

广发证券资产管理（广东）有限公司

关于以通讯方式召开广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的第二次提示性公告

广发证券资产管理（广东）有限公司已分别于2025年10月16日、2025年10月17日在规定媒介发布了《广发证券资产管理（广东）有限公司关于以通讯方式召开广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》、《广发证券资产管理（广东）有限公司关于以通讯方式召开广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次份额持有人大会顺利召开，现发布《广发证券资产管理（广东）有限公司关于以通讯方式召开广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的第二次提示性公告》。

一、会议基本情况

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39号，以下简称“《操作指引》”）的规定，广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会2019年9月25日《关于准予广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2019〕2356号）准予，由广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划变更而来。《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《集合合同》”）自2019年10月31日起生效。

本集合计划管理人为广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“管理人”或“广发资管”），本集合计划托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“托管人”或“中国银行”）。根据《操作指引》及《集合合同》对本集合计划存续期限的约定，本集合计划将于2025年11月30日到期（如本集合计划展期的，到期日以届时发布的公告为准）。

鉴于以上情况，综合考虑份额持有人需求及本集合计划的长远发展，为充分保护份额持有人利益，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》《操作指引》等法律法规的规定和《集合合同》的有关约定，管理人

经与托管人协商一致，决定以通讯方式召开份额持有人大会，审议《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的议案》。

会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、投票表决起止时间：自2025年10月20日起，至2025年12月5日15:00止（以本公告列明的纸质表决票的寄达地点收到表决票时间或投票系统记录时间为准。各项投票方式的起止时间有所差异，具体详见下文）。

二、会议审议事项

本次持有人大会拟审议的事项为《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的议案》，详见附件一。

上述议案的内容说明见《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的说明》，详见附件二。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2025年10月16日，该日在本集合计划登记机构（中国证券登记结算有限责任公司）登记在册的本集合计划全体份额持有人均有权参加本次份额持有人大会的表决。

四、投票

（一）纸质投票方式

1、本次会议接受纸质投票，表决票样式见附件三。份额持有人可通过剪报、复印或登陆管理人网站（<https://www.gfam.com.cn/>）下载等方式获取表决票。

2、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，并提供本人的有效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（或管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、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）份额持有人可根据本公告“五、授权”章节的规定授权本集合计划的管理人、销售机构以及其他符合法律规定的个人或机构代其在本次份额持有人大会上投票；

（4）以上各项及公告全文中的公章、批文、开户证明、登记证书等，以管理人的认可为准。

3、份额持有人或其代理人需将填妥的表决票原件（否则视为无效）和所需相关文件于前述投票时间内（以本公告规定的收件人收到表决票的时间为准）通过专人送交、邮寄方式送达至以下大会收件人处：

收件人：广发证券资产管理（广东）有限公司

地址：广东省广州市天河区珠江新城马场路26号广发证券大厦32楼前台

联系人：梁丹丹

联系电话：95575

电子邮件：95575@gf.com.cn

邮政编码：510627

请在信封表面注明：“广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人

大会表决专用”

（二）短信投票（仅适用于个人持有人）

为方便份额持有人参与大会投票，自2025年10月20日09:30起，至2025年12月5日15:00以前（以管理人指定系统记录时间为准），管理人和销售机构（如需）可向预留手机号码的个人持有人发送征集投票意见短信，份额持有人根据征集投票意见短信的提示以回复短信即可直接投票。

短信投票方式仅适用于个人持有人，不适用于机构持有人。

（三）电话投票（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会投票，自2025年10月20日09:30起，至2025年12月5日15:00以前（以管理人指定系统记录时间为准），份额持有人可拨打管理人客服电话（95575），并按提示转人工坐席参与本次持有人大会的投票。管理人也可主动与有预留联系方式的份额持有人取得联系。通话过程将以回答提问方式核实份额持有人身份，身份核实后由人工坐席根据份额持有人意愿进行投票记录从而完成持有人大会的投票。为保护份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

