

中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金

以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告

中金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已于2020年5月26日在《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站发布了《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式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，现发布关于召开本次会议的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

中金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2018]300号文注册募集的中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2018年11月13日成立。

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》等法律法规以及《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，基金管理人经与本基金的基金托管人中国邮政储蓄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《关于中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的议案》。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2020年5月27日起，至2020年6月28日17:00止（投票表决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、会议表决票的寄达地点：

基金管理人：中金基金管理有限公司

地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸三期B座43层

邮政编码：100004

联系人：张显

联系电话：010-63211122-7907

请在信封表面注明“中金瑞和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”。

二、会议审议事项

《关于中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的议案》(以下简称“议案”)(见附件一)。

上述议案的说明请参见《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的方案说明》(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2020年5月27日,即在2020年5月27日交易时间结束后,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。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登陆本基金管理人网站(<http://www.ciccfund.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经授权的业务章或基金管理人认可的其他印章(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、护照或其他身份证明文件)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(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文件)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(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,并提供持有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),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(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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(5) 以上(1)、(2)、(3)、(4)项及本公告全文中的有效身份证明文件、公章、业务章、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妥的表决票和所需的相关文件在自2020年5月27日起,至2020年6月28日17:00止的期间内通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至本公告指定的表决票收件人,并请在信封表面注

明：“中金瑞和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”。

送达时间以指定地址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，以指定地址签收时间为准；以邮寄挂号信方式送达的，以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

五、会议召开的条件和表决票数要求

1、本次会议召开的条件为：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二分之一（含二分之一）。

2、本次会议表决的票数要求为：基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按一般决议处理，《关于中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的议案》须经前述参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效。

3、本次基金份额持有人大会决议，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。

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（中国邮政储蓄银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期（即2020年6月28日）后两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指定地址的，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、意愿无法判断或相互矛盾，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指定地址的，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。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本次持有人大会需要有效表决票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，根据《中华人民共和国证券投资基金法》，本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。

八、本次大会相关机构

1、召集人：中金基金管理有限公司

联系地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层

客服电话：400-868-1166

传真：010-66159121

邮政编码：100004

网址：www.ciccfund.com

2、基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号

电话：010-86353554

3、公证机构：北京市方圆公证处

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街东水井胡同5号

邮政编码：10010

联系人：崔军

联系电话：010-85197622

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，提前寄出表决票，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基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客服电话400-868-1166（免长途话费）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中金基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的议案》

附件二：《中金瑞和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：《授权委托书》

附件四：《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制

和业绩比较基准等有关事项的方案说明》

中金基金管理有限公司

2020年5月27日

附件一

关于中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金 变更投资范围、投资限制 和业绩比较基准等有关事项的议案

中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资运作需求，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》等法律法规以及《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人中金基金管理有限公司经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，审议关于本基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准并相应修改基金合同的有关事项。《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的方案说明》见附件四。

为实施本次方案，提议授权基金管理人办理本次修订基金合同的有关具体事宜，包括但不限于根据《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的方案说明》的相关内容对本基金基金合同进行修订等。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人将在修订后的《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效前预留至少三十个自然日供现有基金份额持有人选择。在选择期期间，由于本基金需应对赎回等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免本基金基金合同中约定的投资组合比例限制等条款。关于选择期的具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

选择期结束的次日《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

以上议案，请予审议。

中金基金管理有限公司

2020年5月27日

附件二

中金瑞和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			
基金份额持有人证件类型	<input type="checkbox"/> 身份证 <input type="checkbox"/> 其他证件:		
基金份额持有人证件号码			
基金份额持有人基金账户号			
受托人(代理人)姓名/名称			
受托人(代理人)证件类型	<input type="checkbox"/> 身份证 <input type="checkbox"/> 其他证件:		
受托人(代理人)证件号码			
审议事项	关于中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的议案		
表决意见表决意见	反对	反对	弃权
基金份额持有人/代理人签字或盖章			
日期: 年 月 日			
<p>说明:</p> <p>1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所填基金账户号的全部基金份额(以权益登记日所登记的基金份额为准)的表决意见。</p> <p>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、意愿无法判断或相互矛盾,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。</p> <p>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指定地址的,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。</p> <p>4、本表决票中“基金账户号”,指持有中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号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。</p>			

(本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站(www.ciccfund.com)下载并打印,在填写完整并签字盖章后均为有效。)

附件三

授权委托书

兹委托_____代表本人(或本机构)参加投票截止日为 年 月 日的以通讯方式召开的中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使对议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):_____

个人委托人身份证件号码:_____

委托人基金账户号:_____

代理人(签字/盖章):_____

代理人身份证件号码:_____

委托日期: 年 月 日

附注:此授权委托书剪报、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。

授权委托书填写注意事项:

