

## 新华基金管理股份有限公司关于修订新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同的公告

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金（基金代码：519167；以下简称本基金）成立于2014年6月18日，基金管理人为新华基金管理股份有限公司（以下简称本公司或基金管理人），基金托管人为中国农业银行股份有限公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金为保本基金，第三个保本周期为2016年7月26日至2018年1月26日。在第三个保本周期到期后，若本基金未能符合保本基金存续条件，将按《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）的约定转型为非保本的股票型证券投资基金，基金名称相应变更为新华精选低波动股票型证券投资基金。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后公告，并在更新的基金招募说明书中予以说明。

变更后基金合同、托管协议和招募说明书将分别修订为《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》、《新华精选低波动股票型证券投资基金托管协议》和《新华精选低波动股票型证券投资基金招募说明书》，调整的内容包括但不限于保留并适用基金合同关于变更后的新华精选低波动股票型证券投资基金的基金名称、投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等条款的约定，并根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等现行有效的法律法规规定对基金合同相应条款进行更新及在对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下对基金合同的其他条款进行了修订。

自2018年2月3日起，修订后的《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效，《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金变更为新华精选低波动股票型证券投资基金。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

新华精选低波动股票型证券投资基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、基金费率、收益分配、业务开通情况、销售机构及其他具体操作事宜按照该基金基金合同及招募说明书等相关规定进行运作，详见刊登在本公司网站（[www.ncfund.com.cn](http://www.ncfund.com.cn)）上的《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》、《新华精选低波动股票型证券投资基金托管协议》及《新华精选低波动股票型证券投资基金招募说明书》。

特此公告。

新华基金管理股份有限公司

2018年1月25日

附件：

《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同修改前后对照表》

章节 修改前内容 修改后内容

全部 媒体 媒介

第一部分

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》）、《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》）、《关于保本基金的指导意见》（以下简称《指导意见》）和其他有关法律法规。

二、

基金投资人投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

投资人购买本基金份额的行为视为同意保证合同或风险买断合同的约定。

三、新华鑫安保本一号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的注册,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。

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》)、《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》)、《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。

二、

三、新华精选低波动股票型证券投资基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而来,新华鑫安保本一号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。

中国证监会对新华鑫安保本一号混合型证券投资基金募集的注册及其转型为新华精选低波动股票型证券投资基金的备案,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。

第二部分释义 1、基金或本基金:指新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

4、保证人、担保人:指与基金管理人签订保证合同,为基金管理人基金份额持有人的保本金额承担的保本清偿义务提供不可撤销的连带责任保证的机构。本基金第三个保本周期由瀚华担保股份有限公司作为保证人,为本基金第三个保本周期的保本提供连带责任保证

5、保本义务人:与基金管理人签订风险买断合同,为本基金的某保本周期

(第一个保本周期除外)承担保本偿付责任的机构

6、基金合同或本基金合同:指《新华鑫安保本一号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

7、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《新华鑫安保本一号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

8、招募说明书:指《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

9、基金份额发售公告:指《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金份额发售公告》

11、《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,自2004年6月1日起实施,并经2012年12月28日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的《中华人民共和国证券投资基金法》及其后颁布机关对其不时做出的修订

23、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

29、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

31、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

33、保本周期:

51、保本赔付差额:指持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于保本金额的差额部分

57、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

60、保证合同:指基金管理人和保证人签订的《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金保证合同》

62、保本周期到期后基金的存续形式:指保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本周期;否则,本基金转型为非保本的股票型证券投资基金,基金名称相应变更为新华精选低波动股票型证券投资基金。如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求,则本基金将根据本基金合同的规定终止

65、巨额赎回：在到期操作期间，指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一日基金总份额的 20%；在本基金变更为新华精选低波动股票型证券投资基金后，指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

1、基金或本基金：指新华精选低波动股票型证券投资基金，本基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而来

4、基金合同或本基金合同：指《新华精选低波动股票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《新华精选低波动股票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《新华精选低波动股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

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，经 2012 年 12 月 28 日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

13、《流动性风险管理规定》：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

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

27、基金合同生效日：指《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效日

39、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

40、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等

第三部分基金的基本情况 一、基金名称

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金

二、基金的类别

混合型证券投资基金

三、基金的运作方式

契约型开放式

本基金以定期开放的方式运作，即在基金保本周期内采取封闭式运作（保本周期到期日除外），期间不开放申购、赎回及转换转入转出业务；到期操作期间开放赎回和转换转出业务，不开放申购和转换转入业务；过渡期只可进行过渡期申购，不开放赎回、转换转出业务。