电话投票方式仅适用于个人持有人，不适用于机构持有人。

（四）网络投票（仅适用于个人持有人）

为方便份额持有人参与大会投票，自2025年10月20日09:30起，至2025年12月5日15:00以前（以管理人或销售机构指定系统记录时间为准），份额持有人可通过管理人或销售机构提供的互联网通道进行投票。

份额持有人（仅适用于销售机构为广发证券股份有限公司的个人持有人）可自行通过易淘金APP参与本次投票。

份额持有人（仅适用于个人持有人）可自行通过（<https://www.gfam.com.cn/ml>）进行网络投票。

管理人或销售机构也可通过短信等方式向份额持有人发送本次份额持有人大会的网络投票的路径，份额持有人可按提示进行投票操作。份额持有人通过网络投票页面进行投票时，管理人或销售机构将核实份额持有人的身份，确保份额持有人权益。

网络投票方式仅适用于个人持有人，不适用于机构持有人。

（五）其他说明

1、份额持有人的表决意见代表该份额持有人在权益登记日所持全部集合计划份额的表决意见。

2、上述表决的有效期自送达之日（或系统记录之日）起至本次份额持有人大会会议结束之日止。

五、授权

为方便份额持有人参与本次大会并充分表达其意志，份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《集合合同》的约定，份额持有人授权他人在份额持有人大会上表决需遵守以下规则：

（一）委托人

份额持有人授权委托他人行使表决权的票数按该份额持有人在权益登记日所持有的全部集合计划份额数计算，一份集合计划份额代表一票表决权。投资者在权益登记日未持有本集合计划份额的，授权无效。

投资者在权益登记日是否持有本集合计划份额以及所持有集合计划份额的数额，以本集合计划登记机构的登记为准。

（二）受托人（或代理人）

份额持有人可以授权委托本集合计划的管理人、销售机构以及其他符合法律规定的机构或个人，代为参加本次份额持有人大会并行使表决权。

（三）授权方式

本集合计划的份额持有人仅可通过纸面的授权方式，授权受托人代为参加本次份额持有人大会并行使表决权，授权形式及程序应符合本公告的规定：

1、授权委托书样本

授权委托书的样本请见本公告附件四。份额持有人可通过剪报、复印或登录管理人网

站（<https://www.gfam.com.cn/>）下载等方式获取授权委托书样本。

2、纸面授权所需提供的文件

①个人份额持有人授权委托他人投票的，应由委托人填妥并签署授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本），并提供个人有效身份证件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托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、开户证明或登记证书复印件等）。

②机构份额持有人授权委托他人投票的，应由委托人填妥授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章，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、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托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、开户证明或登记证书复印件等）。

③以上各项及公告正文中的公章、批文、开户证明、登记证书等，以管理人的认可为准。

3、纸面授权文件的送达

份额持有人纸面授权文件的送达方式、送达时间、收件地址、联系方式等与纸质表决票送达要求一致。

4、授权效力确定规则

（1）如果同一委托人多次以有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项，不能确定最后一次纸面授权的，以表示具体表决意见的纸面授权为准；最后时间收到的多项纸面授权均表示一致的，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

（2）如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；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

权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

（3）份额持有人以非纸面方式进行授权的，为无效授权；

（4）如委托人既进行委托授权，又亲自参与投票的，则以其亲自投票为准，授权视为无效。

5、份额持有人的授权意见代表份额持有人在权益登记日所持全部集合计划份额的授权意见。

6、上述授权有效期自授权之日起至本次份额持有人大会会议结束之日止；但如果本集合计划根据本公告“九、二次召集份额持有人大会”章节的规定就相同审议事项重新召集持有人大会的，上述授权继续有效。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：本公告通知的表决截止日期后2个工作日内，由本集合计划管理人授权的两名监督员在托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关的公证员统计全部有效表决，并对计票过程及结果予以公证。