1、本授权委托书中“基金账户号”,指基金份额持有人持有本基金的基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户号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。

2、此授权委托书剪报、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

中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金

变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的方案说明

一、声明

1、中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同自 2018 年 11 月 13 日起生效。根据市场环境变化，为更好地满足投资运作需求，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》等法律法规及《中金瑞和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，中金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人中国邮政储蓄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，审议中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准并相应修改基金合同有关事项的议案。

2、本次中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的方案需经参加持有人大会表决的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3、本基金管理人自基金份额持有人大会决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，修订后的《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》将于选择期结束的次日生效。

4、基金份额持有人大会决议通过后，本基金管理人可根据市场情况确定本基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准的具体时间，并确定修订后的基金合同的生效时间，具体安排将由基金管理人在相关公告中列明。

5、中国证监会对本次中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议的备案，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、主要修订内容

（一）增加自动终止条款：“连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不超

过 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会”，并补充相应信息披露条款；

（二）投资范围中增加港股通标的股票，本基金投资港股通标的股票占基金股票资产的比例为 0%-50%，对基金合同中释义、申购赎回、投资范围、投资限制、基金估值、信息披露条款作相应调整，并在前言中增加风险揭示；

（三）投资范围中增加期权，对基金合同中投资范围、投资限制、投资策略、基金估值、信息披露条款作相应调整；

（四）投资范围中增加信用衍生品，对基金合同中释义、投资范围、投资限制、投资策略、基金估值、信息披露条款作相应调整，并在前言中增加风险揭示；

（五）投资范围中增加融资，对基金合同中投资范围、投资限制、投资策略条款作相应调整；

（六）投资范围中删除中小企业私募债券，对基金合同中投资范围、投资限制、投资策略、基金估值、信息披露条款作相应调整；

（七）投资范围中删除权证，对基金合同中投资范围、投资限制、投资策略、基金估值条款作相应调整；

（八）在投资范围、投资限制中增加关于同业存单“本基金投资于同业存单不超过基金资产的 20%”的限制；

（九）增加股票仓位调整策略；

（十）调整业绩比较基准：增加恒生指数，业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率 × 50% + 中债综合财富(总值)指数收益率 × 50%”调整为“沪深 300 指数收益率 × 50% + 恒生指数收益率（使用估值汇率调整） × 10% + 中债综合财富(总值)指数收益率 × 40%”。

三、本基金基金合同生效前后的申购/赎回选择期安排

1、申购/赎回选择期

自《关于中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项的议案》经基金份额持有人大会表决通过之后，本基金在正式实施前将安排至少 30 个自然日的申购/赎回选择期（具体以基金管理人届

时公告为准), 供基金份额持有人做出选择。

2、《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的生效

选择期结束的次日, 基金管理人将根据基金份额持有人大会决议变更投资范围、投资限制和业绩比较基准等有关事项, 修订后的《中金瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于该日起正式生效。

四、基金合同修订前后对照表

章节	标题	修订前	修订后
第一部分 前言			<p>增加如下内容, 并更新后续编号:</p> <p>五、本基金参与内地与香港股票市场交易互联互通机制(以下简称“港股通机制”)下港股通相关业务, 基金资产投资于港股, 会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险, 包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行 T+0 回转交易, 且对个股不设涨跌幅限制, 港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下, 港股通不能正常交易, 港股不能及时卖出, 可能带来一定的流动性风险)等。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化, 选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股, 基金资产并非必然投资港股。</p> <p>本基金的投资范围包括信用衍生品, 投资信用衍生品</p>

			可能存在流动性风险、创设机构违约风险、交易对手风险、法律合规风险和操作风险等。
第二部分 释义		36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日	36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日 <u>(若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购与赎回业务，具体以届时提前发布的公告为准)</u>
第二部分 释义			增加如下内容，并更新后续编号： 55、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制和深港股票市场交易互联互通机制 56、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票 57、信用衍生品：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具
第五部分 基金备案	三、基金存续期内的基金份额持有	《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超过	《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超过 200 人或

	人数量和资产规模	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。	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 个工作日出现前述情形的, <u>本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算并终止,且无需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。</u>
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 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。	1、开放日及开放时间 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(<u>若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日,则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购与赎回业务,具体以届时提前发布的公告为准</u>),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。
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	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,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资人适当调低基金申购费率、赎回费率等。	7、基金管理人可以在对 <u>基金份额持有人利益无实质性不利影响、不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下</u> ,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,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资人适当调低基金申购费率、赎回费率等。
第六部分 基金份额的 申购与	七、拒绝或 暂停申购的 情形	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	3、证券/期货交易所交易时间非正常停市 <u>或者港股通临时停市</u> ,导致基金管理人

