

景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金（基金代码：003315，下称“景瑞双利”或“本基金”）由景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金依据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定的转型条款转型而来。《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2018年6月20日正式生效。

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》和《基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯开会方式。

2、会议投票表决起止时间：自2019年1月31日起，至2019年2月26日17:00止（投票表决时间以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：

名称：景顺长城基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心608-610室

邮政编码：100033

联系人：赵豫

联系电话：4008888606

二、会议审议事项

《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明见《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案说明》（见附件四）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2019年1月31日，即在2019年1月31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、本次基金份额持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登录本基金管理人网站(<http://www.igwfm.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，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或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；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和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)；

(4) 机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)，以及填妥的授权委托书原件。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。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)；

(5) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，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在 2019 年 1 月 31 日起，至 2019 年 2 月 26 日 17:00 止的期间内通过专人送交、快递的方式送达至景顺长城基金管理有限公司北京分公司的办公地址，并在信封表面注明：“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准，即：专人送达的以实际递交时间为准；快递送达的，以基金管理人签收时间为准。

景顺长城基金管理有限公司北京分公司的办公地址及联系办法如下：

名称：景顺长城基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 608-610 室

邮政编码：100033

联系人：赵豫

联系电话：4008888606

五、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(兴业银行股份有限公司)授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期(即 2019 年 2 月 26 日)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平等的表决权。

3、表决票效力的认定规则如下：

(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，以最后送达日所填写的有效的表决票为准，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 送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

六、会议召开的条件

1、本基金管理人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

未能满足上述条件的情况下，则基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

七、决议生效条件

1、本基金基金份额持有人所持有的每一份基金份额享有平等表决权。基金份额持有人应在表决票(见附件二)上勾选“同意”、“反对”或者“弃权”。

2、本次议案按特别决议处理，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、本次基金份额持有人大会决议通过的事项自表决通过之日起生效，本基金管理人自表决通过之日起 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《中华人民共和国证券投资基金法》的规定和《基金合同》的约定，本次基金份额持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）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，本基金管理人可在规定的时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。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

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

注册及办公地址：深圳市中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

联系人：张蕊

联系电话：0755-22381809

2、基金托管人：兴业银行股份有限公司

住所及办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

兴业银行客服电话：95561

3、公证机构：北京市方圆公证处

公证机构：北京市方圆公证处

地址：北京市东城区朝阳门内大街东水井胡同 5 号北京 INN 大厦五层 A525 室

联系人：赵蓉

联系电话：010-85197506

邮政编码：100010

4、见证律师：上海市通力律师事务所

注册及办公地址：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提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站(<http://www.igwfm.com>)查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 400-8888-606（免长途话费）咨询。

3、本公告的有关内容由景顺长城基金管理有限公司负责解释。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一九年一月二十六日

附件一：《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案》

附件二：《景顺长城景瑞双利债券型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》

附件四：《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案的说明》

附件一：关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案

景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金份额持有人：

为更好地保护基金份额持有人的利益，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《景顺长城景瑞双利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，本基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，提议以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，审议修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案。

《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案的说明》见附件四。

本议案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人或代理人所持表决的三分之二以上（含三分之二）通过。本议案如获得基金份额持有人大会审议批准，基金管理人将根据本议案及《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案的说明》（附件四）对基金合同进行修改，并披露修改后的基金合同、托管协议等法律文件。

以上议案，请予审议。

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

二零一九年一月二十六日

附件二：景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称：_____

证件号码（身份证件/营业执照）：_____

基金账户卡号：_____

如为受托出席会议并表决的，请填写：

受托人的姓名/名称：_____

受托人证件号码（身份证件/营业执照）：_____

审议事项 表决结果

关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案

同意 反对 弃权

基金份额持有人/受托人签名或盖章

2019 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。

2、以上表决意见是持有人或其受托人就持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。

3、表决票未填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断的表决票或未投的表决票均视为投票人放

弃表决权，其所持份额数的表决结果均计为“弃权”。

4、本表决票可从相关网站下载、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/公司单位代表本人或本机构参加投票截止日为2019年2月26日以通讯方式召开的景顺长城景瑞双利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。表决意见以受托人的表决意见为准。

若在法定时间内就同一议案重新召开景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金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。