2、份额持有人所持每一集合计划份额拥有平等的表决权。本集合计划持有人所持每份集合计划份额享有一票表决权。

3、纸质表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间之内送达本公告规定的收件人的，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，其所代表的集合计划份额计入参加本次份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选、无法辨认、模糊不清或意愿无法判断、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，其所代表的集合计划份额计入参加本次份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

（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份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

（4）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作出了不同表决意见，计入弃权表决票；

③送达时间以本公告规定的收件人收到的时间为准。

4、如果同一委托人存在包括有效纸质方式表决和有效非纸质方式表决的，以有效的纸质表决为准。

5、如果同一委托人只存在纸质方式表决以外的有效的其他方式表决时，以有效的该种表决方式为准；多次以其他方式表决的，以最后一次有效投票结果为准。

七、本次通讯会议方式有效的条件

同时符合以下条件时，本次通讯开会的方式视为有效：

1、管理人按《集合合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、管理人按集合合同约定通知托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。管理人在托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取份额持有人的书面表决意见；托管人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，份额持有人所持有的份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见份额持有人所持有的份额小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一，召集人可以在原公告的份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集份额持有人大会。重新召集的份额持有人大会应当有代表三分之

一以上（含三分之一）份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

4、上述第3项中直接出具书面意见的份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《集合合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记注册机构记录相符；

5、会议通知公布前按规定报相关监管部门备案。

八、决议生效条件及公告安排

同时符合以下条件时，本次会议决议自表决通过之日起生效：

1、本次通讯开会的方式视为有效；

2、《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的议案》应当经参加大会的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。

本次份额持有人大会的表决结果将自表决结果最终形成之日起2日内在规定媒介上公告。本次会议的公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

本次份额持有人大会的决议，管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案。

管理人、托管人和份额持有人应当执行生效的份额持有人大会的决议。生效的份额持有人大会决议对全体份额持有人、管理人、托管人均有约束力。

九、二次召集份额持有人大会

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《集合合同》的规定，本次持有人大会是通讯开会形式，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份额持有人所代表的集合计划份额占权益登记日集合计划总份额的二分之一以上（含二分之一），通讯开会的方式视为有效；如果本次份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，管理人可以在原公告的份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集份额持有人大会，重新召集的份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之

一) 集合计划份额的持有人参加方可召开, 且确定有权出席会议的份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

重新召集份额持有人大会时, 对于投票而言, 份额持有人在本次份额持有人大会所投的有效表决票依然有效, 但如果份额持有人重新进行投票的, 则以最新的有效表决票为准。对于授权而言, 本次份额持有人大会份额持有人作出的各类授权依然有效, 但如果份额持有人重新作出授权的, 则以最新有效授权为准, 详细说明见届时发布的重新召集份额持有人大会的通知。

十、本次大会相关机构

1、召集人: 广发证券资产管理(广东)有限公司

联系电话: 95575

联系人: 张紫欣

传真: (020) 31420467

网址: <https://www.gfam.com.cn/>

电子邮件: 95575@gf.com.cn

2、托管人: 中国银行股份有限公司

住所及办公地址: 北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人: 葛海蛟

联系电话: 95566

3、公证机构: 广东省广州市广州公证处

地址: 广东省广州市越秀区东风中路437号越秀城市广场南塔十一楼

联系人: 郑晓晓、陈睿君

联系电话: (020) 83569500、(020) 83569605

邮政编码: 510000

4、见证律师事务所：广东广信君达律师事务所

地址：广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州周大福金融中心29层、10层、11层（01-04单元）

联系人：刘智

电话：（020）37181333

十一、重要提示

1、请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。

2、如本次份额持有人大会不能成功召开，本集合计划可以根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《集合合同》的规定重新召集份额持有人大会。

