# 国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金召开基金份 额持有人大会的第一次提示性公告

国投瑞银基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")已于 2018 年 5 月 11 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、基金管理人网站(www.ubssdic.com)发布了《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金召开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,现将具体事宜提示如下:

一、召开基金份额持有人大会的基本情况

国投瑞银基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")依据中国证监会证监许可【2015】1788号文注 册募集的国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同于2015 年 11 月 27 日生效。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 律法规和《国投瑞银新成长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,基金管理人与本基金的托管人上海浦东发展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(以下简称"会议"),会议的具体安排如下:

- 1、会议召开方式:通讯方式。
- 2、会议投票表决起止时间: 自 2018 年 5 月 11 日起,至 2018 年 6 月 11 日 15:00 止(以本次大会公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准,专人送交的以实际递交时间为准)。
- 二、会议审议事项

《关于国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册相关事项的议案》(见附件一)。

三、本次会议的权益登记日

2

本次会议的权益登记日为 2018 年 5 月 18 日,即在权益登记日证券交易所交易结束后,在登记机构登记在 册的本基金全体基金份额持有人,均有权参加本次基金份额持有人大会并表决。

## 四、投票方式

- 1、本次会议表决票见附件二;
- 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单位公章、经授权或认可的业务章(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);或者由授权代表在表决票上签字,并提供该授权代表的身份证件正反面复印件、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机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及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) 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),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;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。
- (4)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(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) 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)。合格境外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,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)。
- 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 2018 年 5 月 11 日起,至 2018 年 6 月 11 日 15:00 以前(以本次大会公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准,专人送交的以实际递交时间为准),通过专人送交或邮寄至本次持有人会议专用信箱:

[收件人: 马丽娅 地址: 北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心 815 室 国投瑞银基金 邮编: 100033 联系电话: 010-66555550-1832]

请在信封表面注明: "国投瑞银新成长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、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(上海浦东发展银行股份有限公司)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:

4

- (1) 表决票填写完整清晰,所提供文件符合本会议公告规定,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(授权委托书中联系电话虽未填写但不影响认定基金份额持有人及代理人身份的,不影响授权和表决效力);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填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾,但其他各项符合会议公告规定的,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代理人经有效授权的证明文件、材料的,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:
- 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,邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

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,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 1/2(含 1/2):

- 2、《关于国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册相关事项的议案》经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、本次基金份额持有人大会的决议,本基金管理人自通过之日起 5 日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

5

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》及《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本次基金份额持有人大会需要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 1/2(含 1/2)。如参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会,应当有代表 1/3 以上(含 1/3)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。

八、本次会议相关机构

1、召集人: 国投瑞银基金管理有限公司

联系人:杨蔓

联系电话: 400-880-6868、0755-83575992

传真: 0755-82904007

网址: http://www.ubssdic.com

- 2、基金托管人: 上海浦东发展银行股份有限公司
- 3、公证机关:北京市长安公证处
- 4、律师事务所: 上海源泰律师事务所

九、重要提示

- 1、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 400-880-6868 咨询。
- 2、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。

6

- 3、基金管理人可按照《基金合同》约定的情形暂停接受投资人的申购、转换转入申请,具体详见基金管理人届时发布的相关公告。
- 4、本公告的有关内容由国投瑞银基金管理有限公司负责解释。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一八年五月十四日

附件一:《关于国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册相关事项的议案》

附件二:《国投瑞银新成长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》

附件三:《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会代理投票授权委托书》

附件四:《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册事项对法律文件的修改说明》

7

附件一:

关于国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金

变更注册相关事项的议案

国投瑞银新成长灵活配置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《国投瑞银新成长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,本基金管理人经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致,提议对国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")进行变更注册,拟调整本基金的管理费率,修改投资范围、投资限制、估值方法等,另增加自动清盘条款,并相应修订基金合同。

具体说明见附件四《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册事项对法律文件的修改说明》

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对《基金合同》进行修改;本基金的招募说明书及托管协议也将相应进行必要的修改和更新。

以上议案,请予审议。

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一八年五月十一日

8

附件 二: 表决票

国投瑞银新成长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/名称

证件类型

身份证 / 其他(请填写证件类型):

证件号码

联系电话

审议事项

《关于国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册相关事项的议案》

表决意见

同意

反对

弃权

基金份额持有人/代理人签名或盖章

年月日

说明:

- 1、因公证工作的需要,请您准确填写联系电话;
- 2、请以打"√"方式选择表决意见;
- 3、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;
- 4、必须选择一种且只能选择一种表决意见;
- 5、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾,但其他各项符合会议公告规定的,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。

9

附件三: 附件三: 附件三: 代理投票授权委托书 代理投票授权委托书 代理投票授权委托书 代理投票授权委托书 代理投票

国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会

代理投票授权委托书

委托人姓名/名称

委托人证件类型

身份证 / 其他(请填写证件类型):

证件号码

委托人联系电话

代理人姓名/名称

代理人证件类型

身份证 / 其他(请填写证件类型): \_\_\_

证件号码

代理人联系电话

兹授权 代为行使国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会投票权利,并对《关于国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册相关事项的议案》按如下意见表决(请以打"√"方式选择):

同意

反对

授权代理人表态

授权有效期自 2018 年 5 月 11 日起至 2018 年 6 月 11 日止。

若国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的,除非本授权文件另有载明或重新授权,本授权继续有效。

特此授权。

委托人(签名/盖章):

授权日期: 年月日

说明:

- 1、因公证工作的需要,请您准确填写联系电话;
- 2、个人投资者委托代理人投票的,应由委托人填妥并签署授权委托书原件,同时提供与基金账户开立时一致的个人身份证明文件正反面复印件; 机构投资者委托代理人投票的,应由委托人填妥授权委托书原件并在授权委托书上加盖该机构公章,同时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有权部门的批文、开户证明或其他类型的登记证书复印件); 合格境外机构投资者委托代理人投票的,应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,以及填妥的授权委托书原件;
- 3、基金份额持有人授权意见代表所持全部基金份额的授权意见;
- 4、必须选择一种且只能选择一种授权意见,多选、未选视为选择"授权代理人表态";

10

- 5、基金份额持有人多次授权,且能够区分先后次序的,以最后一次授权为准;
- 6、持有人多次授权,无法区分授权次序,且授权意见不一致的,视为同意其授权的机构或个人为代理人, 并选择"授权代理人表态";
- 7、如本次基金份额持有人大会权益登记日,委托人未持有基金份额,则其授权无效。

