收益。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>本基金将以股指期货为主的金融衍生工具，以套期保值为主要目的，与资产配置策略进行搭配，并利用股指期货灵活快速进出的优势，控制仓位风险，同时可以降低交易成本，为实际的投资操作提供多一项选择。</p> <p>8、国债期货投资策略</p> <p>本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，</p>														
<table border="1"> <tr> <td>EG</td> <td>净利润增长率</td> </tr> <tr> <td>REG</td> <td>预期净利润增长率</td> </tr> <tr> <td>RG</td> <td>营业收入增长率</td> </tr> <tr> <td>ROE</td> <td>净资产收益率</td> </tr> <tr> <td>EROE</td> <td>预期净资产收益率</td> </tr> <tr> <td>ROA</td> <td>资产收益率</td> </tr> <tr> <td>NAV</td> <td>净资产增长率</td> </tr> </table>	EG	净利润增长率	REG	预期净利润增长率	RG	营业收入增长率	ROE	净资产收益率	EROE	预期净资产收益率	ROA	资产收益率	NAV	净资产增长率	
EG	净利润增长率														
REG	预期净利润增长率														
RG	营业收入增长率														
ROE	净资产收益率														
EROE	预期净资产收益率														
ROA	资产收益率														
NAV	净资产增长率														
<p>B、价值性模块</p> <p>该本基金将按照、但不限于以下五个价值性指标对上市公司价值性进行筛选。</p> <p>表 15-2: 价值模块衡量股票价值定量指标</p> <table border="1"> <tr> <td>PE</td> <td>市盈率</td> </tr> <tr> <td>PB</td> <td>市净率</td> </tr> <tr> <td>PS</td> <td>市销率</td> </tr> <tr> <td>PCF</td> <td>市现率</td> </tr> <tr> <td>EV/EBITDA</td> <td>企业价值倍数</td> </tr> </table>	PE	市盈率	PB	市净率	PS	市销率	PCF	市现率	EV/EBITDA	企业价值倍数					
PE	市盈率														
PB	市净率														
PS	市销率														
PCF	市现率														
EV/EBITDA	企业价值倍数														
<p>C、东吴基金企业竞争优势评价体系</p> <p>本基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”，精选出具有综合竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。</p> <p>(3) 股票池调整法则</p> <p>原则上，本基金根据上市公司定期报告</p>															

	<p>对股票池进行相应调整。在宏观经济环境、行业基本面和市场指数发生重大变化情况下，可进行临时调整。同时，可根据行业研究员调研情况和研究成果，综合考虑上市公司的行业趋势、公司基本面、估值水平等方面的情况对该基金股票池进行个别调进调出。</p>	<p>通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。</p>
<p>基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）投资股票资产占基金资产的比例为 30%—80%，债券资产投资占基金资产的比例为 20%—70%；</p> <p>（2）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；</p> <p>（14）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%；</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）投资股票资产占基金资产的比例为 0—95%；</p> <p>（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>（14）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%，本基金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；</p> <p>新增：</p> <p>（16）本基金投资股指期货、国债期货后，需遵守下列比例限制：</p> <p>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；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%；</p> <p>在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和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；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不</p>

	<p>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。</p>	<p>得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；</p> <p>（17）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；</p> <p>（18）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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前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；</p> <p>（19）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；</p> <p>（18）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；</p> <p>（19）本基金主动投资于非上市交易的股票、债券及不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的市值合计不得超过基金资产净值的 30%；</p> <p>（20）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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前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；</p> <p>（21）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</p>
--	--	---

	<p>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。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>（2）向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；</p> <p>（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</p> <p>（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他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；</p> <p>（7）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；</p> <p>（8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。</p>	<p>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；</p> <p>除上述第（2）、（12）、（18）、（19）、项之外，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。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六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。</p> <p>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调整后的规定执行。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>（5）向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>（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；</p> <p>（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>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的同意，并按法律法规予以披露。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。</p> <p>若法律、行政法规或监管部门取消上述禁止</p>
--	---	--

		性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。
基金的投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>1、本基金的业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准：$60% \times \text{沪深 300 指数} + 40% \times \text{中国债券综合全价指数}$。</p> <p>沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成分股指数，覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，因此，股票部分的业绩基准采用沪深 300 指数。</p> <p>中国债券综合全价指数是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更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和该基金的投资范围和投资理念，该基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数作为业绩比较基准。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金业绩比较基准：$\text{沪深 300 指数收益率} \times 50% + \text{中国债券综合全价指数收益率} \times 50%$。</p> <p>沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成分股指数，覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，因此，股票部分的业绩基准采用沪深 300 指数收益率。</p> <p>中国债券综合全价指数是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更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和该基金的投资范围和投资理念，该基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数收益率作为业绩比较基准。</p>
基金的投资	<p>七、基金的融资、融券</p> <p>本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。</p>	删除
基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、债券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债</p>
基金资产估值	<p>三、估值方法</p> <p>1. 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(2) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；</p> <p>(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1. 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(2) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；</p> <p>(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适</p>