赎回		基金资产净值。	无法计算当日基金资产净值。
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		增加如下内容： 10、港股通交易额度不足。
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	发生上述第1、2、3、5、6、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，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的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	发生上述第1、2、3、5、6、8、9、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，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的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第六部分基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形	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。	3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
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为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的	本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、 <u>内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”</u> ）、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、 中小企业私募债券 、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、 权证 、资产支持证券、股指

		<p>其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。</p> <p>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%;在每个交易日日终,在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的 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。</p>	<p>期货、国债期货、银行存款、同业存单、期权、信用衍生品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)。<u>本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。</u></p> <p>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,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。</p> <p>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%,<u>本基金投资港股通标的股票占基金股票资产的比例为 0%-50%</u>,<u>本基金投资于同业存单不超过基金资产的 20%</u>;在每个交易日日终,在扣除国债期货和股指期货和股票期权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的 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。</p>
第十二部分 基金的投资	三、投资策略		<p>删去如下内容并更新后续编号:</p> <p>(三)中小企业私募债的投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债的投资策略主要基于信用品种投资,在此基础上重点分析信用风险及流动性风险。首先,确定经济周期所处阶段,研究中小企业私募债发行人所处行业在经济周期中所受的影响,以确定行业总体信用风险的变动情况,并投资具有积极因素</p>

			的行业；其次，对中小企业私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合中小企业私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价中小企业私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。												
第十二部分基金的投资	三、投资策略		<p>(七) 股票投资策略</p> <p>增加如下内容：</p> <p>本基金根据市场整体估值水平评估系统性风险，根据中证 500 指数的市净率 P/B 决定本基金股票资产的投资比例。本基金将根据上月最后一个交易日中证 500 指数的市净率 P/B 在过去 10 年每日市净率 P/B 中的分位，对本月的股票投资比例做出调整：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>上月最后一个交易日中证 500 指数市净率 P/B 在过去 10 年每日市净率 P/B 中的分位</th> <th>本月股票资产占基金资产的比例下限</th> <th>本月股票资产占基金资产的比例上限</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>90 分位及以上</td> <td>5%</td> <td>50%</td> </tr> <tr> <td>10-90 分位</td> <td>20%</td> <td>90%</td> </tr> <tr> <td>10 分位以下</td> <td>55%</td> <td>95%</td> </tr> </tbody> </table>	上月最后一个交易日中证 500 指数市净率 P/B 在过去 10 年每日市净率 P/B 中的分位	本月股票资产占基金资产的比例下限	本月股票资产占基金资产的比例上限	90 分位及以上	5%	50%	10-90 分位	20%	90%	10 分位以下	55%	95%
上月最后一个交易日中证 500 指数市净率 P/B 在过去 10 年每日市净率 P/B 中的分位	本月股票资产占基金资产的比例下限	本月股票资产占基金资产的比例上限													
90 分位及以上	5%	50%													
10-90 分位	20%	90%													
10 分位以下	55%	95%													
第十二部分基金的投资	三、投资策略		<p>删去如下内容并更新后续编号：</p> <p>(十) 权证投资策略</p> <p>在进行权证投资时，基金管理人将通过权证标的证</p>												

		<p>券基本面的研究，辅助运用权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。</p>
第十二部分 基金的投资	三、投资策略	<p>增加如下内容：</p> <p>（九）融资业务投资策略 本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资交易。本基金将利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> <p>（十）股票期权投资策略 本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，例如指数期权、场外衍生工具等金融产品，本基</p>

			<p>金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。</p> <p>(十一) 信用衍生品投资策略</p> <p>本基金按照风险管理的原则，以风险对冲为目的参与信用衍生品交易。投资过程将结合账户内债券潜在信用风险、流动性等情况综合考量，通过购买对应信用衍生品全部或部分覆盖配置相应债券的信用风险。</p>
第十二部分 基金的投资	四、投资限制	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 0% - 95%；</p> <p>(2) 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，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、应收申购款等；</p> <p>(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%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持，不超过该证券的 10%；</p>	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金股票资产占基金资产的比例为 0% - 95%，<u>本基金投资港股通标的股票占基金股票资产的比例为 0%-50%</u>；</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除国债期货、<u>和股指期货和股票期权</u>合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；</p> <p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值<u>(同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算)</u>不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(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<u>(同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算)</u>，不超过该证券的 10%；</p> <p>(5) <u>本基金投资于同业存单不超过基金资产的 20%</u>；</p>