委托人姓名或名称：

委托人证件号码（身份证件/营业执照）：

基金账户卡号：

受托人姓名或名称：

受托人证件号码（身份证件/营业执照）：

委托人签字/盖章：

签署日期：2019年月日

说明：

1、页末签字栏中委托人为机构的应当于名称后加盖公章，个人则为本人签字。

2、以上授权是持有人就其持有的本基金全部份额向受托人所做授权。

3、其他签字栏请视情形选择填写，凡适合的栏目均请准确完整填写。

4、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；持有人多次授权，无法区分授权次序的，视为同意其授权的机构之一为受托人。

5、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。

附件四：关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案的说明

一、声明

1、为了更好地保护基金份额持有人利益，提高基金资产的运作效率与基金产品的市场竞争力，景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）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》等法律法规的规定和《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，经与景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，拟修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由，并对本基金法律文件的相应内容进行修订。

2、本次基金份额持有人大会需由持有有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）的持有人或其代理人参加方可召开，且《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案》须经参加本次持有人大会的本基金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，存在未能达到开会条件或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决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。

二、基金合同修订内容

本基金基金合同的修订详情如下：

章节 修订前 修订后

第一部分前言

三、景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金由景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金变更而来，景顺长城景瑞双利定期开放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及后续转型的备案，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

三、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金由景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金变更而来，景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金由景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金变更而来，景顺长城景瑞双利定期开放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。中国证监会对景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金募集的注册及后续转型的备案和转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

第一部分前言

新增：六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

第二部分释义

1、基金或本基金：指景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金，由景瑞双利定期开放债券型证券投资基金变更而来 4、基金合同或本基金合同：指《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新 26、基金合同生效日：指《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》生效起始日，《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效 42、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

1、基金或本基金：指景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金，由景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金变更注册而来，景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金由景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金变更而来 4、基金合同或本基金合同：指《景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新 26、基金合同生效日：指《景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金基金合同》生效起始日，《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效 42、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

第三部分基金的基本情况

一、基金名称 景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金

一、基金名称 景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金

第三部分基金的基本情况

四、基金的投资目标 本基金主要通过投资于固定收益品种，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。

四、基金的投资目标 本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。

第四部分 基金的历史沿革

第四部分基金的历史沿革 景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金由 景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金转型而来。 景顺长城景瑞双利定期开放债券型 证券投资基金经中国证监会《关于准予景顺长城 景瑞双利定期开放债券型证券投资基金注册的 批复》（证监许可[2016]1771 号）准予募集注册，基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金 托管人为兴业银行股份有限公司。 景顺长城景瑞 双利定期开放债券型证券投资基金自 2016 年 11 月 21 日至 2017 年 1 月 20 日进行公开募集， 募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。 经 中国证监会书面确认，《景顺长城景瑞双利定期 开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日生效。 景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资 基金在第一次自由开放期的最后一日（ 2018 年 1 月 31 日）日终发生基金净资产低于 5000 万元的情况，触发了《景顺长城景瑞双利定期开放债券 型证券投资基金基金合同》（以下简称 “ 原基金 合同” ）约定的转型条款，经中国证监会备案，景 顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金 转型为普通开放式基金，即本基金。

第四部分基金的历史沿革 景顺长城政策性金融债债券型证券投资基 金由景顺长城景瑞双利债券型证券投资基 金由景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资 基金转型而来。 景顺长城景瑞双利定期开放 债券型证券投资基金经中国证监会《关于准予 景顺长城 景瑞双利定期开放债券型证券投资基 金注册的批复》（证监许可[2016]1771 号）准予 募集注册， 基金管理人为景顺长城基金管理有 限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。 景顺长城景瑞双利定期开 放债券型证券投资基 金自 2016 年 11 月 21 日至 2017 年 1 月 20 日进行公 开募集， 募集结束后基金管理人向中国证监会 办理备案手续。 经中国证监会书面确认，《景顺 长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基 金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日生效。 景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资 基金在第一次自由开放期的最后一日（ 2018 年 1 月 31 日） 日终发生基金净资产低于 5000 万 元的情况，触发了 《景顺长城景瑞双利定期开 放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称 “ 原基金合同” ）约定的转 型条款，经中国证监 会备案， 景顺长城景瑞双利定期开放债券型证 券投资基金于 2018 年 6 月 20 日正式转型为普通 开放式基金， 即景顺长城景瑞双利债券型证券 投资基金。 2019 年 1 月 31 日至 2019 年 2 月 26 日景顺长 城景瑞双利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 于景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金修改 投资相关内容、 基金管理费率和托管费率以及 基金合同终止的事由等相关事项的议案》，内 容包括修改投资范围、 投资策略、 业绩比较基 准、基金管理 费率、托管费率以及基金合同终止 的事由， 以及根据现时有效的法律法规修订基 金合同等， 并同意将景顺长城景瑞双利债券型 证券投资基金更名为 “ 景顺长城政策性金融债 债券型证券投资基金” ， 上述基金份额持有人 大会决议自表决通过之日起生效。 自生效决议 公告之日起，《景顺长城政策性金 融债债券型 证券投资基金基金合同》生效，《景顺长城景瑞 双利债券型证券投资基金基金合同》同日起 失效。

