

# 嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

嘉合基金管理有限公司已于2019年1月5日在《证券时报》和嘉合基金管理有限公司网站([www.haoamc.com](http://www.haoamc.com))发布了《嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式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,现发布关于召开本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

## 一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关约定,嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金管理人嘉合基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)经与基金托管人渤海银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,审议关于本基金转型相关事宜。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2019年1月9日起,至2019年2月11日17:00止(送达时间以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准)。

3、会议表决票送达至以下地址的收件人:

收件人:嘉合基金管理有限公司

地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼1层

邮政编码:200082

联系人:商林华

联系电话：400-0603-299

请在信封表面注明：“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式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

《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明详见《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》（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2019年1月9日，即2019年1月9日下午交易时间结束后，在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人（包括A类基金份额和C类基金份额）均有权参加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。基金份额持有人可通过剪报、复印附件二或登录基金管理人网站（[www.haoamc.com](http://www.haoamc.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与开户时一致的业务专用章（以下合称“公章”），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事业单位法人登记证、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件（包括使用的身份证、护照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、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）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文件，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写妥的表决票和所需的相关文件于会议投票表决规定时间内（自2019年1月9日起，至2019年2月11日17:00止，送达时间以表决票收件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公告第一条第3项所述的地址（上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼1层），并请

在信封表面注明：“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## 五、授权

为便于基金份额持有人参与本次大会，除直接投票外，基金份额持有人还可以委托代理人代其行使表决权。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

### （一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数量以登记机构的登记为准。

### （二）代理人

基金份额持有人可以委托符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

### （三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。

授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印附件三或登录基金管理人网站（[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)）下载并打印授权委托书样本。

## 1、基金份额持有人进行授权所需提供的文件

（1）个人基金份额持有人委托他人投票的，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（参照附件三），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。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，还需提供该代理人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）。

（2）机构基金份额持有人委托他人投票的，代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（参照附件三），并在授权委托书上加盖该机构持有人的公章，并提供该机构持有人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。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，还需提供该代理人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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

(3) 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（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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）。

(4) 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文件，以基金管理人的认可为准。

## 2、授权效力确定规则

(1) 基金份额持有人以非纸面方式进行授权的，为无效授权。

(2) 如果同一基金份额持有人存在多次有效授权的，以最后一次有效授权为准。若不能确定最后一次有效授权的，则按如下原则处理：

①多次有效授权中，代理人相同的，视为委托人授权该代理人行使表决权；

②多次有效授权中，代理人不同的，视为无效授权。

(3) 如委托人在授权委托表示中未明确其表决意见的，视为委托人授权代理人按照代理人的意志行使表决权。

(4) 如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权。

(5) 如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准。

## 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（渤海银行股份有限公司）授权代表的监督下在本公告载明的表决日期截止后 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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定规则如下：

(1) 表决票通过专人送交、邮寄送达本公告指定的收件人的，表决票送达时间以收到时间为准。2019 年 1 月 9 日之前以及 2019 年 2 月 11 日 17: 00 以后送达收件人的表决票，均为无效表决票。

(2) 表决票的效力认定

①表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达本公告指定的收件人的，为

有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

②如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，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如表决票上的签字或盖章部分未填写或填写不完整、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送达表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

i.送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

ii.送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，该表决意见视为弃权，计入有效表决票；

iii.送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以指定联系地址收到的时间为准。

## 七、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日本基金总份额的二分之一（含二分之一）；

2、《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》应当由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）通过方为有效；

3、基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，基金管理人应当自决议通过之日起5日内报中国证监会备案。

## 八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》的规定及《基金合同》的约定，本次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代表的本基金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）方可召开。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《基金法》的规定和《基金合同》的约定，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作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 九、本次大会相关机构

1、召集人：嘉合基金管理有限公司

联系地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 楼 1-2 层

邮政编码：200082

联系人：商林华

联系电话：400-0603-299

网址：[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)

2、基金托管人：渤海银行股份有限公司

联系地址：天津市河东区海河东路 218 号

邮政编码：300012

联系人：秦彦

联系电话：022-58555941

3、公证机构：上海市东方公证处

联系地址：上海市静安区凤阳路 598 号

邮政编码：200041

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

4、见证律师：上海市通力律师事务所

联系地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

十、重要提示

1、请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过嘉合基金管理有限公司网站（[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)）查阅，投资者如有任何疑问，可致电 400-0603-299 咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后，在 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嘉合基金管理有限公司解释。