11

附件四:

国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金变更注册事项

对法律文件的修改说明

国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于 2015 年 11 月 27 日成立,为维护基金持有人利益,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》(以下简称"基金法")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金管理人经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致,提议对本基金进行变更注册,拟调整本基金的管理费率,修改投资范围、投资限制、估值方法等,另增加自动清盘条

款,并对本基金的相关法律文件作相应修改,同时召开基金份额持有人大会就上述事项进行审议及表决。本基金对法律文件的修改内容如下:

一、《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修改对照表

章节

原《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》版本

修订后的《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》版本

内容

内容

第二部分 释义

- 9、《基金法》:指 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通过,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
- 9、《基金法》:指 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通过,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
- 32、工作日:指证券交易所(主要包括 、工作日:指证券交易所(主要包括 上海证券交易所、深圳) 上海证券交易所、深圳) 及 相关金融期货交易所 相关金融期货交易所 相关金融期货交易所 相关金融期货交易所 相关金融期货交易所 的正常交易日 的正常交易日
- 32 、工作日: 指证券交易所(主要包括 、工作日: 指证券交易所(主要包括 上海证券交易所、深圳)的 上海证券交易所、深圳)的 正常交易日

无

52 、摆动定价机制:指当本基金遭遇大 、摆动定价机制:指当本基金遭遇大 额申购赎回时,通过调整基金份净值 额申购赎回时,通过调整基金份净值 的方式,将基金调整投资组合市场冲 的方式,将基金调整投资组合市场冲 的方式,将基金调整投资组合市场冲 的方式,将基金调整投资组合市场冲 的方式,将基金调整投资组合市场冲 由成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 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 从而减少对存量基金份额持有人利益的 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受 不利影响,确保投资者的合法权益受

12

损害并得到公平对待 损害并得到公平对待 损害并得到公平对待 损害并得到公平对待 损害并得到公平对 待

第三部分 基金的基本情况

# 八、基金份额类别

在不对份额持有人权益产生实质性利 在不对份额持有人权益产生实质性利 影响的情况下, 根据基金实际运作影响的情况下, 根据基金实际运作在履行适当程序后,基 金管理人经与在履行适当程序后,基 金管理人经与金托管人协商一致,可以增加本基新 金托管人协商一致,可以增加本基新 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类别、 的基金份额类 现有基金份额类 现有基金份额 基金份额 基金份额 基金份额 基金份额 类别的销售 等,此项调整无需召开基金 ,此项调整无需召开基金 ,此项调整无需召开基金 ,此项调整无需召开基金 ,此项调整无需召开基金 ,此项调整无需召开基金 ,此项调整无需召开基金 ,此项调整无需召开基金 ,此项调整

无需召开基金 , 此项调整无需召开基金 份额持有人大会, 但须报中国证监备 份额持有人大会, 但须报中国证监备 案并提前公告。

#### 八、基金份额类别

在不对份额持有人权益产生实质性利 在不对份额持有人权益产生实质性利 影响的情况下, 根据基金实际运作影响的情况下, 根据基金实际运作在履行适当程序后,基 金管理人经与在履行适当程序后,基 金管理人经与金托管人协商一致,可以增加本基新 金托管人协商一致,可以增加本基新 的基金份额类别、或者停止 或者停止 或者停止 或者停止 现有基金份 额类别的 额类别的 额类别的 额类别的 额类别的 额类别的 额类别的 销售 、或者 调整 基金份额 分类 方法或规则 方法或规则 方法或规则 方法或规则 方法或规则 方法或规则 方法或规则 等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整无需召开基金等,此项调整

#### 第四部分 基金的历史沿革

第四部分 基金份额的发售 基金份额的发售 基金份额的发售 基金份额的发售

- 一、 基金份额的发售时间方式一、 基金份额的发售时间方式一、 基金份额的发售时间方式发售对象 发售对象 发售对象
- 1、发售时间 、发售时间 、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过三 自基金份额发售之日起最长不得超过三 自基金份额发售之日起最长不得超过三 个月,具体发售时间见基金份额公 个月,具体发售时间见基金份额公 个月,具体发售时间见基金份额公 告。

2、发售方式 、发售方式 、发售方式

通过各销售机构的基金网点公开发 通过各销售机构的基金网点公开发 通过各销售机构的基金网点公开发 售,各销机构的具体名单见基金份额 售,各销机构的具体名单见基金份额 售,各销机构的具体名单见基金份额 发售公告以及基金管理人届时布的变 发售公告以及基金管理人届时布的变 发售公告以及基金管理人届时布的变 更销售机构的相关公告。 更销售机构的相关公告。 更销售机构的相关公告。 更销售机构的相关公告。

3、发售对象 、发售对象 、发售对象

符合法律规定的可投资 于证券符合法律规定的可投资 于证券符合法律规定的可投资 于证券基金的个人投资者、机构和合格 基金的个人投资者、机构和合格 基金的个人投资者、机构和合格 境外机构投资者以及法律规或中国证 境外机构投资者以及法律规或中国证 境外机构投资者以及法律规或中国证 监会允许购买证券投资 基金的其他监会允许购买证券投资 基金的其他监会允许购买证券投资 基金的其他人。二、基金份额的认购 二、基金份额的认购 二、基金份额的认购 二、基金份额的认购

1、认购费用 、认购费用 、认购费用

本基金的认购费率在遵守相关 法规有本基金的认购费率在遵守相关 法规有本基金的认购费率在遵守相关 法规有最高额限制的规定前提下由基金管理 最高额限制的规定前提下由基金管理 最高额限制的规定前提下由基金管理 人决定,并在招募说明书中列示。基金 人决定,并在招募说明书中列示。基金 人决定,并在招募说明书中列示。基金 认购费 认购费 用不列入基金财产。 用不列入基金财产。 用不列入基金财产。 用不列入基金财产。

2、募集期利息的处理方式 、募集期利息的处理方式 、募集期利息的处理方式 、募集期利息的处理方式 、募集期利息的处理方式 、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将 有效认购款项在募集期间产生的利息将 有效认购款项在募集期间产生的利息将 折算为基金份额归持有人所 折算为基金份额归持有人所 折算为基金份额归持有人所 折算