第五部分基金 的存续

第五部分基金的存续 《基金合同》生效后，连续二十个工作日出 现基金份额持有人数量不满二百人或者 基金资 产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在 定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前 述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并 提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合 并或者 终止基金合同等，并召开基金份额持有人 大会进行表决。

第五部分基金的存续 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 期报告中予以披露。 基金合同存续期内， 如果 存在连续 60 个工 作日基金份额持有人数量不满 200 人情形，但未 出现连续 60 个工作日基金资产净值低 于 5000 万元情形的， 基金管理人应当向中国证监会报 告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基 金合并或者终止基金合同等， 并召开基金份额 持有人大会进行表决。 基金合同存续期内， 如果存在连 续 60 个工 作日基金资产净值低于 5000 万元情形， 无论是否出现连续 60 个工作日基金份额持有人数量 不 满 200 人情形的，基金管理人应当终止本基金合 同，无需召开基金份额持有人大会。 法律法规另有 规定时，从其规定。

第六部分基金 份额的申购与 赎回

六、申购和赎回的价格、费用及其用途 8、当发生大额申购或赎回情形时，在履行适当程序后，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。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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。

第七部分基金 合同当事人及 权利义务

(二) 基金管理人的权利与义务 (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(二) 基金管理人的权利与义务 (12) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

第七部分基金 合同当事人及 权利义务

二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：兴业银行股份有限公司 住所：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立时间：1988 年 8 月 26 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74 亿元人民币 存续期间：持续经营

二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：兴业银行股份有限公司 住所：福州市湖东路 154 号 法定代表人：高建平 成立时间：1988 年 8 月 22 日 批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号 组织形式：股份有限公司 注册资本：207.74 亿元人民币 存续期间：持续经营

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：(1) 终止《基金合同》；

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：(1) 终止《基金合同》，但《基金合同》另有约定的除外；

第八部分基金 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。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》以及本基金与其他基金的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。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》以及本基金与其他基金的合并以特别决议通过方为有效。

第九部分基金 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 (一) 基金管理人的更换程序 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管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 (一) 基金管理人的更换程序 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；

第九部分基金 管理人、基金 托管人的更换 条件和程序

(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。 新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理 人核对基金资产总值；

第十二部分基 金的投资

一、投资目标 本基金主要通过投资于固定收益品种，同时 适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险和追求基金资产长期 稳定的基础上， 力争获取高于业绩比较基准的投 资收益， 为投资者提供长期稳定的回报。

一、投资目标 本基金在严格控制风险和追求基金资产长 期稳定的基础上， 力争获取高于业绩比较基准的投资收益， 为投资者提供长期稳定的回报。

第十二部分基 金的投资

二、投资范围 本基金的投资范围主要包括债券（包括国内 依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、 企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换 债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、中央银行票据、中期票据、 短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产 支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、 定期存款）等。 本基金同时投资于国内依法发行 上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国 证监会核准上市的股票）、 权证以及法律法规或 中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需 符合中国证监会的相关规定。 本基金投资组合的比例范围为： 本基金对债券资产的投资比例不低于基金 资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比 例不超过基金资产的 20%，其中， 本基金持有的全 部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现 金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例 不低于基金资产净值的 5%， 其中现金不包括结 算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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， 包括国内依法发行上市的政策性金融 债、国债、地方政府债、债券回购、央行票据、银 行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投 资的其他金融工具， 但须符合中国证监会相关 规定。本基金不参与股票、权证等权益类资产的 投资，同时本 基金不投资于公司债、企业债、短 期融资券、中期票据等信用债品种。本基金界定 的政策性金融债指国家开发银行、 中国农业发 展银行、中国进出口银行发行的金融债券。 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。 本基金投资组合的比例 范围为： 本基金对债券资产的投资比例不低于基金 资产的 80%，投资于政策性金融债（国家开发 银行、 中国农业发展银行、中国进出口银行发行 的金融债券） 比例不低于非现金基金资产的 80%。 本基金持 有现金或到期日在一年以内的 政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备 付金、存出保证金 和应收申购款等。 如果法律法规或中国证监会变更投资品种 的投资比例限制， 基金 管理人在履行适当程序 后，可以调整上述投资品种的投资比例。