3、根据《集合合同》的规定，本次份额持有人大会公证费和律师费用等可从集合计划资产列支，上述费用支付情况将另行公告。

4、本公告的有关内容由广发证券资产管理（广东）有限公司负责解释。如有必要，广发证券资产管理（广东）有限公司可对本公告相关事项进行补充说明。

附件一：《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的议案》

附件二：《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的说明》

附件三：《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票》

附件四：《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会授权委托书（样本）》

附件五：《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后条文对照表

广发证券资产管理（广东）有限公司

2025年10月20日

附件一：关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的议案

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人：

综合考虑份额持有人需求及本集合计划的长远发展，为充分保护份额持有人利益，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》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法律法规规定和《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的有关约定，广发证券资产管理（广东）有限公司经与托管人为中国银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会，提议审议广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金的议案，变更产品名称、变更产品管理人、变更产品基金经理、变更存续期限、变更投资范围、变更投资比例、变更投资限制、变更投资策略、变更业绩比较基准、变更估值方法、变更申购费、变更赎回款项支付时间、变更风险收益特征等以及可能进行份额折算，并相应修订产品法律文件。具体方案可详见附件二《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的说明》。

本议案需根据《资产管理合同》成功召开份额持有人大会，并由参加大会的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。本议案如获得份额持有人大会审议通过，为实施产品变更管理人等转型方案，提议授权管理人办理本产品转型变更及转型变更法律文件修改的有关具体事宜，并授权管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见届时发布的相关公告。

以上议案，请予审议。

管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

附件二：《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的说明》

一、重要提示

（一）根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39号，以下简称“《操作指引》”）的规定，广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会2019年9月25日《关于准予广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2019]2356号）准予，由广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划变更而来。《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《集合合同》”）自2019年10月31日起生效。

本集合计划管理人为广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“管理人”或“广发资管”），本集合计划托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“托管人”或“中国银行”）。根据《操作指引》及《集合合同》对本集合计划存续期限的约定，本集合计划将于2025年11月30日到期（如本集合计划展期的，到期日以届时发布的公告为准）。

鉴于以上情况，综合考虑份额持有人需求及本集合计划的长远发展，为充分保护份额持有人利益，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》《操作指引》等法律法规的规定和《集合合同》的有关约定，管理人经与托管人协商一致，决定以通讯方式召开份额持有人大会，审议本集合计划变更管理人为管理人唯一股东广发证券股份有限公司的控股子公司广发基金管理有限公司（以下简称“广发基金”），广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划相应变更为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金的议案。

（二）本次广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人等事宜属于对原注册事项的实质性调整，经管理人向中国证监会申请，已经获中国证监会准予变更注册。中国证监会准予此次变更注册不表明其对集合计划的投资价值及市场前

景做出实质性判断或保证。

（三）本次议案需经参加持有人大会的集合计划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，存在无法获得集合计划份额持有人大会表决通过的可能。

（四）集合计划份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，并自通过之日起5日内报中国证监会备案。集合计划份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。

二、变更的主要内容

（一）变更产品名称

产品名称由“广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划”变更为“广发乾利一年持有期债券型证券投资基金”。

（二）变更产品管理人

产品管理人由“广发证券资产管理（广东）有限公司”变更为“广发基金管理有限公司”。

（三）变更产品基金经理

产品投资经理由“广发证券资产管理（广东）有限公司旗下投资经理骆霖苇、潘浩祥”变更为“广发基金管理有限公司旗下基金经理陈韞慧”。

（四）变更存续期限

存续期限从“本集合合同生效日起存续期至2025年11月30日”变更为“不定期”。

（五）变更投资范围

投资范围增加信用衍生品、存托凭证、港股通标的，删除股指期货。删除原表述中：“其中企业债、公司债、中期票据、超短期融资券等信用债的主体、债项或担保方信用等级评级不低于AA，短期融资券债项评级不低于A-1”。

（六）变更投资比例

投资比例由“本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的**80%**；投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的**20%**；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的**5%**，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

变更为“本基金为债券型基金，投资于债券资产的比例不低于基金资产的**80%**；投资于股票、可转换债券与可交换债券的比例合计不超过基金资产的**20%**（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的**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，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%**，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

