

华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大润泰双鑫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

华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2017年3月24日成立，并于2019年6月28日收到中国证券监督管理委员会《关于准予华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2019]1175号），根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和《华润元大润泰双鑫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，华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金的基金管理人华润元大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“公司”）经与本基金的基金托管人中国农业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，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6月8日起，至2020年7月6日17:00止（送达时间以指定联系地址收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2020年7月8日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：丁青松

地址：深圳市福田区深南大道4013号兴业银行大厦17楼1706

联系人：518000

联系电话：0755-83024185

请在信封表面注明：“华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

基金份额持有人或其代理人可通过专人送交、邮寄送达至会议通讯表决票的寄达地点收件人处。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话4000-1000-89（免长途费）咨询。

二、会议审议事项

《关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见附件四《关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的说明》。

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2020年6月8日，即在2020年6月8日下午交易时间（北京时间15:00）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与本次基金份额持有人大会并投票表决（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

四、表决票的填写和寄交方式

本次基金份额持有人大会提供纸质投票表决方式。

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、复印表决票或登录本基金管理人网站（www.cryuantafund.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（以下简称“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复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（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（见附件三）。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（见附件三）。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（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（5）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于前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给本基金管理人指定联系地址（专人送达的以实际递交时间为准；通过邮寄方式提交的，以收件日邮戳时间为准）。

基金份额持有人可将填妥的表决票和所需的相关文件邮寄至基金管理人指定联系地址，具体地址和联系方式为：

地址：深圳市福田区深南大道 4013 号兴业银行大厦 17 楼 1706

邮政编码：518000

联系人：丁青松

联系电话：0755-83024185

请在信封表面注明：“华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 4000-1000-89（免长途费）咨询。

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（中国农业银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议表决截止日后 2 个工作日内统计全部有效表决票，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议。

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，且在截止时间之前送达指定联系地址的，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）如多选或表决意见空白的表决票，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本公告的规定，则视为弃权表决，但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指定联系地址的，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，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 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。

(5) 如份额持有人既进行委托授权，又直接投票表决并送达了有效表决票的，则以直接投票表决为有效的表决票，委托授权视为无效。

六、决议生效条件

1、基金份额持有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），则本次通讯开会视为有效；

2、本次议案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二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；

3、基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起 5 日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项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权益登记日基金总份额的二分之一(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，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定及《基金合同》的约定，基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点。

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：华润元大基金管理有限公司

办公地址：深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心 21 层 2103-05 单元

联系电话：4000-1000-89（免长途费）

传真：0755-88399045

网址：www.cryuantafund.com

2、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

3、公证机关：深圳公证处

4、见证律师：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热线：4000-1000-89（免长途费）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、根据基金合同的约定，本次基金份额持有人大会费用以及公证费、律师费等相关费用自基金资产列支。

5、如本次基金份额持有人大会不能成功召开，根据基金合同的有关约定，本基金可能会在规定时间内重新召开基金份额持有人大会。

6、本公告的有关内容由华润元大基金管理有限公司负责解释。

华润元大基金管理有限公司

2020年6月5日

附件一：关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案

附件二：华润元大润泰双鑫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：关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的说明

附件五：华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表

附件一：

关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案

华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金份额持有人：

为应对复杂多变的证券市场环境，维护基金份额持有人的利益，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》等法律法规和《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国农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，调整本基金以下内容：1.调整“基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”设置；2.调整投资范围；3.调整投资策略；4.调整业绩比较基准；5.调整估值方法；6.调整C类基金份额的赎回费率；7.根据前述变更及现行有效的法律法规相应修订基金合同和其他法律文件。基金合同的具体修改内容及对C类基金份额赎回费率的调整情况详见附件四《关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的说明》以及附件五《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表》。