为基金份额归持有人所 折算为基金份额归持有人所 有,其中利息转份额的具体数以登记 有,其中利息转份额的具体数以登记 机构的记录为准。 机构的记录为准。 机构的记录为准。 机构的记录为准。

3、基金认购份额的计算 、基金认购份额的计算 、基金认购份额的计算 、基金认购份额的计算 、基金 认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说 基金认购份额具体的计算方法在招募说 基金认购份额具体的计算方法在招募说 明书中列示。明书中列示。明书中列示。

4、认购份额余的处理方式 、认购份额余的处理方式 、认购份额余的处理方式 、认购份额余的处理方式 、认购份额余的处理方式 、认购份额余的处理方式

第四部分 基金的历史沿革 基金的历史沿革 基金的历史沿革 基金的历史沿革

国投 瑞银新成长灵活配置混合型证券国投 瑞银新成长灵活配置混合型证券国投 瑞银新成长灵活配置混 合型证券资基金经中国证监会 资基金经中国证监会 资基金经中国证监会 资基金经中国证监会 20152015 年 7月 28 日 证监许可 证监许可 证监许可 证监许可 [2015]1788 [2015]1788 号文注册募集,于 号文 注册募集,于 号文注册募集,于 号文注册募集,于 号文注册募集,于 号文注册募集,于 号文注册募 集,于 号文注册募集,于 2015 年 11 月 24 日至 20152015 年 11 月 25 日 公开发售,共募集 公开 发售, 共募集 公开发售, 共募集 公开发售, 共募集 公开发售, 共募集 229,780,420.63 229,780,420.63 份基金 份基金 份额。基金管理人国投瑞银有 份额。基金管理人国投瑞银有 份额。基金管理人国投瑞银 有 限公司向中国证监会办理完毕基金备案 限公司向中国证监会办理完毕基金备案 限公司向中国证监会 办理完毕基金备案 手续后,于 手续后,于 手续后,于 手续后,于 2015 年 11 月 27 日获得书面 日 获得书面 日获得书面 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混合型 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混合 型 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混合型 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混合型 确认,《国投瑞 银新成长灵活配置混合型 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混合型 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混 合型 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混合型 确认,《国投瑞银新成长灵活配置混合型 证券投资基金 合同》自该日起生效。 证券投资基金合同》自该日起生效。 证券投资基金合同》自该日起生效。 证券 投资基金合同》自该日起生效。 证券投资基金合同》自该日起生效。 证券投资基金合同》自该日起生效。 证券投资基金合同》自该日起生效。证券投资基金合同》自该日起生效。

2018 年 5 月 11 日至 2018 2018 年 6 月 11 日, 国投 瑞银新成长灵活配置混合型证券国投 瑞银新成长灵活配置混合型证券国投 瑞银新成长灵活配置混合型证券资基金召开份额持有人大会,议 资基金召开份额持有人大会,议 资基金召开份额持有人大会,议 审议通过了《关于国投瑞银新成长灵活 审议通过了《关于国投瑞银新成长灵活 审议通过了《关于国投瑞银新成长灵活 审议通过了《关于国投瑞银新成长灵活 审议通过了《关于国投瑞银新成长灵活 配置混合型证券投资基金变更注册相关 配置混合型证券投资基金变更注册相关 事项的 议案》,内容包括:调整本基金事项的 议案》,内容包括:调整本基金管理费率,同时修改投资范围、限 管理费率,同时修改投资范围、限 管理费率,同时修改投资范围、限 管理费率,同时修改投资范围、限 管理费率,同时修改投资范围、限 制、估值方法等内容,并相应修订基金制、估值方法等内容,并相应修订基金制、估值方法等内容,并相应修订基金制、估值方法等内容,并相应修订基金制、估值方法等内容,并相应修订基金制、估值方法等内容,并相应修订基金,表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。表决通过之日起生效。

根据基金份额持有人大会决议,修订后 根据基金份额持有人大会决议,修订后 根据基金份额持有人大会

决议,修订后 的《国投瑞银新成长灵活配置混合型证 的《国投瑞银新成长灵活配置混合型证 的《国投瑞银新成长灵活配置混合型证 的《国投瑞银新成长灵活配置混合型证 券投资基金合同》自表决通过之日 券投资基金合同》自表决通过之日 起生效。 起生效。 起生效。

13

认购份额的计算保留到小数点后 认购份额的计算保留到小数点后 认购份额的计算保留到小数点后 认购份额的计算保留到小数点后 认购份额的计算保留到小数点后 2位, 小数点 小数点 2位以后的部分四舍五入,由此 位以后的部分四舍五入,由此 位以后的部分四舍五入,由此 位以后的部分四舍五入,由此 误差产生的收益或损失由基金财承 报

- 5、认 购申请的确、认 购申请的确、认 购申请的确、认
- 购申请的确销售机构对认购申请的受理并不代表该 销售机构对认购申请的受理并不代表该 销售机构对认购申请的受理并不代表该 申请一定成功,而仅代表销售机构确实 申请一定成功,而仅代表销售机构确实 申请一定成功,而仅代表销售机构确实 接收到认购申请。的确以登记机 接收到认购申请。的确以登记机 接收到认购申请。的确以登记机 接收到认购申请。的确以登记机 核的确认 结果为准。对于购申请及构的确认 结果为准。对于购申请及构的确认 结果为准。对于购申请及购份额的确认情况,投资人应及时查询 购份额的确认情况,投资人应及时查询 购份额的确认情况,投资人应及时查询 并妥善行使合法权利。 并妥善行使合法权利。 并妥善行使合法权利。
- 三、基金份额认购的限制 三、基金份额认购的限制 三、基金份额认购的限制 三、基金份额认购的限制 三、基金份额认购的限制 三、基金份额认购的限制
- 1、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 、投资人认购时,需按销售机构规定的 方式全额缴款。 方式全额缴款。 方式全额缴款。
- 2、基金管理人可以对每个交易账户 、基金管理人可以对每个交易账户 、基金管理人可以对每个交易账户 、基金管理人可以对每个交易账户 、基金管理人可以对每个交易账户 、基金管理人可以对每个交易账户 的单笔最低认购金额进行限制,具体的单笔最低认购金额进行限制,具体的单笔最低认购金额进行限制,具体的单笔最低认购金额进行限制,具体制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。制请参看招募说明书或相关公告。
- 3、基金管理人可以对募集期间的单个投 、基金管理人可以对募集期间的单个投 、基金管理人可以对募集期间的单个投 、基金管理人可以对募集期间的单个投 、基金管理人可以对募集期间的单个投 、基金管理人可以对募集期间的单个投 、基金管理人可以对募集期间的单个投 、基金管理人可以对募集期间的单个投 资人的累计认购金额进行限 制,具体资人的累计认购金额进行限 制,具体资人的累计认购金额进行限 制,具体资人的累计认购金额进行限 制,具体制和处理方法请参看招募说明书或相关 制和处理方法请参看招募说明书或相关 制和处理方法请参看招募说明书或相关 公告。公告。
- 4、基金投资人在募集期 、基金投资人在募集期 、基金投资人在募集期 、基金投资人在募集期 、基金 投资人在募集期 、基金投资人在募集期 内可以多次 内可以多次 认购基金份额。费按每笔申请 认购基 金份额。费按每笔申请 认购基金份额。费按每笔申请 单独计算。 认购一经受理不得撤销单独计算。 认