四、基金的投资目标

综合运用投资组合保险策略，严格控制风险，在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。

五、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

六、基金募集规模上限

30 亿元人民币（不包括募集期利息）。本基金募集期内规模控制的具体办法详见基金份额发售公告。

七、基金份额发售面值和认购费用

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。

## 九、基金的保本

### 十二、基金保本周期 一、基金名称

新华精选低波动股票型证券投资基金

### 二、基金的类别

股票型证券投资基金

### 三、基金的运作方式

契约型开放式

### 四、基金的投资目标

在具有低波动率特质的股票组合中，精选价值低估且质地优良的上市公司进行重点投资，力求在有效控制风险的前提下，实现基金净值增长率持续稳定的超越业绩比较基准。

## 第四部分基金份额的发售 第四部分基金份额的发售

### 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

### 三、基金份额认购金额的限制 整章删除，替换为：

## 第四部分基金的历史沿革

新华精选低波动股票型证券投资基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而成。

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2014 年 4 月 2 日经中国证监会证监许可[2014]351 号文准予募集注册，基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金自 2014 年 5 月 26 日至 2014 年 6 月 13 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会机构部函[2014]552 号确认，《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 18 日生效。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的约定，保本周期届满时，若新华鑫安保本一号混合型证券投资基金未能符合保本基金存续条件，则转型为非保本的股票型证券投资基金，基金名称相应变更为新华精选低波动股票型证券投资基金。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 1 月 26 日第三个保本周期到期不符合保本基金存续条件，2018 年 2 月 3 日起新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金，《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效。

## 第五部分基金备案 第五部分基金备案

### 一、基金备案的条件

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模 第五部分基金的存续

### 一、基金的变更登记

《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效后，基金管理人负责办理基金份额的变更登记。基金管理人根据生效日的基金份额持有人名册，进行基金份额更名以及必要的信息变更，并对投资者持有的基金份额予以确认或重新登记。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

第六部分基金份额的申购与赎回 本基金保本周期内不开放申购、赎回及转换业务（保本周期到期日除外），即本基金仅在到期操作期间和过渡期开放申购与赎回，并在变更为新华精选低波动股票型证券投资基金后开放日常申购与赎回。

### 一、本基金在到期操作期间和过渡期的申购与赎回

### 二、本基金变更为新华精选低波动股票型证券投资基金后的申购与赎回

#### （五）申购和赎回的数量限制

#### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途



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。

#### (七)拒绝或暂停申购的情形

6、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项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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。

#### (八)、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

#### (九)巨额赎回的情形及处理方式

#### 2、巨额赎回的处理方式

##### (五) 申购和赎回的数量限制

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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

#### (六)申购和赎回的价格、费用及其用途

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。

#### (七)拒绝或暂停申购的情形

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%比例要求的情形时。

7、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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

8、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、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的申购申请时，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全部或部分拒绝的，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。

#### (八)、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

5、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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

#### (九)巨额赎回的情形及处理方式

#### 2、巨额赎回的处理方式

(3) 在出现巨额赎回时，对于单个基金份额持有人当日超过上一日基金总份额10%以上的赎回申请，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，之后对该单个基金份额持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请根据前段(1)全额赎回或(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。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。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

### 第七部分基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人

#### (一) 基金管理人简况

联系电话：010-68726666

(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：

(16) 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、转换和非交易过户的业务规则；

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；

(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；

(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；

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：刘士余

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； 一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

联系电话：010-68779666

(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：

(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；

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申购、赎回和登记事宜；

(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；

(24)删除。

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

三、基金份额持有人

(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；

第八部分基金份额持有人大会 一、召开事由

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但在保本周期到期后依据《基金合同》变更为新华精选低波动股票型证券投资基金并按《基金合同》约定的新华精选低波动股票型证券投资基金的管理费率和托管费率计提管理费和托管费以及法律法规要求提高该等费率标准的除外；

(6) 变更基金类别，但在保本周期到期后根据《基金合同》约定变更为新华精选低波动股票型证券投资

基金除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本周期到期后在《基金合同》规定范围内变更为新华精选低波动股票型证券投资基金并按《基金合同》约定的新华精选低波动股票型证券投资基金的投资目标、范围或策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；