以上议案，请予审议。

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

2020年6月5日

附件二：

华润元大润泰双鑫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(身份证件号/营业执照号) 基金账户号

受托人（代理人）名称： 受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号）：

审议事项（请在表决意见下打钩） 同意 反对 弃权

关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案

基金份额持有人/受托人（代理人）签名或盖章

年月日

说明：

请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。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持全部基金份额的表决意见。如多选或表决意见空白的表决票，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本公告的规定，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。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之前送达指定联系地址的，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。

“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。

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.cryuantafund.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

兹委托先生/女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为年月日的以通讯方式召开的华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。本授权不得转授权。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。若华润元大润泰双鑫债券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）：

委托人身份证号或营业执照号：

委托人基金账户号：

受托人签字/盖章：

受托人身份证号或营业执照号：

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。
- 3、受托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。
- 4、如基金份额持有人一次授权多个受托人或多次授权的，均为有效的纸面授权。能够区分先后次序的，以最后一次授权为准；授权无法区分授权次序，但多次有效的纸面授权意见一致的，以一致的授权表示为准；授权无法区分授权次序，且授权意见不一致的，视为弃权表决票。
- 5、授权委托书中委托人所持基金的份额以持有人大会权益登记日为准。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。
- 6、如份额持有人既进行委托授权，又直接投票并送达了有效表决票的，则以直接投票为有效的表决票，委托授权视为无效。

附件四：

关于修改华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金
基金合同等有关事项的说明

一、声明

- 1、公司华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2016 年 9 月 30 日中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2253 号文准予募集注册，基金成立于 2017 年 3 月 24 日，基金代码为 A 类 003680，C 类 003723。为应对复杂多变的证券市场环境，更好地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》等法律法规和《华润元大润泰双鑫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农业银行股份有限公司协商一致，提议对本基金进行变更注册。基金合同修改的主要内容包括：调整基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模、调整投资范围、调整投资策略、调整业绩比较基准、调整估值方法、调整 C 类基金份额的赎回费率等内容。
- 2、本次基金份额持有人大会需由出席会议的符合要求的基金份额持有人或其代理人所持有有效凭证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）方可召开，且《关于修改华润元大润

泰双鑫债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案》需经参加本次持有人大会表决的基金份额持有人（或代理人）所持表决权的二分之一（含二分之一）以上通过，存在未能达到开会条件或无法获得相关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，基金管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案。中国证监会对本次华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金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、方案要点

（一）调整基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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，基金管理人有权直接终止基金合同，并进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规另有规定时，从其规定。

（二）修改投资范围

修改后为：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公开发行公司债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、国债期货、国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票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。

本基金投资的金融债（不含政策性金融债）、企业债、公开发行公司债券、次级债、中期票据、资产支持证券，其剩余期限均不得超过五年。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，投资港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的50%；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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等；国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行

（三）修改投资策略

修改后为：

1、资产配置策略

本基金以宏观经济及货币政策研究为导向，分析不同类别资产的市场变化，进而采取积极的主动投资管理策略，自上而下确定大类资产配置和信用债券类金融工具类属配置比例，动态调整固定收益类证券组合久期和信用债券的结构，并根据股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测，适度参与一级市场新股与增发新股的申购，力求提高基金收益率。

2、债券投资策略

（1）久期策略

在分析宏观经济指标和财政、货币政策等的基础上，对未来较长一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期，并通过不同债券剩余期限的合理分布，有效地控制利率波动对基金净值波动的影响，并尽可能提高基金收益率。

（2）收益率曲线策略

收益率曲线策略是基于对收益率曲线变化特征的分析，预测收益率曲线的变化趋势，并据此进行投资组合的构建。收益率曲线策略有两方面的内容，一是收益率曲线本身的变化，根据收益率曲线可能向上移动或向下移动，降低或加长整个投资组合的平均剩余期限。二是根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征，通过骑乘策略，投资于最有投资价值的债券。

（3）可转换公司债投资策略

由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。可转债相对价值分析策略首先从可转债的债性和股性分析两方面入手。本基金用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征。本基金用可转债的平价溢价率和可转债的 Delta 系数来衡量可转债的股性特征。