购一经受理不得撤销单独计算。 认购一经受理不得撤销单独计算。 认购一经受理不得撤销单独计算。 认购一经受理不得撤销单独计算。

认购一经受理不得撤销第五部分 基金的存续

第五部分 基金备案 基金备案 基金备案

一、基金备案的条件 一、基金备案的条件 一、基金备案的条件 一、基金备案的条件 一、基金备案的条件

本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基 金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自 份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额 发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售 之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日起三个月 本基金自份额发售之日 起三个月 内,在基金募集份额总不少于 内,在基金募集份额总不少于 内,在基金募集份额总不少于 内, 在基金募集份额总不少于 内,在基金募集份额总不少于 内,在基金募集份额总不少于 内,在基金募集 份额总不少于 内,在基金募集份额总不少于 2 亿份, 亿份, 基金募集额不少于 基金募集额不少于 基 金募集额不少于 基金募集额不少于 2亿元人民币且基 亿元人民币且基 亿元人民币且基 亿元人民币且 基 金认购人数不少于 金认购人数不少于 金认购人数不少于 金认购人数不少于 200 200 人的条件下,基 人的条件下,基 人的条件下,基 人的条件下,基 金募集期届满或者基管理人依据法律 金募集期届满或 者基管理人依据法律 金募集期届满或者基管理人依据法律 法规及招募说明书可以决定停止基金发 法规 及招募说明书可以决定停止基金发 法规及招募说明书可以决定停止基金发 售,并在 售,并在 售,并在 10 日内聘请法定验资机构, 日内聘请法定验资机构, 日内聘请法定验资机构, 日内聘请法定验资机构, 日内聘请法定验资机构, 日内聘请法定验资机构, 自收到验资报告之日起 自收到验资报告之日起 自 收到验资报告之日起 自收到验资报告之日起 自收到验资报告之日起 10 日内,向中国 日内,向中国 日 内,向中国 证监会办理基金备案手续。 证监会办理基金备案手续。 证监会办理基金备案手续。 证监会 办理基金备案手续。 证监会办理基金备案手续。 证监会办理基金备案手续。

第五部分 基金的存续 基金的存续 基金的存续

《基金合同》生效后,连续 《基金合同》生效后,连续 《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 基金管理人应当在定期报告中予以披

期报告中予以披 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,本基金合同将终止并进行财产清 本基金合同将终止并进行财产清 有基金合同将终止并进行财产清 有基金合同将终止并进行财产清 有基金合同将终止并进行财产清 有工需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会算,且无需召开基金份额持有人大会同时基金管理人应履行相关的监报告。和信息披露程序。和信息披露程序。和信息披露程序。

14

二、基金合同不能生效时募集资的处 二、基金合同不能生效时募集资的处 二、基金合同不能生效时募集资的处 理方式 理方式

如果募集期限届满,未足生效条 如果募集期限届满,未足生效条 如果募集期限届满,未足生效条 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任: 件,基金管理人应当承担下列责任:

- 1、以其固有财产承担因募集行为而生 、以其固有财产承担因募集行为而生 、以其固有财产承担因募集 行为而生 、以其固有财产承担因募集行为而生 、以其固有财产承担因募集行为而生 、以其固有财产承 担因募集行为而生 、以其固有财产承担因募集行为而生 、以其固有财产承担因募集行为而生 的债务和 费用; 的债务和费用; 的债务和费用; 的债务和费用;
- 2、在基金募集期限届满后 、在基金募集期限届满后 、在基金募集期限届满后 、在基金募集期限届满后 、在基金募集期限届满后 、在基金募集期限届满后 30 日内返还 日内返还 投资人已缴纳的款项,并加计银行同期 投资人已缴纳的款项,并加计银行同期 投资人已缴纳的款项,并加计银行同期 存款利息;存款利息;存款利息;
- 3、如基金 募集失败,管理人、如基金 募集失败,管理人、担金 托管人及销售机构不得请求报酬。基金 托管人及销售机构不得请求报酬。基金 托管人及销售机构为管理人、基金 托和销售机构为管理人、基金 托和销售机构为管理人、基金 托和销售机构为管理人、基金 托和销售机构为等集支付之一切费用应由各方自承 募集支付之一切费用应由各方自承 担。

三、基金存续期内的份额持有人数 三、基金存续期内的份额持有人数 三、基金存续期内的份额持有人数 量和资产规模 和资产规模

《基金合同》生效后,连续 《基金合同》生效后,连续 《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 基金管理人应当在定期报告中予以披

期报告中予以披 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, 基金管理人应当向中国证监会报告并提 基金管理人应当向中国证监会报告并提 基金管理人应当向中国证监会报告并提 基金管理人应当向中国证监会报告并提 基金管理人应当向中国证监会报告并提 出解决方案,如转换运作式、与其他 出解决方案,如转换运作式、与其他 出解决方案,如转换运作式、与其他 出解决方案,如转换运作式、与其他 出解决方案,如转换运作式、与其他 出解决方案,如转换运作式、与其他 基金合并或者终止同等,召开 基金合并或者终止同等,召开 基金合并或者终止同等,召开 基金合并或者终止同等,召开 基金份额持有人大会进行表决。 基金份额持有人大会进行表决。 基金份额持有人大会进行表决。 基金份额持有人大会进行表决。 基金份额持有人大会进行表决。