	<p>价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。</p> <p>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净价估值。对银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净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p>	<p>当性，并在情况发生改变时做出适当调整。</p> <p>3. 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。</p> <p>新增：</p> <p>6、本基金投资股指期货、国债期货等衍生品品种合约，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。</p> <p>8. 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。</p>
基金资产估值	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p>	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p>
基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>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</p> <p>3、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一致后，基金管理人应当暂停基金估值；</p>
基金资产估值	无	<p>新增：八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第7项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或证券/期货交易所、登记结算公司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，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理</p>

		人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。
基金费用和税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；</p> <p>6、基金的证券交易费用；</p> <p>8、证券账户开户费用和银行账户维护费；</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费或仲裁费；</p> <p>6、基金的证券/期货交易费用；</p> <p>8、相关账户开户费用和账户维护费；</p>
基金费用和税收	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 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</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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。</p>
基金的收益分配	<p>四、收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p>	<p>四、收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p>
基金	六、基金收益分配中发生的费用	六、基金收益分配中发生的费用

<p>的收益分配</p>	<p>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>	<p>基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。</p>
<p>基金的信息披露</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（五）临时报告</p> <p>10、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；</p> <p>（七）基金份额持有人大会决议</p> <p>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。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（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</p> <p>新增：</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下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，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>本基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>（五）临时报告</p> <p>10、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；</p> <p>新增：25、发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</p> <p>26、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p> <p>27、中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。</p> <p>（七）基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>新增：</p> <p>（八）投资资产支持证券的信息披露</p> <p>基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。</p> <p>基金管理人应在基金季度报告中披露其持</p>

		<p>有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>（九）投资股指期货的信息披露 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）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>（十）投资国债期货的信息披露 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）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p>
基金的信息披露	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 15 年。</p>	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。</p>
基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</p>	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、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。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</p>
基金合同的变更、终止与基金财产的清算	<p>三、基金财产的清算</p> <p>4、基金财产清算程序： （7）对基金财产进行分配；</p>	<p>三、基金财产的清算</p> <p>4、基金财产清算程序： （7）对基金剩余财产进行分配。</p>

违约责任	<p>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。</p> <p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>	<p>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。但是发生下列情况的，当事人可以免责：</p> <p>1、不可抗力；</p> <p>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；</p> <p>3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则投资或不投资而造成的损失等。</p> <p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。</p>
争议的处理和适用的法律	<p>各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。</p> <p>《基金合同》受中国法律管辖。</p>	<p>各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商、调解未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。</p> <p>《基金合同》受中国法律管辖并从其解释。</p>
基金合同的效力	<p>《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p>	<p>《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。</p>
<p>根据上述内容在“第二十三部分基金合同摘要”中相应修改和添加。</p>		

(二) 授权基金管理人修改基金合同等法律文件

除上述内容的调整需要修改基金合同以外，考虑到自《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》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》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转型后的东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的产品特征修订《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》的相关内容。

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现行有效的法律法规的规定及转型后的东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金的产品特性相应修订《基金合同》的内容。

(三) 东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同的生效

自本次基金份额持有人大会决议生效并公告之日起,由《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《东吴配置优化混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

综上所述,拟请基金份额持有人大会授权基金管理人针对上述事项修订基金合同内容,基金管理人完成基金合同内容修订并经基金托管人审核同意后,将报中国证监会备案。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

(一) 东吴配置优化混合型证券投资基金基本情况

东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金由东吴配置优化混合型证券投资基金变更而来。东吴配置优化混合型证券投资基金根据《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由东吴保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。

东吴保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可【2012】506号文核准,自2012年7月11日至2012年8月8日期间公开募集。募集有效认购总户数为9382户,募集资金及其产生的利息共计775,673,452.62元,折合基金份额775,673,452.62份。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,《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》于2012年8月13日生效。

(二) 东吴配置优化混合型证券投资基金转型并召开持有人大会的必要性

从维护投资者利益的角度来看,为了优化基金的投资目标与投资策略,维护基金份额持有人利益,东吴配置优化混合型证券投资基金转型为东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金,放宽了投资范围和投资比例的限制,提高了产品的市场竞争力。

因此,东吴配置优化混合型证券投资基金的转型将有利于帮助投资者参与资本市场,分享中国资本市场成长果实,为投资者提供更多样化的理财产品。

(三) 东吴配置优化混合型证券投资基金转型的可行性

1、法律可行性

根据《基金合同》约定,可以通过召开基金份额持有人大会的方式,变更基金类别、基

金投资目标、投资范围或投资策略以及对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。按照《基金合同》的要求，基金份额持有人大会决议的一般决议，经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效。

因此，本基金《基金合同》的修改不存在法律方面的障碍。

2、技术运作可行性

本次对《基金合同》的修改主要是对基金的投资范围进行了修改，基金管理人在混合型基金方面拥有多年投资、运营、风控经验，相关系统不存在技术操作上的障碍。

另外本次转型不涉及基金管理人、基金托管人和注册登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

四、本基金转型的主要风险及预备措施

（一）预防转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范转型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，在履行相关程序后对转型方案进行适当修订，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。

如转型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转型方案议案。

（二）预防基金转型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，避免基金转型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、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：东吴基金管理有限公司

联系电话：4008210588

传真：021-50509884

网站：www.scfund.com.cn

东吴基金管理有限公司

2017年11月21日