

中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开 中欧强泽债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）于2018年9月22日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.zofund.com）发布了《中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开中欧强泽债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，中欧强泽债券型证券投资基金的基金管理人中欧基金管理有限公司（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2018年10月8日起，至2018年10月22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、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：中欧基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路333号东方汇经中心5层

联系人：杜鹏

联系电话：021-68609600-6102

请在信封表面注明：“中欧强泽债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》（见附件四）。

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2018年9月27日，即在2018年9月27日在本基金登记机构登记在册的本基金全

体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

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、复印附件二或登录本基金管理人网站（www.zofund.com）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，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复印件及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（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（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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 2018 年 10 月 8 日起，至 2018 年 10 月 22 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：“中欧强泽债券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：中欧基金管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号东方汇经中心 5 层

联系人：杜鹏

联系电话：021-68609600-6102

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（中国工商银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、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和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）；

2、《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》应当由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）通过方为有效；

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，本基金管理人自通过之日起五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。

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《基金合同》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占权益登记日基金总份额的二分之一以上(含二分之一)方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。

重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人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：中欧基金管理有限公司

联系人：杜鹏

联系电话：021-68609600-6102

传真：021-33830351

网址：www.zofund.com

2、监督人：中国工商银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

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 400-700-9700 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中欧基金管理有限公司负责解释。

中欧基金管理有限公司

2018 年 9 月 26 日

附件一：《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》

附件二：《关于中欧强泽债券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：《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》

附件一：

关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案

中欧强泽债券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《中欧强泽债券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工商银行股份有限公司协商一致，提议对中欧强泽债券型证券投资基金基金合同中的基金名称、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法、基金费用、基金份额的类别等内容进行修改。基金合同修改的具体内容详见附件四《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》。

以上议案，请予审议。

基金管理人：中欧基金管理有限公司

2018年9月22日

附件二：

**中欧强泽债券型证券投资基金
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：			
代理人姓名/名称：			
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
《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》			
基金份额持有人/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，应当分别填写；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、表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”；4、本表决票可从本基金管理人网站（www.zofund.com）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 2018 年 10 月 22 日的以通讯方式召开的中欧强泽债券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。表决意见以代理人的表决意见为准。本授权不得转授权。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证号/营业执照号）：

委托人基金账户号：

代理人姓名或名称（签字/盖章）：

代理人证件号码（身份证号/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授权的，应当分别填写；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、代理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：

中欧强泽债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书

一、重要提示

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中欧强泽债券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工商银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

2、本次《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》需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，因此方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次中欧强泽持有人大会决议的备案，均不表明其对本次基金合同修改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、调整方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“中欧强泽债券型证券投资基金”变更为“中欧短债债券证券投资基金”。

（二）调整基金份额类别

从单份额调整为 A、C 两类基金份额，在现有份额的基础上增加 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。

拟修改为：

“本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。”

（三）调整基金投资范围

原文为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、次级债、可转换

债券、可交换债券、分离交易可转债、债券回购、银行存款、同业存单，以及国债期货等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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。”

拟修改为：

“本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、次级债、分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等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）。

本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于短债的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金所投资的短债是指剩余期限不超过 397 天的债券资产，主要包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、次级债、分离交易可转债的纯债部分等金融工具。”

（四）调整基金投资策略

拟删除国债期货相关投资策略

（五）调整基金投资限制

原文为：

“（1）本基金债券投资比例不低于基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；

.....

(12) 本基金若参与国债期货交易的，需遵守下列投资比例限制：

- 1) 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%；
- 2) 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%；
- 3) 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%；
- 4) 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；

.....”

拟修改为：

- “（1）本基金债券投资比例不低于基金资产的 80%，投资于短债的资产不低于非现金基金资产的 80%；
- （2）每个交易日日终，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；

.....”

（六）调整基金的费率

原费率结构：

管理费率：0.40%

托管费率：0.10%

调整为：

管理费率：0.30%

托管费率：0.10%

销售服务费率：A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%

（七）调整基金合同终止情形的约定

原文为：

“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，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。”

拟修改为：

基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现上述情形的，本基金将根据基金合同第十

八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。

（八）增加摆动定价约定

拟增加：

“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。”

（九）调整基金净值精度

原文为：“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。”

拟修改为：“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。”

（十）其他相关事项的修改

本次基金合同具体修改内容请参照本说明附表。

（十一）本基金新修改的基金合同的生效

自本次基金份额持有人大会决议生效并公告的下一个工作日起，修订后的《中欧短债债券型证券投资基金基金合同》生效。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）中欧强泽基本情况