嘉合基金管理有限公司

2019 年 1 月 7 日

附件一：《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》

附件二：《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》

附件一：

关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型

并修改基金合同等有关事项的议案

嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人：

为了优化基金的投资运作管理，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《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人嘉合基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人渤海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，审议对本基金进行转型，调整基金名称、基金运作方式、基金投资目标、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、基金费用等内容，并修订基金合同等事项。具体说明详见附件四《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》。

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《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》的有关内容对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

嘉合基金管理有限公司

2019年1月7日

附件二：

嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决票



附件三：

授权委托书（样本）

兹全权委托 先生 / 女士或 机构代表本人（或本机构）参加投票截止日为 年 月 日的以通讯开会方式召开的嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会。

本授权不得转授权。若在法定时间内就同一议案重新召开基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

委托人证件号码（身份证件号或营业执照号）：\_\_\_\_\_

委托人基金账户号：\_\_\_\_\_

代理人（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

代理人证件号码（身份证件号或营业执照号）：\_\_\_\_\_

签署日期： 年 月 日

附注：

1、此授权委托书剪报、复印或登录基金管理人网站（[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)）下载并打印，填写完整并签字盖章后均为有效。

2、本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。“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，不影响授权委托书效力。

3、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件四：

关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明

## 一、声明

1、嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同于 2018 年 3 月 21 日生效。为了优化基金的投资运作管理，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《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，本基金管理人嘉合基金管理有限公司经与基金托管人渤海银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》。

2、本次修改合同事项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）通过方为有效，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。

4、中国证监会对本次修改基金合同所作的任何决定或意见，均不表明其对本次修改基金合同后基金的价值或投资人的收益做出实质性判断或保证。

## 二、转型方案要点

### （一）变更基金名称

基金名称由“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金”变更为“嘉合睿金混合型发起式证券投资基金”。

### （二）变更基金运作方式

基金运作方式由“契约型开放式，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式”变更为“契约型开放式”。将本基金原规定的 3 个月封闭期，定期开放申赎的运作方式变更为每日开放申赎运作。

### （三）调整基金的投资目标、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准

#### 1、调整后的投资目标

“本基金在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。”

#### 2、调整后的投资组合比例

“基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 50%—95%，持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

### 3、调整后的投资策略

“本基金将秉持战略和战术资产配置理念，通过稳健管理的多策略投资系统，在控制市场风险、尽量降低净值波动风险并满足流动性的前提下，动态投资于股票、债券、现金及现金等价物等资产品种并运用股指期货等各种金融工具提高收益率。”

#### （一）大类资产配置策略

本基金在严格遵守《基金合同》关于投资比例限制的约束下，合理运用基于量化模型、基于市场价量、基于宏观基本面等多指标体系的大类资产配置模型，动态控制风险资产的仓位，获取股票、债券、货币等低相关性、多资产类别的周期性轮动收益，在获得资产上行收益的同时，有效控制下行风险，做到合理的多元化分散投资，实现投资组合整体的收益风险比优于单一大类资产。

#### （二）股票的投资策略

##### 1、中观大小盘风格轮动策略

本基金通过构建大类资产的中观配置模型，来获取超越该大类资产的市场平均收益。例如，股票投资的中观配置模型中运用市场情绪模型和动量模型来捕获包括大小盘风格轮动等中观资产层面的超额收益；市值风格情绪模型通过监控市场中大盘、中小盘股票的涨跌统计分布，判断市场对于各市值风格的偏好取向的变化，投资于市场最“倾向”的市值风格。

##### 2、微观行业轮动及选股策略

本基金通过对长期、中期、短期的财务指标、技术指标等构建高有效性的行业轮动模型和多因子选股模型，构建能持续稳定超越沪深 300 指数的超额收益的股票组合。例如，低估值因子通过合理运用 PE 等估值指标并设计相应的交易规则来捕获此类因子的超额收益；反转因子投资于跌幅居前的特征股票组合，获取不同阶段超跌反弹或者趋势反转带来的超额收益；动量因子投资于动量居前的特征股票组合，获取动量延续或者放大的超额收益。