此外，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，最终确定投资的品种。

（4）个券选择策略

在个券选择层面，首先将考虑安全性，优先选择高信用等级的债券品种以规避违约风险。除考虑安全性因素外，在具体的券种选择上，基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上，找出收益率明显偏高的券种，并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格出现低估，本基金将对此类低估值品种进行重点关注。此外，鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。

（5）资产支持证券投资策略

当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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。

（6）流动性管理策略

本基金管理人将在流动性优先的前提下，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性债券种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。同时，基金管理人将密切关注投资者大额申购和赎回的需求变化规律，提前做好资金准备。

（7）国债期货投资策略

本基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目的。本基金在国债期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

3、股票投资策略

本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的策略，适当参与股票投资，以增强组合的获利能力，提高预期收益率。

本基金将根据对宏观经济、行业特性、行业竞争结构、行业商业模式等方面的分析，综合判断行业景气度和行业估值水平，自上而下确定本基金行业投资比例，避免行业集中度过高的风险。

对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：

- ①A 股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A 股缺乏投资标的的行业（如博彩）；
- ②具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；
- ③符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；
- ④与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

（四）修改业绩比较基准

修改后为：

中债综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率×5%。

中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成分券种包括除资产支持证券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数。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，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

（五）调整 C 类基金份额的赎回费率

修改后为：

持有期限（N） 赎回费率 计入基金资产比例

N<7 天 1.50% 100%

7 天≤N 0.00%

（六）其他修改

详见附件五。

三、基金合同的具体修订

详见附件五。

附件五

本次基金合同的修改内容如《华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表》所示，详见下表：

页码 章节 旧版条款 新版条款 修改理由

2 第一部分前言 新增内容：

六、本基金可根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制下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”）或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

基金资产投资港股通标的股票可能使本基金面临港股通交易机制下因投资环境、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。本基金投资港股的具体风险请参见招募说明书“风险揭示”部分。 补充本基金可选择部分资产投资于港股通标的的股票

5 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（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准） 补充若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日的情形

7 第二部分释义 新增内容：

57、港股通：指投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所/深圳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 补充港股通的释义

7 第二部分释义 58、摆动定价机制：指当本基金各类份额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 根据《流动性风险规定》第 40 条，补充摆动定价机制定义

12 第五部分基金备案 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

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。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，基金管理人有权直接终止基金合同，并进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会审议。新增合同终止条款

13 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。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（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准），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。补充若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日的情形

16 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背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期和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，并进行公告。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背法律法规规定及基金合同约定且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期和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，并进行公告。完善表述

16-17 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 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。根据《流动性风险规定》新增关于摆动定价的约定

29 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；更精确的表述

29-30 第八部分基金份额持有人大会 一、召开事由

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低除基金管理费、基金托管费以外的其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内，且在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整本基金的基金份额类别的设置，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式；一、召开事由

2、在法律法规和基金合同规定的范围内，且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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：

(1) 调低除基金管理费、基金托管费以外的其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 调整本基金的基金份额类别的设置，调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式； 更精确的表述

34 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、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。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。 更精确的表述

43 第十二部分基金的投资 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公开发行公司债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、货币市场工具、国债期货、国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等；国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 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，包括债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公开发行公司债券、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、国债期货、国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票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。

本基金投资的金融债（不含政策性金融债）、企业债、公开发行公司债券、次级债、中期票据、资产支持证券，其剩余期限均不得超过五年。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，投资港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%；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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等；国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 投资范围中新增港股通、同业存单，限制部分投资标的的剩余期限，并新增投资组合比例限制

删除“权证”

45-46 第十二部分基金的投资 三、投资策略

3、股票投资策略

本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的策略，适当参与股票投资，以增强组合的获利能力，提高预期收益率。