本基金经 2016 年 5 月 30 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予中欧强泽债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1168 号文）准予募集注册，《基金合同》于 2017 年 2 月 24 日正式生效，基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

（二）召开基金份额持有人大会的必要性

为维护基金份额持有人利益，使本基金的风格特征更加鲜明，更加有利于投资者把握配置需求。因此，本基金拟召开持有人大会，将基金名称变更为中欧短债债券型证券投资基金，并调整投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法、基金费用、基金份额的类别等内容。

（三）中欧强泽基金合同修改的可行性

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，变更投资范围或投资策略等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特别决议应当经出席会议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

本次基金合同修改不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，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。

为实现基金合同修改的平稳过渡，本基金管理人与登记机构已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备等方面进行了深入研究，已经做好了基金合同修改的相关准备。

四、本基金基金合同修改的主要风险及预备措施

（一）预防基金合同修改方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范基金合同修改方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后进行适当修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

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

（二）预防基金合同修改后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金合同修改后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

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：中欧基金管理有限公司客服中心

联系电话：021-68609700

传真：021-33830351

网站：www.zofund.com

附表：基金合同修改对照表

章节 (以变更后的章节为准)	基金合同原条款	变更注册后基金合同的条款
基金名称	中欧强泽债券型证券投资基金	中欧短债债券型证券投资基金
第一部分 前言	三、中欧强泽债券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，……	三、中欧短债债券型证券投资基金由中欧强泽债券型证券投资基金转型而来，中欧强泽债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、中欧强泽债券型证券投资基金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。 中国证监会对中欧强泽债券型证券投资基金的变更注册，……
第二部分 释义	1、基金或本基金：指中欧强泽债券型证券投资基金	1、基金或本基金：指中欧短债债券型证券投资基金，由中欧强泽债券型证券投资基金转型而来
第二部分 释义	7、基金份额发售公告：指《中欧强泽债券型证券投资基金基金份额发售公告》	无
第二部分 释义	15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会	14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
第二部分 释义	22、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	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
第二部分 释义	27、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申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起基金份额变动及结余情况的账户
第二部分 释义	28、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	27、基金合同生效日：指《中欧短债债券型证券投资基金基金合同》生效日
第二部分 释义	30、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 …… 38、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	无
第二部分 释义	无	43、摆动定价机制：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 …… 50、基金份额的类别：本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别 51、A类基金份额：在投资者申购时收取申购费、但

		<p>不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额</p> <p>52、C 类基金份额：在投资者申购时不收取申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额</p>
第三部分 基金的基本情况	<p>五、基金的最低募集份额总额和金额</p> <p>本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，基金募集金额不少于人民币 2 亿元。</p> <p>六、基金份额发售面值和认购费用</p> <p>本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。</p>	<p>六、基金份额的类别</p> <p>本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。</p> <p>本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为： $\text{计算日某类基金份额净值} = \frac{\text{该计算日该类基金份额的基金资产净值}}{\text{该计算日发售在外的该类别基金份额总数}}$</p> <p>投资者可自行选择申购的基金份额类别。</p> <p>本基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列明。在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。</p>
第四部分 基金的历史沿革与存续	<p>第四部分 基金份额的发售</p> <p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间</p> <p>自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、发售方式</p> <p>通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售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发布的调整销售机构的相关公告。</p> <p>3、发售对象</p> <p>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革与存续</p> <p>一、本基金的历史沿革</p> <p>中欧短债债券型证券投资基金由中欧强泽债券型证券投资基金转型而来。</p> <p>中欧强泽债券型证券投资基金经中国证监会《关于准予中欧强泽债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1168 号文）准予募集，基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。</p> <p>中欧强泽债券型证券投资基金自 2016 年 11 月 30 日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 24 日生效。</p> <p>中欧强泽债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2018]XXXX 号文准予变更注册为中欧短债债券型证券投资基金。</p>

<p>明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。</p> <p>2、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折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息的具体金额及利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、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明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2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产承担。</p> <p>5、认购申请的确认 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接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。</p> <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、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，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。</p> <p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件</p> <p>本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间</p>	<p>2018年X月XX日，中欧强泽债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改中欧强泽债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，同意基金名称变更为中欧短债债券型证券投资基金，调整基金投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、基金费率、基金份额的类别等内容并相应修改基金合同等事项。基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自2018年XX月XX日起，修改后的《中欧短债债券型证券投资基金基金合同》生效，原《中欧强泽债券型证券投资基金基金合同》自同日起失效。</p> <p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额 基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现上述情形的，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p>
--	--