（七）变更投资限制

根据投资范围的变动相应修改投资限制；

删除“本集合计划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集合计划资产净值的**40%**，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为**1**年，债券回购到期后不得展期”条款；

删除“股指期货”投资限制条款；

增加“信用衍生品”、“港股通标的”、“存托凭证”投资限制条款。

（八）变更投资策略

修改股票投资策略、删除股指期货投资策略、增加信用衍生品投资策略。

信用债投资策略增加：“本基金投资于信用债（包括资产支持证券，下同）的信用评级为**AA+**及以上，投资于信用评级为**AA+**的信用债占信用债资产的比例不高于**50%**，投资于信用评级为**AAA**的信用债占信用债资产的比例不低于**50%**。上述信用评级为主体评级，如无主体评级，参考债项评级，评级机构及评级标准以本基金管理人认定为准。本基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，原则上在评级报告

发布之日起3个月内予以全部卖出。”

（九）变更业绩比较基准

由“中债-综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%”修改为“中债-综合全价（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%”。

（十）变更估值方法

根据中国证券投资基金业协会《关于固定收益品种的估值处理标准》等相关规定相应调整估值方法。

（十一）变更申购费

A类基金份额申购费原为：

申购金额（M）	适用申购费率
M<100万元	0.50%
100万元≤M<500万元	0.30%
M≥500万元	1000元/笔

拟变更为：

申购金额（M）	适用申购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.50%
300万元≤M<500万元	0.30%
M≥500万元	1000元/笔

（十二）变更赎回款项支付时间

“T+5日内支付赎回款项”变更为“T+7日内支付赎回款项”。

（十三）风险收益特征

增加“港股通标的”相关风险。

最后，根据最新的法律法规的修订情况，对法律文件的相关内容一并进行了修订。具体修订内容请见附件五：《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后条文对照表。

三、变更方案要点

1、赎回选择期

本次集合计划持有人大会决议生效后，将在转型正式实施前安排不少于5个交易日的赎回选择期，以供集合计划份额持有人做出选择（如赎回、转出等），各类份额在此期间的赎回、转出不受一年最短持有期限限制且均不收取赎回费，具体时间安排详见管理人届时发布的相关公告。在赎回选择期期间，由于需应对赎回、转出等情况，集合计划份额持有人同意豁免《资产管理合同》中约定的投资组合比例限制等条款。

2、选择期安排

管理人提请集合计划份额持有人大会授权管理人办理相关事项，并授权管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出等。

3、《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的生效

赎回选择期结束后，管理人将根据基金份额持有人大会决议执行基金的正式变更，《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的生效时间及开放申购赎回的具体安排将由广发基金届时另行发布相关公告。

赎回选择期间未赎回的持有人，其持有的份额将默认结转为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金对应类别的基金份额。持有人可在广发乾利一年持有期债券型证券投资基金的销售机构选择基金收益分配方式：现金分红或红利再投资，若持有人不选择，广发乾利一年持有期债券型证券投资基金默认的收益分配方式为现金分红。

4、对于通过原为本集合计划的销售机构申购、且该销售机构仍然销售转型后的基金、在赎回选择期末赎回集合计划份额的投资者，其持有的集合计划份额，将在《广发乾利

一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效日自动变更为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金A类基金份额或C类基金份额。基金份额持有人可在《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效后依据《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的约定，在原销售机构对相应基金份额进行赎回及其他交易。