第十二部分基 金的投资

三、投资策略 本基金的主要投资策略包括： 资产配置策 略、固定收益类资产投资策略、权益资产投资 策略，在严格控制风险的前提下， 发掘和利用市场 失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。 1、资 产配置策略 本基金运用自上而下的宏观分析和自下而 上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置， 把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会， 根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券 类、货 币类、权益类等大类资产的预期收益率水 平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分 析，进行大类 资产配置。 2、固定收益类资产投资策略（1）债券类属资产配置 基金管理人根据国债、金融债、企业 （公司） 债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国 债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析， 主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的 投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种 的投资 比例，以获取不同债券类属之间利差变化 所带来的投资收益。（2）债券投资策略 债券投资在保证资 产流动性的基础上，采取 利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积 极性投资方法，力求在控制各 类风险的基础上获 取稳定的收益。①期限结构策略 收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏 观经济基本 面以及货币政策，而投资者的期限偏 好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有 一定影响。对收

收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。定性方法为：在对经济周期和货币政策分析下，对收益率曲线形状可能变化给予一个方向判断；定量方法为：参考收益率曲线的历史趋势，同时结合未来的各期限的供给分布以及投资者的期限偏好，对未来收益率曲线形状做出判断。在对于收益率曲线形状变化和变动幅度做出判断的基础上，结合情景分析结果，提出可能的期限结构配置策略，包括：子弹型策略、哑铃型策略、梯形策略等。

②利率预期策略 基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

③信用策略 基金管理人密切跟踪国债、金融债、企业（公司）债等不同债券种类的利差水平，结合各类债券税收状况、流动性状况以及发行人信用质量状况的分析，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间的配置比例。在个券选择层面，基金管理人自建债券研究资料库，并对所有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后，进行各券选择。财务分析方面，以企业财务报表为依据，对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分，非财务分析方面（包括管理能力、市场地位和发展前景等指标）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

④时机策略 i 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。ii 息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。iii 利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时，可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

（3）资产支持证券投资策略 本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（4）中小企业私募债券投资策略 对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

（5）杠杆策略 杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

（6）可转换债券投资策略 ①相对价值分析 基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券股性和债性的相对价值。通过对可转换债券转股溢价率和Delta系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。②基本面研究 基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库（SRD）对可转换债券标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。③估值分析 在基本面分析的基础上，运用PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG等相对估值指标以及DCF、DDM等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估。并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。