	<p>募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</p> <p>2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；</p> <p>3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。</p> <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>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，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p>	
第五部分 基金份额的申购与赎回	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>……基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。……</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>……基金管理人可根据情况针对某类基金份额变更或增减销售机构，并予以公告。……</p>
第五部分 基金份额的申购与赎回	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>5、投资者在申购本基金时可自行选择所申购的基金份额类别；基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，未来在条件成熟和准备完备的情况下提供本基金不同类别之间的转换服务，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。</p>
第五部分 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</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 日的各类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</p>

	<p>证监会同意，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>2、……申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，……</p> <p>3……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，……</p> <p>4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产。</p>	<p>监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。</p> <p>2、……申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，……</p> <p>3、……赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，……</p> <p>4、A 类基金份额的申购费用由投资人承担，不列入基金财产。C 类基金份额不收取申购费用。</p> <p>……</p> <p>8、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。</p>
第五部分 基金份额的申购与赎回	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</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>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。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</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>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。</p>
第五部分 基金份额的申购与赎回	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</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>
第五部分 基金份额的申购与赎回	<p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(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)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>……</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因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，可对其余赎回申请延期办理。……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，……</p> <p>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的，基金管理人有权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，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按前述条款处理。</p>	<p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(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)超过前一工作日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>……</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因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工作日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。……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该类基金份额净值为基础计算赎回金额，……</p> <p>(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的，基金管理人有权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，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</p>

		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。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按前述条款处理。
第五部分 基金份额的申购与赎回	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、……并公布最近1个开放日的基金份额净值。 3、……并公告最近一个工作日的基金份额净值； ……	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、……并公布最近1个开放日的各类基金份额净值。 3、……并公告最近一个工作日的各类基金份额净值； ……
第五部分 基金份额的申购与赎回	十一、基金转换 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务……	十一、基金转换 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金份额之间的转换业务……
第六部分 基金合同当事人及权利义务	1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；	1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
第六部分 基金合同当事人及权利义务	2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜； （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活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；	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销售、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；
第六部分 基金合同当事人及权利义务	三、基金份额持有人 每份基金份额具有同等的合法权益。 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： （4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；	三、基金份额持有人 同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： （4）缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
第七部分 基金份额持有人大会	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，法律法规和中国证监会另有规	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，法律法规和中国证监会另有规定

	定或基金合同另有约定的除外： (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，法律法规要求调整的除外；	或基金合同另有约定的除外： (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率；
第七部分 基金份额持有人大会	2、在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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： (3) 基金合同调整本基金的申购费率、在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调低赎回费率或变更收费方式；	2、在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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： (3) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；
第七部分 基金份额持有人大会	3、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，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。	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，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。
第七部分 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。	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。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。
第八部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 (二) 基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 (二) 基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值；
第十一部分 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固定收益类品种，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、债券回购、银行存款、同业存单，以及国债期货等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）。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为： 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%； 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易	二、投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、次级债、分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等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）。 本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：

	<p>保证金后，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p>	<p>本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于短债的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金所投资的短债是指剩余期限不超过 397 天的债券资产，主要包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、次级债、分离交易可转债的纯债部分等金融工具。</p>
第十一部分 基金的投资	<p>三、投资策略</p> <p>当市场收益率上行时，基金管理人将运用国债期货对组合中的债券资产进行套期保值，以回避一定的市场风险。</p> <p>.....</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。</p>	无
第十一部分 基金的投资	<p>四、投资限制</p> <p>(1) 本基金债券投资比例不低于基金资产的 80%；</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>.....</p> <p>(12) 本基金若参与国债期货交易的，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1) 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%；</p> <p>2) 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%；</p> <p>3) 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%；</p> <p>4) 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；</p> <p>.....</p> <p>除上述第（2）、（9）、（13）、（14）项外，因</p>	<p>四、投资限制</p> <p>(1) 本基金债券投资比例不低于基金资产的 80%，投资于短债的资产不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>(2) 每个交易日日终，本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；</p> <p>.....</p> <p>除上述第（2）、（9）、（12）、（13）项外，因证券市场波动.....</p>