(12) 在某一保本周期内，更换担保人或保本义务人，但担保人或保本义务人因歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产或其他足以影响继续履行担保责任能力的情况除外；

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：

(6) 保本周期内，当确定担保人出现足以影响继续履行保证责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况下，基金管理人更换新的担保人；

(7) 某一保本周期结束后更换下一保本周期的担保人或保本义务人；

(8) 保本周期到期后本基金转型为非保本基金新华精选低波动股票型证券投资基金，并由此变更基金的投资目标、投资范围、投资策略；

六、表决

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等费率标准的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

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：

六、表决

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

第十一部分基金份额的登记 四、基金登记机构的义务

3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上； 四、基金登记机构的义务

3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；

第十二部分保本、保本的保证及保本周期到期 整章删除。

第十三部分基金的投资 第十三部分基金的投资

保本周期的投资：

转型为新华精选低波动股票型证券投资基金后的投资目标、范围、理念、策略：

二、投资范围

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 8095%，其中投资于本基金界定的低波动率股票的比例不低于非现金资产的 80%，债券投资占基金资产的比例范围为 020%；本基金保持现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

四、投资限制

1、组合限制

(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；

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 个工作日内进行调整。法律法规另有规

定的，从其规定。第十二部分基金的投资

保本周期的投资部分整体删除。

## 二、投资范围

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%，其中投资于本基金界定的低波动率股票的比例不低于非现金资产的 80%，债券投资占基金资产的比例范围为 0-20%；本基金保持现金或者到期日在 1 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、应收申购款等。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

(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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(15) 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票，不得超过该上市公司可流通股票的 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票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

(17) 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；

(18) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

除上述第 (2)、(12)、(16)、(17) 项之外，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。法律法规另有规定的，从其规定。

## 第十五部分基金资产估值 三、估值方法

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(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；

### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(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、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。

## 四、估值程序

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 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

## 六、暂停估值的情形 三、估值方法

### 1、证券交易所上市的有价证券的估值



(2) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，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，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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固定收益品种按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全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，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全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；

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(3) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，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、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

#### 四、估值程序

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。

#### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

#### 六、暂停估值的情形

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，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

#### 第十六部分基金费用与税收 1、基金管理人的管理费

本基金采取固定及浮动相结合的管理费收取方式。即本基金在保本周期内收取固定管理费，在保本周期到期日收取浮动管理费。

M为该保本周期所适用的浮动管理费率。

3、基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金后，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： 1、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：

#### 第十七部分基金的收益与分配 三、基金收益分配原则

##### 2、本基金收益分配方式：

(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

(2) 转型后：基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金后：基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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；投资者在不同销售机构可以选择不同的收益分配方式；在同一销售机构只能选择一种收益分配方式，基金登记机构将以投资者最后一次选择的收益分配方式为准；

#### 六、基金收益分配中发生的费用

1、在保本周期内，本基金红利分配时发生的银行转账或其他手续费用由基金管理人承担。

2、基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金后，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。 三、基金收益分配原则

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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；投资者在不同销售机构可以选择不同的收益分配方式；在同一销售机构只能选择一种收益分配方式，基金登记机构将以投资者最后一次选择的收益分配方式为准；

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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。

### 第十八部分基金的会计与审计 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

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； 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；

### 第十九部分基金的信息披露 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体上；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。

基金募集申请经中国证监会注册后，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》摘要登载在指定媒体上；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。

#### （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体上。

#### （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在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在保本周期内（除保本周期到期日外），基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。在到期操作期间及过渡期内，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。

在本基金变更为新华精选低波动股票型证券投资基金后，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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

#### （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。

#### （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

#### （七）临时报告

4、更换基金管理人、基金托管人、保证人或变更保本保障机制；

## 7、基金募集期延长；

### 26、与保本周期到期相关事项的公告；

#### （十一）保证合同

保证合同作为保本基金的基金合同、招募说明书的附件，随基金合同、招募说明书一同公告。 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。

#### （二）基金资产净值、基金份额净值

基金管理人应当每个开放日的次日，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。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

#### （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。

#### （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达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者权益，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定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，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。

#### （五）临时报告

### 4、更换基金管理人、基金托管人；

### 25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；

## 第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 一、《基金合同》的变更

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议报中国证监会备案生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒体公告。 一、《基金合同》的变更

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

第二十二部分基金合同的效力 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。

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（或盖章）并经中国证监会备案。