第六部分 基金份额的申购与赎回

六、申购和赎回的价格费用及其途

- 1、……本基金两类份额净值的计 算,均保留到小数点后 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。……
- 7、基金管理人及其他销售机构可以根据 、基金管理人及其他销售机构可以根据 市场情况对基金销售费用实行一定的优 市场情况对基金销售费用实行一定的优 惠,并履行必要的报备和信息披露手续。 惠,并履行必要的报备和信息披露手续。

六、申购和赎回的价格费用及其途

- 1、······本基金两类份额净值的计 算,均保留到小数点后 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。······
- 7、在对现有基金份额持人利益无实质 对现有基金份额持人利益无实质 对现有基金份额持人利益无实质 对现有基金份额持人利益无实质 对现有基金份额持人利益无实质 对现有基金份额持人利益无实质 对现有基金份额持人利益无实质 对现有基金份额持人利益无实质 性不利影响的情况下, 基金管理人及其 基金管理人及其 基金管理人及其 基金管理人及其 基金管理人及其 基金管理人及其 基金管理人及其 基金管理人及其 电销 售机构可以根据市场情况对基金他销 售机构可以根据市场情况对基金售费用实行一定的 优惠,并履必要售费用实行一定的 优惠,并履必要报备和信息披露手续。
- 8、当本基金发生大额申购或赎回情形 时,基金管理人可以采用摆动定价机制 时,基金管理人可以采用摆动定价机制 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 以确保基金估值的公平性。具体处理原 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以及监则与操作规范遵循相关法律以及监则与操作规范遵循相关法律以及监管部门、自律规则的定。管部门、自律规则的定。管部门、自律规则的定。管部门、自律规则的定。管部门、自律规则的定。管部门、自律规则的定。

八、拒绝或暂停申购的情形

3、证券 、证券 、期货 、期货 、期货 交易所时间非正常停 交易所时间非正常停 市,导致基金 管理 人无法计算当日市,导致基金 管理人无法计算当日资产净值。

八、拒绝或暂停申购的情形

3、证券交易所时间非正常停市,导 、证券交易所时间非正常停市,导 、证券交易所时间非正常停市,导 致基金管理人无法计算当日资产净 致基金管理人无法计算当日资产净 值。

15

- 九、暂停赎回或延缓支付款项的情 九、暂停赎回或延缓支付款项的情 形
- 3、证券 、证券 、期货 、期货 、期货 交易所时间非正常停 交易所时间非正常停 市,导致基金 管理 人无法计算当日市,导致基金 管理人无法计算当日资产净值。
- 九、暂停赎回或延缓支付款项的情 九、暂停赎回或延缓支付款项的情 形
- 3、证券交易所时间非正常停市,导 、证券交易所时间非正常停市,导 、证券交易所时间非正常停市,导 致基金管理人无法计算当日资产净 致基金管理人无法计算当日资产净 值。
- 十、巨额赎回的情形及处理方式
- 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,管理人可 当基金出现巨额赎回时,管理人可 以根据基金当时的资产组合状况决定全 以根据基金当时的资产组合状况决定全 额赎回 或部分延期赎回。 部分延期赎回。

- 十、巨额赎回的情形及处理方式
- 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,管理人可 当基金出现巨额赎回时,管理人可 以根据基金当时的资产组合状况决定全 以根据基金当时的资产组合状况决定全 额赎回 、部分延期赎回 或暂停赎回 或暂停赎回 或暂停赎回 或暂停赎回 。

十六、基金的冻结解与质押

• • • • •

如相关法律规允许基 金管理人办如相关法律规允许基 金管理人办金份额的质押业务或其他基 ,金份额的质押业务或其他基 ,金管理人将制定和实施相应的业务规 金管理人将制定和实施相应的业务规 见

十六、基金的冻结解与质押

....

第七部分 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:
- (13) 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券、转融通;
- 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: 第八部分 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,法律法规、中国证监会或《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(根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外);
- 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:
- (1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费或其他应由基金承担的费用;

(7) 在法律法规规定或中国证监会许可的范围内,在不对份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下,基金推出新业务或服务;

#### 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,法律法规、中国证监会或《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(根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外);
- 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:
- (1) 调低销售服务费或其他应由基金承担的费用;
- (7) 在法律规定或中国证监会许可 ) 在法律规定或中国证监会许可 的范围内,在不对份额持有人权益产生 的范围内,在不对份额持有人权益产生 实质性不利影响的情况下, 在履行适当 程序后, 程序后, 基金推出新业务或服; 基金推出新业务或服;

六、表决

六、表决

16

- 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 2/3 以上(含 2/3)通过方可做出。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》、与其他基金合并应当以特别决议通过方为有效。
- 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 2/3 以上(含 2/3)通过方可做出。除本基金合同另有规定外,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》、与其他基金合并应当以特别决议通过方为有效。

第十二部分 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,包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他 经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债 (含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、 货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但 须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资短期融资券之外的单个债券的久期不超过 3 年,信用等级需在 AA+级或以上。

# 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,包括国内依法上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券)、资产支持证券、银行存款、同业存单、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它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,

其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

三、投资策略

# 2、债券投资策略

.....

对于 资产支持证券 ,其 定价受市场利率、 发行条款、标的资产构成及质量提 发行条款、标的资产构成及质量提 前偿还率等多种因素影响。本基金将在 前偿还率等多种因素影响。本基金将在 基本面分析和债券市场宏观的础 基本面分析和债券市场宏观的础 上,以数量化模型确定其内在价值。

(四)衍生品投资策略 (四)衍生品投资策略 (四)衍生品投资策略 (四)衍生品投资策略 (四)衍生品投资策略

为更好地实现投资目标,本基金在注重 为更好地实现投资目标,本基金在注重 为更好地实现投资目标,本基金在注重 风险管理的前提下, 以套期保值为目风险管理的前提下, 以套期保值为目适度运用股指期货、国债等金融行 适度运用股指期货、国债等金融行 适度运用股指期货、国债等金融行 生品。本基金利用融行合约流动 生品。本基金利用融行合约流动 生品。本基金利用融行合约流动

三、投资策略

# 2、债券投资策略

. . . . . .