			<p>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%；</p> <p>（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%；</p> <p>（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%；</p>
第十二部分 基金的投资	四、投资限制	<p>（16）本基金参与股指期货、国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1）在任何交易日日终，本基金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%；</p> <p>2）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；</p> <p>.....</p> <p>（17）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%；</p>	<p>（146）本基金参与股指期货、国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1）在任何交易日日终，本基金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%；</p> <p>2）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；</p> <p>.....</p> <p>（17）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%；</p>
第十二部分 基金的投资	四、投资限制		<p>增加如下内容：</p> <p>（19）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；</p> <p>（20）本基金参与股票期权交易，应遵守下列投资比例限制：</p> <p>1）因未平仓的期权合约支</p>

			<p>付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；</p> <p>2) 开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；</p> <p>3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；</p> <p>(21) 本基金参与信用衍生品交易，需遵守下列投资比例限制，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下述投资比例的，基金管理人应当在3个月内进行调整：</p> <p>1) 本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品，不持有合约类信用衍生品；</p> <p>2) 本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的100%；</p> <p>3) 本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品，名义本金合计不得超过基金资产净值的10%；</p>
第十二部分 基金的投资	四、投资限制	除上述第(2)、第(12)和第(20)-(21)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，但中国证监会另有	除上述第(2)、第(120)和第(2017)-(18)、(21)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，但中国证监会另有规定的或上

		规定的或上述各项另有约定的除外。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。	述各项另有约定的除外。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。
第十二部分 基金的投资	五、业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为：</p> <p>沪深 300 指数收益率 × 50% + 中债综合财富(总值)指数收益率 × 50%。</p> <p>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。中债综合财富(总值)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>本基金的业绩比较基准为：</p> <p>沪深 300 指数收益率 × 50% + 恒生指数收益率（使用估值汇率调整）× 10% + 中债综合财富(总值)指数收益率 × 450%。</p> <p>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。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。中债综合财富(总值)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>
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、期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。	基金所拥有的股票、 权证 、 期货合约 、 股票期权合约 、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	<p>1、证券交易所上市的非固定收益类有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的非固定收益类有价证券(包括股票、权证等)，以其估</p>	<p>1、证券交易所上市的非固定收益类有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的非固定收益类有价证券(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价</p>

		<p>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；</p>	<p>（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；</p>
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法		<p>删去如下内容：</p> <p>（6）中小企业私募债券采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定中小企业私募债券的公允价值。中小企业私募债券采用估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p>
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法	<p>（2）首次公开发行未上市的股票、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；</p>	<p>（2）首次公开发行未上市的股票、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；</p>
第十四部分 基金资产估值	三、估值方法		<p>增加如下内容，并更新后续编号：</p> <p>6、本基金投资股票期权合约，一般以股票期权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。</p> <p>7、港股通投资持有外币证券资产估值涉及到的主要货币对人民币汇率，以估值</p>

			<p>日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。</p> <p>8、信用衍生品</p> <p>(1) 对证券交易所或银行间市场上交易的凭证类信用衍生品，对于存在活跃市场的，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的，应当对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值；</p> <p>(2) 对证券交易所或银行间市场非上市交易的合约类信用衍生品，且估值基准服务机构未提供估值价格的，采用估值技术确定其公允价值；</p> <p>(3) 信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则要求采用合理估值技术确定公允价值。</p>
第十四部分 基金资产估值	八、特殊情况的处理方法	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。	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 118 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	一、基金费用的种类		增加如下内容，并更新后续编号： 11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
第十五部分	二、基金费用	上述“一、基金费用的种	上述“一、基金费用的种类”

分基金费用与税收	用计提方法、计提标准和支付方式	类”中第4-11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。	中第4-11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。
第十八部分基金的信息披露	五、公开披露的基金信息		(七)临时报告 增加如下内容并更新后续编号: 24、连续四十个工作日、五十个工作日、五十五个工作日,本基金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的情形;
第十八部分基金的信息披露	五、公开披露的基金信息		删除如下内容并更新后续编号: (十三)投资中小企业私募债券的信息披露 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,并在季度报告、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。
第十八部分基金的信息披露	五、公开披露的基金信息		增加如下内容,并更新后续编号: (十四)投资股票期权的信息披露 基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与股票期权交易的有关情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等,并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资

		<p>政策和投资目标。</p> <p>(十五) 投资港股通标的股票的信息披露</p> <p>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露港股通投资标的股票的投资情况,包括报告期末本基金在香港地区证券市场的权益投资分布情况及按相关法律法规及中国证监会要求披露港股通投资标的股票的投资明细等内容。</p> <p>(十六) 投资信用衍生品的信息披露</p> <p>基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露信用衍生品的投资情况,包括投资策略、持仓情况等,并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资目标和策略。</p> <p>(十七) 参与融资业务的信息披露</p> <p>基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露参与融资业务情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。</p>
--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------