对于通过原为本集合计划的销售机构申购、且该销售机构未销售转型后的基金、在赎回选择期末赎回集合计划份额的投资者，其持有的集合计划份额，将在《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效日统一变更为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金A类基金份额或C类基金份额。在赎回选择期结束后，若投资者已自行开立广发基金直销账户的，广发基金代为将投资者持有的份额转托管至广发基金直销账户，投资者可通过广发基金直销平台进行后续业务操作；若投资者未开立广发基金直销账户的，广发基金将统一为投资者开立广发基金直销账户，并将投资者持有的份额转托管至广发基金直销账户，若投资者的开户信息不完整，该账户的后续业务操作将受到限制，投资者需要在广发基金直销平台按照要求补充完善信息并完成相关操作后，该账户才能正常交易；若因投资者个人原因未能开立广发基金直销账户，广发基金统一将这部分投资者持有的份额转托管至由广发基金在中国证券登记结算有限责任公司开立的临时账户下，投资者在《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效日后需对持有的份额通过广发基金提交申请进行重新确认和登记，将对应份额确认至投资者的基金账户上，此过程即为“确权”，确权完成后，投资者方可依据《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的约定，对相应基金份额进行赎回及其他交易。在投资者完成“确权”前，登记在临时账户的份额及其相应的收益分配方式统一为红利再投资，收益分配后的全部份额将继续登记在广发基金开立的临时账户，直至持有人完成“确权”。转托管的时间为《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效前一交易日。

4、管理人有权在《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效日前进行份额折算，如进行份额折算，具体折算方案和折算结果将另行公告。

5、本集合计划将于本次集合计划份额持有人大会决议生效后启动办理变更管理人及变更注册的相关交接手续，届时将另行发布相关公告。

四、主要风险及预备措施

（一）集合计划份额持有人大会未能成功召开或议案被集合计划份额持有人大会否决的风险

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定及《资产管理合同》的约定，集合计划份额持有人大会应当由权益登记日代表集合计划总份额的二分之一（含二分之一）以上集合计划份额的持有人参加，方可召开。为防范本次集合计划份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开，管理人将在会前尽可能与集合计划份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加集合计划份额持有人大会。

如有必要，管理人将根据集合计划份额持有人意见，对资产管理合同变更方案进行适当修订，并重新公告。集合计划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集合计划份额持有人大会的召开的充分准备。如果本次议案未获得集合计划份额持有人大会通过，集合计划管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向集合计划份额持有人大会提交本次议案。

（二）集合计划份额持有人集中赎回份额的流动性风险

为应对可能引发的大规模集中赎回，本集合计划会尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。管理人将根据赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制本集合计划的市场风险。

（三）集合计划份额持有人在赎回选择期后无法申购赎回的风险

赎回选择期结束后，管理人将根据基金份额持有人大会决议执行基金的正式变更，为保证顺利实施本集合计划变更注册的方案，广发资管可根据相应要求暂停本集合计划

的申购、赎回业务，暂停申购、赎回的具体安排以后续公告为准，请投资者注意查看。

投资者存在赎回选择期结束后、广发基金开放申赎安排前无法申购赎回的风险。

附件三：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票

份额持有人姓名或名称			
份额持有人证件号码			
份额持有人持有份额	以权益登记日份额为准		
审议事项	同意	反对	弃权
《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发乾利一年持有期债券型证券投资基金有关事项的议案》			
份额持有人/受托人签名或盖章 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。本表决意见代表份额持有人在权益登记日所持全部集合计划份额的表决意见。表决意见未选、多选、模糊不清、无法辨认或意愿无法判断、相互矛盾，但其他各项符合会议通知规定的表决票视为弃权表决，计入有效表决票，且其所持全部集合计划份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明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《广发证券资产管理（广东）有限公司关于以通讯方式召开广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》规定的收件人的，表决票计为无效表决票。			

附件四：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会授权委托书（样本）

本人（或本机构）持有广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）的集合计划份额，就广发证券资产管理（广东）有限公司官网（<https://www.gfam.com.cn/>）及其他规定媒介公布的《广发证券资产管理（广东）有限公司关于以通讯方式召开广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》所述需份额持有人大会审议的事项，本人（或本机构）的意见为（请在意见栏下方划“√”）：

同意	反对	弃权

本人（或本机构）特此授权_____（证件号码为：_____）代表本人（或本机构）参加广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会，并按照上述意见行使对相关议案的表决权。