- (五)中小企业私募债券投资策略 (五)中小企业私募债券投资策略 (五)中小企业私募债券投资策略
- (五)中小企业私募债券投资策略 (五)中小企业私募债券投资策略 (五)中小企业私募债券投资策略
- (五) 中小企业私募债券投资策略

•••••

(六)资产支持证券投策略 (六)资产支持证券投策略 (六)资产支持证券投策略 (六)资产支持证券投策略 (六)资产支持证券投策略 (六)资产支持证券投策略

资产支持证券 的定价受市场利率、发行 定价受市场利率、发行 条款、标的资产构成及质量提前偿 条款、标的资产构成及质量提前偿 还率等多种因素影响。本 基金将在还率等多种因素影响。本 基金将在面分析和债券市场宏观的基础上, 面分析和债券市场宏观的基础上, 以数量化模型确定其内在价值。

17

性好、交易成本低和杠杆操作等特点, 性好、交易成本低和杠杆操作等特点, 性好、交易成本低和杠杆操作等特点, 提高投资组合的运作效率。 提高投资组合的运作效率。 提高投资组合的运作效率。 提高投资组合的运作效率。 提高投资组合的运作效率。

四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

- (2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等.
- (13) 本基金投资短期融资券之外的单个债券久期在 3 年以内,信用评级为 AA+级以上(含)。上述债券 在持有期间,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;
- (14) 本基金应投资于信用级别评级为 AA+以上(含 AA+)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;

- (15) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准:
- 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别;
- 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券,其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一:

A.国内信用评级机构评定的 AA+ 级或相当于 AA+ 级的长期信用级别;

B.国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。(同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的,以国内信用级别为准);

上述短期融资券在持有期间,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 **20** 个交易日内予以全部减持;

- (17) 本基金投资可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的 10%;
- (20) 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

## 四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

- (2)每个交易日日终,本基金现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
- (13)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;
- (17) 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;

(18)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

金资产净值的 10%;本基金在任何交易日日终,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%:

- (21) 本基金在任何交易日日终,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;
- (22) 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日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;
- (23) 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%; 本基金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%;
- (24) 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;
- (25) 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;
- (26) 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:

(27) 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;

除第(2)、(13)、(14)、(15)、(26)、(27)项外,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个交易日内进行调整。法律、法规另有规定时,从其规定。

如果法律规对本基金合同约定投资组 如果法律规对本基金合同约定投资组 合比例限制进行变更的,以后规 合比例限制进行变更的,以后规 定为准。法律规或监管部门取消上述 定为准。法律规或监管部门取消上述 限制,如适用于本基金则投资 限制,如适用于本基金则投资 不再受相关限制 不再受相关限制 不再受相关限制 不再受相关限制 不再受相关限制 不再受相关限制 不再受相关限制 不再受相关限制 ,但须提前公告不需,但须提前公告不需 要经基金份额持有人大会审议 要经基金份额持有人大会审议 要经基金份额持有人大会审议 要经基金份额持有人大会审议

除上述第(2)、(13)、(17)、(18)项外,因证券市场波动、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 个交易日内进行调整。法律、法规另有规定时,从其规定。

六、风险收益特征

本基金为混合型基金,属于中高风险、中高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

六、风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

八、基金的融资、融券及转融通

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资、融券及转融通。

删除

第十四部分 基金资产估值

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

二、估值对象

基金所拥有的股票、期货、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。

二、估值对象

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。

三、估值方法

- 1、交易所上市的有价证券(包括股票、权证等) ……
- 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、金融衍生品的估值
- 三、估值方法
- 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) ……
- (2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(本基金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) 交易所上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的

#### 20

- (1) 评估金融衍生品价值时,应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值;
- (2)股指期货合约、国债期货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。
- 4、债券以及资产支持证券等固定收益品种的估值
- (1) 对在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易的可转换债券采用交易所收盘价估值;
- (2)上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种、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;
- (3) 交易所的中小企业私募债、以大宗交易方式转让的资产支持证券,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,按成本进行后续计量;
- (4) 对只在上海证券交易所固定收益平台或只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的债券,采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值;

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和中小企业私募债,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:
- (3) 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流通受限股票按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

# 删除

- 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。
- 7、当发生大额申购或赎回情形时,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。

# 四、估值程序

1、两类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该类基金份额的余额数量计算,A类和C类基金份额净值均精确到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 A 类或 C 类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。

#### 四、估值程序

1、两类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该类基金份额的余额数量计算,A类和C类基金份额净值均精确到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 A 类或 C 类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。

21

# 五、估值错误的处理

#### 2、估值错误处理原则

#### 五、估值错误的处理

#### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生,但尚未给当事人 ) 估值错误已发生,但尚未给当事人 ) 估值错误已发生,但尚 未给当事人 ) 估值错误已发生,但尚未给当事人 造成损失时 ,估值错误责任方应及时协 ,估值错误责 任方应及时协 , 估值错误责任方应及时协 , 估值错误责任方应及时协 , 估值错误责任方应及时协 , 估 值错误责任方应及时协 , 估值错误责任方应及时协 , 估值错误责任方应及时协 , 估值错误责任方应及 时协 , 估值错误责任方应及时协 , 估值错误责任方应及时协 , 估值错误责任方应及时协 调各方, 及时 进行更正因估值错 调各方,及时进行更正因估值错 误发生的费用由估值错责任方承担; 误发生的费用 由估值错责任方承担; 由于估值错误责任方未及时更正己产生 由于估值错误责任方未及时更正己产生 的估值错误,给当事人造成损失由 的估值错误,给当事人造成损失由 估值错误责 任方对直接损失承担 赔偿估值错误责 任方对直接损失承担赔偿任; 若估值错误责方已经积极协调, 任; 若估值错误责方已经 积极协调, 并且有协助义务的当事人足够时间 并且有协助义务的当事人足够时间 进行更正而未,则 进 行更正而未,则 进行更正而未,则 进行更正而未,则 进行更正而未,则 进行更正而未,则 进行更正 而未,则 进行更正而未,则 进行更正而未,则 进行更正而未,则 前述有协助义务 前述有协助义务 前 述有协助义务 前述有协助义务 前述有协助义务 前述有协助义务 前述有协助义务 的当事人 的当事人 的当事人 的当事人 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责 任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担 相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 应当承担相赔偿责任。估值 错误责任方应对更正的情况 向有关当事 错误责任方应对更正的情况向有关当事 人进行确认,保估值错误已得到更正。 人进行确认, 保估值错误已得到更正。

### 六、暂停估值的情形

- 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;
- 六、暂停估值的情形
- 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;