#### （三）债券的投资策略

本基金的债券投资主要为获取稳定性的固定收益，因此主要投资于国债、评级较高的地方政府债券以及安全性较高的公司债和企业债等品种。

本基金通过动态调整债券的投资比例，在一定程度上规避股票市场的投资风险，获得相对稳定的投资收益。结合市场利率趋势及信用环境变化情况等，综合判断各类券种的风险收益水平，构造债券的投资组合。

#### （四）可转换债券的投资策略

本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。

#### （五）资产支持证券的投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估算违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### （六）中小企业私募债券的投资策略

在控制信用风险和流动性风险的基础上，本基金对中小企业私募债券投资取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

#### （七）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合，力求取得最优的风险调整收益。

#### （八）股指期货投资策略

本基金进行股指期货的投资以套期保值为主要目的，本基金投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过对股票市场和股指期货市场短期和中长期趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定投资方案比例。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。”

### 4、调整后的投资限制

#### “1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产占基金资产的比例为 50%—95%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；

- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (12) 本基金应投资于主体信用评级评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用评级下降、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；
- (13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (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；
- (15) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (16) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；
- (17) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；
- (18) 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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；
- (19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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；
- (20) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(21) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列限制：

- 1) 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%；
- 2) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
- 3) 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%；
- 4) 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个交易日基金资产净值的 20%；
- 5) 在任何交易日终，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）占基金资产的比例应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述投资限制（2）、（12）、（19）、（20）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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在此期间，基金的投资范围和投资策略应该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。

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以调整后的规定执行。”

## 5、调整后的业绩比较基准

“沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。

中债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。中债综合全价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。

本基金是混合型基金，在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果法律法规发生变化、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人与基金托管人协商一致后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。”

#### （四）变更基金费用

1、基金管理人的管理费由“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”变更为“本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2 %年费率计提”。

2、基金的销售服务费由“本基金 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 0.1%”变更为“本基金 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 0.8%”。

3、本基金 C 类基金份额的赎回费率变更如下：

■

#### （五）其他修改内容

在根据上述转型方案的要点修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他部分条款一并进行了修改，具体请见“附表：基金合同修订对照表”。

#### （六）转型选择期的相关安排

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本次基金份额持有人大会决议生效后，将在转型正式实施前安排不少于 20 个开放日的选择期，以供基金份额持有人做出赎回、转出等选择，具体时间安排详见管理人届时发布的相关公告。

对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，将继续持有转型后的嘉合睿金混合型发起式证券投资基金。

在选择期间，由于本基金需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。

#### （七）授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同等法律文件修改的有关具体事宜

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据上述转型方案对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订相关转型安排规则并提前公告。

### 三、基金转型的主要风险及预备措施

#### （一）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，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。若本次基金份额持有人大会表决事项未获通过，基金管理人计划按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交本基金转型并修改基金合同等方案议案。

#### （二）基金转型后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，避免基金转型后的基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

#### （三）基金转型公告后遭遇大规模赎回的风险

为降低部分基金份额持有人在基金转型后赎回对基金平稳运作的影响，在基金转型之后，基金管理人将择机进行持续营销，可在很大程度上降低转型对本基金规模的影响。

#### 四、基金管理人的联系方式

持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

嘉合基金管理有限公司

联系电话：400-0603-299

网站：[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)

附表：基金合同修订对照表

#### 四、投资限制 1、组合限制 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制： 基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%； （1）股票资产占基金资产的比例为 50%—95%；

（2）开放期内每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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；在封闭期，每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； （2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；

… …

(12) 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； (12) 本基金应投资于主体信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用级别评级下降、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) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；本基金投资中小企业私募债券的到期日不得超过当期封闭期结束之日； (15) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(16) 在封闭期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；在开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 140%； (16) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

… …

(19) 开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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； (19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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；

… …

(21) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列限制： (21) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列限制：

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%；开放期内在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；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，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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个交易日基金资产净值的 20%；在任何交易日日终，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； 1) 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%；

… 2) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

除上述投资限制（2）、（12）、（19）—（20）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。 3) 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%；

4) 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个交易日基金资产净值的 20%；

5) 在任何交易日日终，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）占基金资产的比例应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

...