3、权益资产投资策略 （1）股票投资策略 本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析

投资标的，在定性分析方面重点关注：①成长性（growth）。重点关注企业生存和发展的外部环境，企业享有国家相关的优惠政策的变化，企业关键技术模仿难易程度、和产品定位等。②业务价值（FranchiseValue）重点关注拥有高进入壁垒的上市公司，其一般具有以下一种或多种特征：产品定价能力、创新技术、资金密集、优势品牌、健全的销售网络及售后服务、规模经济等。在经济增长时它们能创造持续性的成长，经济衰退时亦能度过难关，享有高于市场平均水平的盈利能力，进而创造高业务价值，达致长期资本增值。③竞争优势（competitiveadvantage）。重点关注企业的市占率概况、技术优势、创新体制和开发能力、专利权和法规限制、和渠道关系等④管理能力（Management）重点关注公司治理、企业的质量管理、公司的销售网络、管理层的稳定性以及管理班子的构成、学历、经验等，通过实地考察了解其管理能力以及是否诚信。以及企业的战略实施等。⑤自由现金流量与分红政策（Cash GenerationCapability）重点关注企业创造现金流量的能力以及稳定透明的分红派息政策。衡量企业绩效的最终标准在于投资人的长期现金报酬，企业除了需要拥有良好的利润增长以外，也需要能创造足够现金流以供派息和再投资之用。在会计准则弹性太大，盈利容易被操纵的时候，此标准尤显重要，因为创造现金与分红能力永远是一家企业素质的最好体现。在定量分析方面重点关注：①盈利能力。主要指标有资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）等。②成长潜力。主要指标有销售收入增长率、净利润增长率等。③偿债能力。关注目标公司的资产负债结构以及资产流动性状况，重点分析的指标有资产负债率、流动比率、货币资金/总资产、利息保障倍数等。④估值。主要指标有市盈率（PE）、市盈增长比率（PEG）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）、企业价值倍数（EV/EBITDA）等。对成长、价值、收益三类股票设定不同的估值指标。成长型股票（G）：用来衡量成长型上市公司估值水平的主要指标为PEG，即市盈率除以盈利增长率。为了使投资人能够达到长期获利目标，我们在选股时将会谨慎地买进价格与其预期增长速度相匹配的股票。价值型股票（V）：分析股票内在价值的基础是将公司的净资产收益率与其资本成本进行比较。我们在挑选价值型股票时，会根据公司的净资产收益率与资本成本的相对水平判断公司的合理价值，然后选出股价相对于合理价值存在折扣的股票。收益型股票（I）：是依靠分红取得较好收益的股票。我们挑选收益型股票，要求其保持持续派息的政策，以及较高的股息率水平。⑤流动性分析。主要指标有市场流通量、股东分散性等。以上个股考察中不可或缺的部分是合理性分析。因此在研究公司业绩及对公司前景做出预测时，都会对有关公司的业绩和盈利能力做出详细的合理性研究。其中包括把公司的盈利能力与国内同行业的公司作比较、追踪公司的主要生意对手，如供应商、客户、竞争对手等的表现、参考国外同业公司的表现与赢利能力等，务求从多方面评估公司本身的业绩合理性与业务价值。（2）权证投资策略 本基金不直接购买权证等衍生品资产，但有可能持有所持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。

三、投资策略 1、资产配置策略 本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的结构，并通过精选债券，获取优化收益。 2、债券类金融工具投资策略（1）债券类金融工具类属配置策略 类属配置是指对各市场及各种类的债券类金融工具之间的比例进行适时、动态的分配和调整，确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。在品种选择层面，本基金将基于各品种债券类金融工具收益率水平的变化特征、宏观经济预测分析以及税收因素的影响，综合考虑流动性、收益性等因素，采取定量分析和定性分析结合的方法，在各种债券类金融工具之间进行优化配置。（2）久期调整策略 债券投资受利率风险的影响。本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。（3）收益率曲线配置策略 本基金将综合考虑收益率曲线，通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的头寸。在考察收益率曲线的基础上，本基

金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变中获利。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用集中策略；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。（4）息差策略 当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购并将所融入的资金投资于债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。

第十二部分基金的投资

四、投资限制 1、组合限制（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；（2）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；（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）基金的总资产不得超过基金净资产的140%；（6）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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；（7）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%；（8）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%；（9）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%；（10）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%；（11）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%；（12）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的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本项所规定的比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；（13）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投资范围保持一致；（14）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；（15）本基金参与股票发行申购，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；（16）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%；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%；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%；（17）本基金持有单只中小企业私募债券的市值不得超过本基金资产净值的10%；（18）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。除上述第（2）、（12）、（13）、（14）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。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

四、投资限制 1、组合限制（1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于国家开发银行、中国农业发展银行、中国进出口银行发行的金融债券比例不低于非现金基金资产的80%；（2）本基金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、存出保证金和应收申购款等；（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）基金的总资产不得超过基金净资产的140%；（6）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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；（7）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产的15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本项所规定的比例限

制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；（8）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投资范围保持一致；（9）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。除上述第（2）、（7）、（8）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。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

第十二部分基金的投资

五、业绩比较基准 中证综合债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10% 中证综合债券指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央行票据及短融整体走势的跨市场债券指数，其选择是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准是适合作为本基金的业绩比较基准。沪深300指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本的综合性指数，具有良好的市场代表性。

五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：中债-金融债券总指数收益率。中债-金融债券总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数成分券由在境内公开发行且上市流通的政策性银行债组成，是一个反映境内政策性银行债券整体价格走势情况的总指数，具有广泛的市场代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