八、特殊情况的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 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。
- 2、由于证券 、期货 、期货 、期货 交易场所及其登记结 交易场所及其登记结 算公司发送的数据错误,或由于其他不 算公司发送的数据错误,或由于其他不 可抗力原因,基金管理人 和托可抗力原因,基金管理人 和托虽然已经采取必要、适当合理的措施 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的由 进行检查,但是未能发现该错误的由 此造成的基金资产估值错误,管理 此造成的基金资产估值错误,管理 人和基金 托管免除赔偿责任。但人和基金 托管免除赔偿责任。但管理人和基金托应当积极采取必要 管理人和基金托应当积极采取必要 的措施减轻或者消除由此造成 的影响。

八、特殊情况的处理

- 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 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。
- 2、由于证券交易场所及其登记结算公司 发送的数据错误,或由于其他不可抗力 发送的数据错误,或由于其他不可抗力 原因,基金管理人和托虽然已 原因,基金管理人和托虽然已 经采取必要、适当合理的措施进行检 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的由此造成 查,但是未能发现该错误的由此造成 查,但是未能发现该错误的由此造成 的基 金资产估值错误,管理人和的基 金资产估值错误,管理人和金托管人 免除赔偿责任。但基理和基金托管人应当积极采取必要的措施 和基金托管人应当积极采取必要的措施 减轻或者消除由此造成的影响。

第十五部分 基金费用与税收

- 一、基金费用的种类
- 7、基金的证券、期货交易费用;
- 一、基金费用的种类
- 7、基金的证券交易费用;
- 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 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

- H=E×0.7%÷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 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

- H=E×0.6%÷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

•••••

22

四、费用调整

基金管理人和托协商一致后, 基金管理人和托协商一致后, 可按照基金发展情况,并根据法律规 可按照基金发展情况,并根据法律规 规定 和基金合同约规定 和基金管理费 基金管理费 基金管理费 率、基金托管费或销售服务等 相关费率。

调低 基金管理费率、托或 基 金销售服务费,无须召开基份额持有 金销售服务费,无须召开基份额持有人大会。

# 四、费用调整

基金管理人和托协商一致 基金管理人和托协商一致 基金管理人和托协商一致 且在 履行适当程序 履行适当程序 履行适当程序 履行适当程序 后, 可按照基金发展情况后, 可按照基金发展情况并根据法律规定 和基金合同约并根据法律规定 和基金合同约调 整基金 管理费率、托或基金 管理费率、托或销售服务费等相关率。

调低基金销售服务费, 无须召开份 调低基金销售服务费, 无须召开份 额持有人大会。

第十八部分 基金的信息披露

(七) 临时报告

无

(七)临时报告

- 22、本基金暂停申购;
- 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时;
- (十二)投资股指期货信息披露 (十二)投资股指期货信息披露 (十二)投资股指期货信息披露 (十二)投资股指期货信息披露 (十二)投资股指期货信息披露 (十二)投资股指期货信息披露 (十二)投资股指期货信息披露 (十二)投资股指期货信息披露

基金管理人在季度报告、 半年基金管理人在季度报告、 半年基金管理人在季度报告、 半年年度报告等定期和招募说明书(更 年度报告等定期和招募说明书(更 年度报告等定期和招募说明书(更 新)等文件中披露股指期货交易情况, 新)等文件中披露股指期货交易情况, 新)等文件中披露股指期货交易情况, 新)等文件中披露股指期货交易情况, 愈括投资政策、 持仓情况损益包括投资政策、 持仓情况损益包括投资政策、 持仓情况损益风险指标等,并充分揭示股期货交易 风险指标等,并充分揭示股期货交易 风险指标等,并充分揭示股期货交易 风险指标等,并充分揭示股期货交易 风险指标等,并充分揭示股期货交易 风险指标等,并充分揭示股期货交易 对基金总体风险的影响以及是否符合既 对基金总体风险的影响以及是否符合既 对基金总体风险的影响以及是否符合既 定的投资政策和目标等。 定的投资政策和目标等。 定的投资政策和目标等。 定的投资政策和目标等。

(十三)投资国债期货信息披露 (十三)投资国债期货信息披露 (十三)投资国债期货信息披露 (十三)投资国债期货信息披露 (十三)投资国债期货信息披露 (十三)投资国债期货信息披露 (十三)投资国债期货信息披露 (十三)投资国债期货信息披露

基金管理人在季度报告、 半年基金管理人在季度报告、 半年基金管理人在季度报告、 半年年度报告等定期和招募说明书(更 年度报告等定期和招募说明书(更 年度报告等定期和招募说明书(更 新)等文件中披露国债期货交易情况, 新)等文件中披露国债期货交易 风险指标等,并充分揭示国债期货交易 风险指标等,并充分揭示国债期货交易 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 对基金总体风险的影响以及是否符合既 对基金总体风险的影响以及是否符合既 定的投资政策和目标等。 定的投资政策和目标等。 定的投资政策和目标等。 定的投资政策和目标等。

删除

- 八、当出现下述情况时,基金管理人和 八、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相关 基金托管人可暂停或延迟披露相关 信息:
- 2、基金投资所涉及的证券 、基金投资所涉及的证券 、基金投资所涉及的证券 、期货 、期货 交易市 场遇法定节假日或因其他原暂停营业 场遇法定节假日或因其他原暂停营业 时;
- 3、出现导致基金管理人不能售或评估 出现导致基金管理人不能售或评估 出现导致基金管理人不能售或

评估 出现导致基金管理人不能售或评估 出现导致基金管理人不能售或评估 出现导致基金管理人不能售 或评估 出现导致基金管理人不能售或评估 基金资产的紧急事故情况; 基金资产的紧急事故情况; 基金资产的紧急事故情况; 基金资产的紧急事故情况; 基金资产的紧急事故情况; 基金资产的紧急事故情况; 基金资产的紧急事故情况;

八、当出现下述情况时,基金管理人和 八、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相关 基金托管人可暂停或延迟披露相关 信息:

2、基金投资所涉及的证券交易市场遇法 、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暂 停营业时:

第十九部分 基金合同的变更、

二、《基金合同》的终止事由 二、《基金合同》的终止事由

无

- 二、《基金合同》的终止事由
- 3、《基金合同》生效后,连续 60 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;