除上述投资限制（2）、（12）、（19）、（20）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。

第十二部分基金的投资 五、业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40% 沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%

沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现选择科学客观，流动性高，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。

中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一。基于本基金的特征，使用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。中债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。中债综合全价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。

... 本基金是混合型基金，在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

...

六、风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

第十三部分基金的财产 一、基金资产总值 基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。基金资产总值是指基金拥有的各类证券及票据

价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

第十四部分基金资产估值 三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 1、证券交易所上市的有价证券的估值

... ..

(3) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换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； (3) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换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；

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；交易所上市实行全价交易的债券（可转债、可交换债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

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，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。 1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，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，由此产生的误差计入基金财产。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。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，视为基金份额净值估值错误。

第十五部分基金费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 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： 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$   $H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费 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 E 为前一日的基金资产净值

… …

### 3、基金的销售服务费 3、基金的销售服务费

本基金 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 0.1%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下： 本基金 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 0.8%。销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$   $H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值 E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

… …

第十六部分基金的收益与分配 三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配； 删除左侧内容

第十六部分基金的收益与分配 五、收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。 基金收益分配发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

第十七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； 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

… …

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

基金募集申请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。

(二) 基金份额发售公告 删除“(二) 基金份额发售公告”和“(三)《基金合同》生效公告”

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

(三)《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

《基金合同》生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

(四) 基金资产净值、基金份额净值 (二) 基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后的封闭期内,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和两类基金份额净值。《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和两类基金份额净值。

在开放期内,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露开放日的两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

... ..

(五) 基金份额申购、赎回价格 (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费率和赎回费率,并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。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费率和赎回费率,并保证投资人能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。

第十八部分基金的信息披露 (七) 临时报告 (五) 临时报告

... ..

前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件: 前款

所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 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；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 17、基金改聘会计师事务所；

- 18、基金改聘会计师事务所； 18、变更基金销售机构；
- 19、变更基金销售机构； 19、更换基金登记机构；
- 20、更换基金登记机构； 20、本基金开始办理申购、赎回；
- 21、本基金进入开放期； 21、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 22、本基金收费方式发生变更； 22、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 23、本基金发生巨额赎回并延缓支付赎回款项； 23、本基金暂停接受申购、赎回申请；
- 24、本基金暂停接受申购、赎回申请； 24、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回； 25、调整本基金份额类别设置；
- 26、调整本基金份额类别设置； 26、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时；
- 27、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时； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值； 28、法律法规、中国证监会规定的和基金合同约定的其他事项。
- 29、法律法规、中国证监会规定的和基金合同约定的其他事项。

第十八部分基金的信息披露 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）中充分披露基金的相关情况并揭示相关风险，说明本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%，且本基金不向个人投资者公开销售。删除此条

第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 5、基金财产清算的期限为 6 个月。 5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### 三、基金财产的清算

第二十二部分基金合同的效力 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方加盖公章或合同专用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。 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签章。

第二十四部分基金合同内容摘要 无 增加“第二十四部分基金合同内容摘要”章节

第六部分基金份额的申购与赎回 二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 1、开放日及开放时间

投资人在开放期内的开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。封闭期内，本基金不办理申购与赎回业务，也不上市交易。投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。《基金合同》生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金自基金合同生效后，每三个月开放一次申购和赎回。一般情况下，本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日(含)起不少于五个工作日、不超过二十个工作日的期间，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人应在每个开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。但若投资者在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出交易申请的，视为无效申请。在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

开放期以及开放期办理申购与赎回的具体事宜见招募说明书及基金管理人届时发布的相关公告。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回或转换的价格。

第六部分基金份额的申购与赎回 四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 2、申购和赎回的款项支付

.....

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基

金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

.....