本基金将根据对宏观经济、行业特性、行业竞争结构、行业商业模式等方面的分析，综合判断行业景气度和行业估值水平，自上而下确定本基金行业投资比例，避免行业集中度过高的风险。 三、投资策略

3、股票投资策略

本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的策略，适当参与股票投资，以增强组合的获利能力，提高预期收益率。

本基金将根据对宏观经济、行业特性、行业竞争结构、行业商业模式等方面的分析，综合判断行业景气度和行业估值水平，自上而下确定本基金行业投资比例，避免行业集中度过高的风险。

对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：

- ①A股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A股缺乏投资标的的行业（如博彩）；
- ②具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；
- ③符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；
- ④与A股同类公司相比具有估值优势的公司。 新增港股投资策略

第十二部分基金的投资 4、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。 删除 统一删除权证相关内容

46 第十二部分基金的投资 四、投资限制

1、组合限制

- (2) 本基金投资于股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；
- (3) 本基金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，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、应收申购款等；

- (4) 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%；

- (5) 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%； 四、投资限制

1、组合限制

(2) 本基金投资于股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，投资港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%；

(3) 本基金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，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、应收申购款等；

(4) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%； 本基金投资港股，对于内地、香港同时上市的情况作出约定 第十二部分基金的投资 (6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%； 删除 统一删除权证相关内容

49 第十二部分基金的投资 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率

中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成分券种包括除资产支持证券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。

本基金可以在按照监管部门要求履行适当程序后调整业绩比较基准并报中国证监会备案，基金管理人应在

调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告，而无需召开基金份额持有人大会。 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率×5%。

中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成分券种包括除资产支持证券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数。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，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

本基金可以在按照监管部门要求履行适当程序后调整业绩比较基准并报中国证监会备案，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒介上刊登公告。 根据实际情况调整

49 第十二部分基金的投资 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

本基金将通过港股通投资于香港证券市场，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。 根据本基金实际情况修改

51 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、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

二、估值对象

基金所拥有的股票、债券、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 删除权证有关内容

51 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) 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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的价格估值；

(3) 交易所上市未实行净价交易的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或第三方估值机构提供的价格进行估值；估值日没有交易且本基金采用的是按收盘价估值的，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； 三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），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，且最近交易日未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的价格估值；

(3) 交易所上市未实行净价交易的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或第三方估值机构提供的价格进行估值；估值日没有交易且本基金采用的是按收盘价估值的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件，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。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，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； 补充完善估值方法

52 第十四部分基金资产估值 三、估值方法

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(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) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 三、估值方法

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(2) 首次公开发行未上市的股票、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) 流通受限股票（包括但不限于首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、非公开发行股票、通过大宗交易取得的带限售期的股票等），按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。 更精确的表述

52 第十四部分基金资产估值 三、估值方法

5、国债期货以估值日的结算价估值，若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。法律法规另有规定的，从其规定。 三、估值方法

5、国债期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。

6、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 补充完善估值方法

56 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。 根据估值方法的调整序号

57 第十五部分基金费用与税收 一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金 C 类基金份额的销售服务费；

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券、期货交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金的开户费用、账户维护费用；

10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金 C 类基金份额的销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 根据实际情况，新增投资港股通的费用

58 第十五部分基金费用与税收 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。 上述“一、基金费用的种类”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。 相应调整

59 第十五部分基金费用与税收 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金托管人划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。 根据最新税收要求进行调整

67 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

五、公开披露的基金信息

(七) 临时报告

23、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；

24、本基金连续 40 个工作日、50 个工作日、55 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，对基金合同可能面临终止的不确定性风险进行提示； 根据《流动性风险规定》第 25 条补充临时报告的内容

补充信披内容

68 第十八部分基金的信息披露 新增内容：

(十三) 投资于港股通标的股票的信息

基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。 本基金投资于港股通标的股票

70 第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算 三、基金财产的清算

4、基金财产清算程序：

(1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金； 三、基金财产的清算

4、基金财产清算程序：

(1) 基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金财产； 更精确的表述