23

终止与基金财产的清算

在《基金合同》"二十四、基金合同内容摘要"中对上述修订内容进行相应修订。

二、《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》修改对照表

章节

原《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》版本

修订后的《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》版本

内容

内容

- 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查
- (一)基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权
- 1.基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票(包括中小板、创业板及其他 经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债 (含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、 货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但 须符合中国证监会的相关规定)。

- (一) 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权
- 1.基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定,对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券)、资产支持证券、银行存款、同业存单、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它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

- 2.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:
- (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为:

股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比

例合计不低于基金资产净值的5%,其中,上述现金不包括结

- 2.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督:
- (1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金的投资资产配置比例为:

股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%。权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

24

算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资短期融资券之外的单个债券的久期不超过 3 年,信用等级需在 AA+级或以上。

- (2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:
- 2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货和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投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
- 13) 本基金投资短期融资券之外的单个债券久期在 3 年以内,信用评级为 AA+级以上(含)。上述债券在持有期间,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;
- 14) 本基金应投资于信用级别评级为 AA+以上(含 AA+)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;
- 15) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准:
- ①国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别;
- ②根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券,其发行人最近3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一:

A.国内信用评级机构评定的 AA+ 级或相当于 AA+ 级的长期信用级别;

B.国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别。(同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的,以国内信用级别为准);

上述短期融资券在持有期间,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 **20** 个 交易日内予以全部减持;

- 17) 本基金投资可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的 10%;
- (2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制:
- 2)每个交易日日终,本基金现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
- 13)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;
- 17) 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:

18)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;

如果法律法规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。

除上述第(2)款中第 2)、13)、17)、18)项外,因证券市场波动、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 个交易日内进行调整。法律、法规另有规定的,从其规定。

25

20) 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,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;

- 21) 本基金在任何交易日日终,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;
- 22) 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日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;
- 23)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%;本基金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%;
- **24**) 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;
- 25)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;
- 26) 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;

27) 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

26

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;

如果法律法规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,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。

除上述(2)款中的第 2)、13)、14)、15)、26)、27)项外,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 个交易日内进行调整。法律、法规另有规定的,从其规定。

(4) 本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。

# 删除

四、基金财产保管

(四)基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开立专门的证券账户。

(四)基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立专门的证券账户。

(七)基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款,基金管理人与基金托管人应比照证监会《关于货币市场基金投资银行存款有关问题的通知》的规定,就本基金投资银行存款业务签订书面协议。

(七)基金投资银行存款账户的开立和管理

基金投资银行定期存款,基金管理人与基金托管人应比照证监会的相关规定,就本基金投资银行存款业务签订书面协议。

六、交易及清算交收安排

(一)选择代理证券、期货买卖的证券经营机构、期货经纪机构的标准和程序

••••

基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构,并与其签订期货经纪合同,其他事宜根据法律

法规、《基金合同》的相关规定执行,若无明确规定的,可参照有关证券买卖、证券经营机构选择的规则 执行。

(一) 选择代理证券买卖的证券经营机构的标准和程序

. . . . . .

## 七、基金

- (一)基金资产净值的计算、复核的时间和程序
- (一)基金资产净值的计算、复核的时间和程序

#### 27

资产净值计算和会计核算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。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,由此产生的误差计入基金财产。

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。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,由此产生的误差计入基金财产。

(二)基金资产估值方法

#### 1.估值对象

基金所拥有的股票、期货、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(二)基金资产估值方法

#### 1.估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(二)基金资产估值方法

# 2.估值方法

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

.....

- (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) 金融衍生品的估值
- ①评估金融衍生品价值时,应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值;
- ②股指期货合约、国债期货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。
- (4)债券以及资产支持证券等固定收益品种的估值
- ①对在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易的可转换债券采用交易所收盘价估值;
- ②上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种、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;
- ③交易所的中小企业私募债、以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值 技术难以可
- (二)基金资产估值方法

# 2.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) 交易所上市交易的可转换债券,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和中小企业私募债,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:
- 3) 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流通受限股票按监管机构或行业协会有关规定确定

#### 28

靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量;

④对只在上海证券交易所固定收益平台或只在深圳证券交易所综合协议平台进行交易的债券,采用估值技术确定公允价值或按成本法进行估值;

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
- (7) 当发生大额申购或赎回情形时,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。

#### (三) 估值差错处理

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 A 类或 C 类基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时,视为基金份额净值错误。

- 2. 估值错误处理原则
- (1) 估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。

#### (三) 估值差错处理

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 A 类或 C 类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时,视为基金份额净值错误。

- 2. 估值错误处理原则
- (1) 估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则前述有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。

(四) 暂停估值的情形

- 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;
- (四) 暂停估值的情形
- 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;

# 八、基金收益分配

- (一)基金收益分配的原则
- 3.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;

- (一) 基金收益分配的原则
- 3. 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

#### 九、信息披露

- (三)基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序
- 4.暂停或延迟披露基金相关信息的情形
- (2) 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
- (三)基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序
- 4.暂停或延迟披露基金相关信息的情形
- (2) 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;

29

业时;

- (3) 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情况;
- 十、基金费用
- (一) 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 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.7%÷当年天数

(一) 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 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

#### H=E×0.6%÷当年天数

《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;《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;基金份额持有人大会费用;基金的证券、期货交易费用;基金的银行汇划费用;基金的账户开户费用、账户维护费用;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。《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;《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;基金份额持有人大会费用;基金的证券交易费用;基金的银行汇划费用;基金的账户开户费用、账户维护费用;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。

# (五) 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费等相关费率。

调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。

# (五)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费等相关费率。

调低基金销售服务费, 无须召开基金份额持有人大会。

十三、基金管理人和基金托管人的更换

# (一)基金管理人的更换

3.原任基金管理人职责终止后,新任基金管理人或基金临时管理人接受基金管理业务前,原任基金管理人和基金托管人需采取审慎措施确保基金财产的安全,不对基金份额持有人的利益造成损失,并有义务协助新任基金管理人或临时基金管理人尽快恢复基金财产的投资运作。

# (一)基金管理人的更换

3.原任基金管理人职责终止后,新任基金管理人或临时基金管理人接受基金管理业务前,原任基金管理人

和基金托管人需采取审慎措施确保基金财产的安全,不对基金份额持有人的利益造成损失,并有义务协助新任基金管理人或临时基金管理人尽快恢复基金财产的投资运作。

三、《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》修改内容

《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》将在定期更新时根据《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国投瑞银新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》的内容进行相应修改。