上述授权有效期自签署日起至本次份额持有人大会会议结束之日止；但如果本集合计划根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《集合合同》及相关公告的规定就相同审议事项重新召集持有人大会的，本授权继续有效。

委托人姓名/名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（填写）：

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项:

1. 份额持有人可以委托本集合计划的管理人、销售机构以及其他符合法律规定的机构和个人，代为参加本次份额持有人大会并行使表决权。
2. 份额持有人的授权意见代表份额持有人在权益登记日所持全部集合计划份额的授权意见。
3. 如委托人未在授权委托书中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托书中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。
4. 本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，指份额持有人申购本集合计划时的证件号码或该证件号码的更新。
5. 如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本集合计划的集合计划份额，则其授权无效。

附件五：《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后条文对照表

全文	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划	广发乾利一年持有期债券型证券投资基金
全文	广发证券资产管理（广东）有限公司	广发基金管理有限公司
全文	集合资产管理计划/集合计划/集合 集合合同/资产管理合同 管理人 托管人 份额 份额持有人 份额净值 份额累计净值 份额转换 指定媒介 指定报刊 指定网站 书面表决意见/书面意见	基金 基金合同 基金管理人 基金托管人 基金份额 基金份额持有人 基金份额净值 基金份额累计净值 基金转换 规定媒介 规定报刊 规定网站 表决意见
第一部分 前言	一、订立广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同（以下简称“本集合合同”）的目的、依据和原则 2、订立本集合合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《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》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用〈	一、订立广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同（以下简称“本基金合同”）的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《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》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。

<u>关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（以下简称“《操作指引》”）和其他有关法律法规。</u> <u>三、集合计划由管理人依照《基金法》、集合合同及其他有关规定变更，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</u> 中国证监会对<u>本集合计划</u>的注册，并不表明其对本<u>集合计划</u>的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本<u>集合计划</u>没有风险。 管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用<u>集合计划</u>财产，但不保证投资于本<u>集合计划</u>一定盈利，也不保证最低收益。 投资者应当认真阅读<u>集合计划</u>招募说明书、<u>集合计划</u>产品资料概要、<u>集合合同</u>等信息披露文件，自主判断<u>集合计划</u>的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。<u>本集合合同关于集合计划产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。</u> <u>四、管理人、托管人在本集合合同之外披露涉及本集合计划的信息，其内容涉及界定集合合同当事人之间权利义务关系的，如与集合合同有冲突，以集合合同为准。（删除，以下序号依次调整）</u> 	 <u>三、广发乾利一年持有期债券型证券投资基金由广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更而来，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</u> <u>广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划由广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划变更而来，广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划由广发证券资产管理（广东）有限公司依照《基金法》等法律法规及中国证监会的规定变更，并经中国证监会批准。</u> <u>（新增）</u> 中国证监会对<u>原集合计划</u>变更为本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值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。 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用<u>基金</u>财产，但不保证投资于本<u>基金</u>一定盈利，也不保证最低收益，<u>也不保证本金不受损失。</u> 投资者应当认真阅读<u>基金</u>招募说明书、<u>基金</u>产品资料概要、<u>基金合同</u>等信息披露文件，自主判断<u>基金</u>的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。<u>基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。</u> <u>六、红利再投资的基金份额的持有期起始日，按原份额的持有期</u>
---	---

		起始日计算。 七、本基金可投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制试点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”），但会根据市场环境的变化以及投资策略的需要进行调整，选择将部分基金资产投资于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，因此本基金存在不对港股进行投资的可能。 八、本基金资产若投资于港股，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。 九、为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。 十、本基金面临投资特定品种（包括国债期货、资产支持证券、存托凭证等）的特有风险，详见本基金招募说明书。（新增）
第二部分 释义	…… 7、<u>集合计划产品资料概要</u>：指《<u>广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要</u>》及其更新（<u>集合计划产品资料概要的编制、披露及更新将不晚于2020年9月1日起执行</u>）（删除） …… 11、《<u>信息披露办法</u>》：指中国证监会2019年7月26日颁布、自2019年9月1日起实施的《<u>公开募集证券投资基金信息披露管理办法</u>》及颁布机关对其不时做出的修订 ……	…… 7、<u>基金产品资料概要</u>：指《<u>广发乾利一年持有期债券型证券投资基金产品资料概要</u>》及其更新 …… 11、《<u>信息披露办法</u>》：指中国证监会2019年7月26日颁布、自2019年9月1日起，并经2020年3月20日中国证监会《<u>关于修改部分证券期货规章的决定</u>》修正的《<u>公开募集证券投资基金信息披露管理办法</u>》 …… 15、《<u>互联互通规定</u>》：指中国证监会2016年9月30日颁布并实施的