第十四部分基金资产估值

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。

二、估值对象 基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

第十四部分基金资产估值

三、估值方法 本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：1、证券交易所上市的有价证券的估值（1）除本部分另有约定的品种外，交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；（2）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，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：（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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；（3）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。4、中小企业私募债券 中小企业私募债券，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，按成本估值。5、当发生大额申购或赎回情形时，

在履行适当程序后，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。 6、 如有充足理由认为按上述方法进行估值 不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据 具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允 价值的价格估值。 7、 存在相关法律法规以及监管部门有相关 规范的，从其规定。 如有新增事项，按国家最新规 定估值。

三、估值方法 本基金所持有的投资品种， 按如下原则进 行估值： 1、证券交易所上市的有价证券的估值 （1）除本部分另有约定的品种外，交易所 上市的有价证券， 以其估值日在证券交易所挂 牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且 最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券 发行机构未发生影响 证券价格的重大事件的， 以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交 易日后经济环境发生了重大 变化或证券发行机 构发生影响证券价格的重大事件的， 可参考类 似投资品种的现行市价及重大变化因素， 调整 最近交易市价，确定公允价格； （2）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）交易所上市不存在活跃市场的有价证 券，采用估值技 术确定公允价值。 2、首次公开发行未上市的债券，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，按成本估值； 3、 全国银行间债券市场交易的债券等品 种，采用估值技术确定公允价值。 4、同一债券同时在两个或两个以上市场交 易的，按债券所处的市场分别估值。 5、本基 金持有的回购以成本列示，按合同 利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。 6、本基金持有的银行 存款和备付金余额以 本金列示，按相应利率逐日计提利息。 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。 8、如有充足理由认为按上述方法进行估值 不能 客观反映其公允价值的， 基金管理人可根 据具体情况与基金托管人商定后， 按最能反映 公允价值的价格估值。 9、存在相关法律法规以及监管部门有相关 规范的，从其规定。 如有新增事项，按国家最新 规定估值。

第十四部分基 金资产估值

八、特殊情况的处理 1、 基金管理人或基金托管人按本基金合同 规定的估值方法的第 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。

八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按本基金合同 规定的估值方法的第 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。

第十五部分基 金费用与税收

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： $H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值 基金管理费每 日计算， 逐日累计至每月月 末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对后， 基金托管人按照与基金 管理人协商一致的方式 于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付 给基金管理人。 若遇法定节假 日、公休日或不可 抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日 支付。 2、基金托管人的托管费 本 基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。 托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算， 逐日累计至每 月月 末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对后， 基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式 于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支 取。 若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无 法按时 支付的，顺延至最近可支付日支付。

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 0.3%年费率计提。 管理费的计算方法 如下： $H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值 基金管理费每 日计算， 逐日累计至每月月 末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对一 致后， 基金托管人按照与 基金管理人协商一致 的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一 次性支付给基金管理人。若遇法定节 假日、公休 日或不可抗力致使无法按时支付的， 顺延至最 近可支付日支付。 2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。 托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算， 逐

日累计至每月月末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

第十五部分基金费用与税收

三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失； 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用； 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定执行； 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失； 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用； 3、《基金合同》生效前的相关费用根据《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》的约定执行； 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

第十八部分基金的信息披露

删除：（八）基金投资中小企业私募债券相关信息 1、本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。 2、本基金将在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。（九）投资资产支持证券的信息披露 本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算

二、《基金合同》的终止事由 有下列情形之一的，《基金合同》应当终止： 增加： 3、基金合同存续期内，如果存在连续60个工作日基金资产净值低于5000万元情形，无论是否出现连续60个工作日基金份额持有人数量不满200人情形的，基金管理人应当终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会；

第二十二部分 基金合同的效力

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，自2018年6月20日起，《基金合同》生效，原《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，自201X年X月XX日起（注：待基金份额持有人大会决议生效后补充），《基金合同》生效，原《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

第二十四部分 基金合同内容摘要

摘要部分也做了相应修改，与基金合同修订内容保持一致。

三、本基金招募说明书及托管协议等文件将根据上述修改同步进行相应调整。

四、本次议案的主要风险及预备措施

本次议案存在被基金份额持有人大会否决的风险。

在本基金修改投资相关内容、基金管理费率及托管费率以及基金合同终止的事由的议案之前，我司已对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。议案公告后，我们还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对议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，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金

份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本议案未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案。

景顺长城基金管理有限公司

二零一九年一月二十六日