六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金两类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。两类基金份额净值在每个工作日收市后计算，并根据基金合同的约定进行公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。 1、本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金两类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 日基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日根据《基金合同》的约定进行公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

6、本基金 A 类基金份额收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用，但从该类别基金资产中计提销售服务费。本基金两类基金份额的申购费率、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日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。 6、本基金两类基金份额的申购费率、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日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率。 7、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购、赎回费率等费率。

第六部分基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形 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。 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。

8、个人投资者申购。 8、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人持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致变相规避前述 50%比例要求的情形时。

发生上述除第 4、8、9 项外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，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，基金管理人有权合理调整申购业务的办理期间并予以公告。 发生上述除第 4、8、9 项外暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，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

申请全部或部分被拒绝，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，基金管理人有权合理调整申购业务的办理期间并予以公告。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 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。 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

增加右侧情形 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

发生上述情形之一而基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人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。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，基金管理人有权合理调整赎回业务的办理期间并予以公告。发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，基金管理人有权合理调整赎回业务的办理期间并予以公告。

九、巨额赎回的情形及处理方式 1、巨额赎回的认定 1、巨额赎回的认定

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 20%，即认为是发生了巨额赎回。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。

第六部分基金份额的申购与赎回 2、巨额赎回的处理方式 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。当基金出现巨额赎回时，基金管理人可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。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项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，基金管理人应当接受并确认所有的赎回申请，当日按比例办理的赎回份额不得低于基金总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过二十个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额。（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项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，基金管理人应当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，可对其余赎回申请实施延期办理。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，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。

(3) 在开放期内，若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过前一工作日的基金总份额 20%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，该单个基金份额持有人的剩余赎回申请与其他份额持有人的赎回申请参照前述条款处理。如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 20%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过前一开放日的基金总份额 20%的，基金管理人可以采取如下措施：对于该基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以决定全额赎回或部分延期赎回。当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。当基金管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项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，基金管理人应当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，可对其余赎回申请实施延期办理。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，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。

(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。

#### 第六部分基金份额的申购与赎回 3、巨额赎回的公告 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，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。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。

#### 十一、基金转换 十一、基金转换 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，基金转换可以收取一定的转换费，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，并提前告知基金托管人与相关机构。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，基金转换可以收取一定的转换费，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，并提前告知基金托管人与相关机构。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额之间暂不允许进行相互转换。

#### 十七、其他业务 十七、其他业务 十七、其他业务

在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下，基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。在不违反法律法规及中国证监会规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可以与基金托管人协商一致并在履行相关程序后，办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则，届时须报中国证监会备案并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

#### 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 （一）基金管理人简况

… …

住所：上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室 注册地址：上海市虹口区广纪路 738 号 1 幢 329 室

… 办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 楼

…

#### （二）基金管理人的权利与义务 （二）基金管理人的权利与义务

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： 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

… …

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

… …

（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； 删除第（24）条

第七部分基金合同当事人及权利义务 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。同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

第八部分基金份额持有人大会 一、召开事由 2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，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： 2、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，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：

… …

(2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式； (2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式；

… …

(6) 基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则； (6) 基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

四、基金份额持有人出席会议的方式 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止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。 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止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。

第九段 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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，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。 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，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，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。

第九部分基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 第三段 三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。 三、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规的部分，如法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十二部分基金的投资 一、投资目标 本基金在有效控制风险的前提下，通过定期开放的形式保持适度流动性，并通过相对灵活的资产配置和主动的投资管理，谋求基金资产的长期、稳定增值。 本基金在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。

## 二、投资范围 … …

基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%，每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 50%—95%，持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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；其中，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 … …

### （一）大类资产配置策略 （一）大类资产配置策略

本基金通过运用基于量化多策略且经过长时间市场数据检验的大类资产择时模型来动态控制高风险资产的仓位，获取股票、债券、货币等低相关性、多资产类别的周期性轮动收益，在获得资产上行收益的同时，有效规避下行风险，实现长期收益优于任一单个资产，做到真正的多元化分散投资。本基金在严格遵守《基金合同》关于投资比例限制的约束下，合理运用基于量化模型、基于市场价量、基于宏观基本面等多指标体系的大类资产配置模型，动态控制风险资产的仓位，获取股票、债券、货币等低相关性、多资产类别的周期性轮动收益，在获得资产上行收益的同时，有效控制下行风险，做到合理的多元化分散投资，实现投资组合整体的收益风险比优于单一大类资产。