	证券/期货市场波动……	
第十一部分 基金的投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(1年以下)指数收益率。</p> <p>根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取中债综合财富(1年以下)指数收益率作为本基金的业绩比较基准。</p>
第十一部分 基金的投资	无	<p>七、各类资产和负债剩余期限的确定</p> <p>1、银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为0天；证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；</p> <p>2、回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限，买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>3、银行定期存款、同业存单的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限以存款协议中约定的通知期计算；</p> <p>4、中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>5、组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：允许投资的含回售权的债券的剩余期限以计算日至下一个行权日的实际剩余天数计算；允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算；</p> <p>6、对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限。</p>
第十三部分 基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金依法拥有的债券、国债期货合约、银行存款本息、应收款项、其它投资等金融资产和负债。</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金依法拥有的债券、银行存款本息、应收款项、其它投资等金融资产和负债。</p>
第十三部分 基金资产估值	<p>5、国债期货合约以估值日的结算价估值。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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。</p>	<p>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。</p>
第十二部分 基金的财产	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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</p>	<p>四、估值程序</p> <p>1、各类基金份额净值是按照每个估值日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类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。。</p>

	<p>的, 从其规定。</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值, 并按规定公告。</p> <p>2、……基金管理人每个估值日对基金资产估值后, 将基金份额净值结果发送基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人按约定对外公布。</p>	<p>国家另有规定的, 从其规定。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值, 并按规定公告。</p> <p>2、……基金管理人每个估值日对基金资产估值后, 将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人按约定对外公布。</p>
第十三部分 基金资产估值	<p>五、估值错误的处理</p> <p>基金管理人 and 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。</p>	<p>五、估值错误的处理</p> <p>基金管理人 and 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(含各类基金份额的基金份额净值, 下同)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。</p>
第十三部分 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/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>……</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, 基金管理人经与基金托管人协商一致的</p>	<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>……</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, 基金管理人经与基金托管人协商一致的, 应当暂停基金估值;</p>
第十三部分 基金资产估值	<p>七、基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。</p> <p>……</p>	<p>七、基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。……</p>
第十三部分 基金资产估值	<p>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>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 6 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>
第十四部分 基金费用与税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>……</p> <p>6、基金的证券/期货交易费用;</p> <p>……</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>……</p> <p>3、基金的销售服务费;</p> <p>……</p> <p>7、基金的证券交易费用;</p> <p>……</p>
第十四部分 基金费用与税收	<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 0.40%年费率计提。管理费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$	<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 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$
第十四部分 基金费用与税收		<p>3、基金的销售服务费</p> <p>本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份</p>

		<p>额的销售服务费年费率为0.40%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$ <p>H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为C类基金份额前一日基金资产净值</p> <p>基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，基金销售服务费由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。</p>
	上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。	上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
第十五部分 基金的收益与分配	三、基金收益分配原则 3、每一基金份额享有同等分配权；	三、基金收益分配原则 3、同一类别每一基金份额享有同等分配权；
第十六部分 基金的会计与审计	一、基金会计政策 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 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；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；
第十七部分 基金的信息披露	<p>（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议</p> <p>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。</p> <p>.....</p> <p>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介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。</p>	<p>（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议</p> <p>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。</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>（二）基金份额发售公告</p> <p>基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。</p> <p>（三）基金合同生效公告</p> <p>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介上登载基金合同生效公告。</p>	无
第十七部分 基金的信息披露	<p>（四）基金资产净值、基金份额净值</p> <p>基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎</p>	<p>（二）基金资产净值、基金份额净值</p> <p>基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回</p>

	<p>回前，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。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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。</p>	<p>前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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各类基金份额的基金份额净值。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、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>（五）基金份额申购、赎回价格</p> <p>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。</p>	<p>（三）基金份额申购、赎回价格</p> <p>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。</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>（七）临时报告</p> <p>.....</p> <p>7、基金募集期延长；</p> <p>.....</p> <p>16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>.....</p>	<p>（五）临时报告</p> <p>.....</p> <p>15、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>.....</p> <p>25、调整本基金份额类别设置；</p> <p>.....</p> <p>27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；</p> <p>.....</p>
第十七部分 基金的信息披露	<p>（十）投资国债期货的信息披露</p> <p>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等。</p>	无
第十七部分 基金的信息披露	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>.....</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。</p> <p>.....</p>	<p>六、信息披露事务管理</p> <p>.....</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者以 XBRL 电子方式复核审查并确认。</p> <p>.....</p>
第十八部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产	<p>3、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；</p>	无

的清算		
第十九部分 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。但是发生下列情况的，当事人免责：</p> <p>.....</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，当事人免责：</p> <p>.....</p>
第二十一部分 基金合同的效力	<p>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章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。</p>	<p>1、基金合同应经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章。自 2018 年 X 月 XX 日起，《中欧短债债券型证券投资基金基金合同》生效。</p>