		<u>《内地与香港股票市场交易互联互通机制若干规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u> <u>16、《沪港通业务实施办法》：指上海证券交易所2014年9月26日颁布并实施的《上海证券交易所沪港通业务实施办法》及上海证券交易所对其不时做出的修订</u> <u>17、《深港通业务实施办法》：指深圳证券交易所2016年9月30日颁布并实施的《深圳证券交易所深港通业务实施办法》及深圳证券交易所对其不时做出的修订</u> <u>18、《互联互通指引》：指中国证监会2016年10月11日颁布并实施的《证券基金经营机构参与内地与香港股票市场交易互联互通指引》</u> <u>19、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互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称沪港通）和深港股票市场交易互联互通机制（以下简称深港通）</u> <u>20、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（新增，以下序号依次调整）</u> <u>21、大集合产品、集合计划或集合资产管理计划：管理人依据《操作指引》进行规范，经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划，并按照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定管理运作</u> <u>23、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局</u> <u>27、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》（包括其不时修</u>
--	--	---

	15、<u>大集合产品</u>：管理人依据《操作指引》进行规范，经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划，并按照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定管理运作 17、<u>银行业监督管理机构</u>：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会 21、<u>合格境外机构投资者</u>：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 22、<u>人民币合格境外机构投资者</u>：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人 23、<u>投资人、投资者</u>：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称 25、<u>集合计划销售业务</u>：指管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。 30、<u>集合计划交易账户</u>：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回等业务而引起的份额变动及结余情况的账户 31、<u>集合合同生效日</u>：指根据《操作指引》变更后的《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效日	<u>订）及相关法律法规规定，经中国证监会批准，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</u> 28、<u>投资人、投资者</u>：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称 30、<u>基金销售业务</u>：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，销售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。 35、<u>基金交易账户</u>：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 36、<u>基金合同生效日</u>：指《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效之日，原《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效 37、<u>基金合同终止日</u>：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案后予以公告的日期 38、<u>存续期</u>：指基金合同生效至终止之间的不定期期限 40、<u>锁定持有期</u>：对于每份基金份额，锁定持有期指基金份额申购确认日（包括持有广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划至本基金合同生效日的基金份额以及基金合同生效后的申购基金份额）起（即锁定持有期起始日），至原集合计划份额或基金份额申购确认日次年的年度对日前一日（即锁定持有期到期
--	---	--

32、<u>集合合同终止日</u>：指2025年11月30日，或者根据集合合同约定的提前终止之日，中国证监会另有规定或要求的，按其规定或要求执行 33、<u>存续期</u>：指集合合同生效至终止之间的期限 35、<u>锁定持有期</u>：对于每份集合计划份额，锁定持有期指集合合同生效日（对集合合同生效日登记在册的份额而言，下同）、集合计划份额申购确认日（对申购份额而言）起（即锁定持有期起始日），至集合合同生效日、集合计划份额申购确认日次年的年度对日前一日（即锁定持有期到期日）之间的区间，集合计划份额在锁定持有期内不办理赎回业务。若该年度对日为非<u>工作日</u>或不存在对应日期的，则顺延至下一个<u>工作日</u> 39、<u>开放日</u>：指为投资人办理<u>份额</u>申购、赎回或其他业务的工作日 40、<u>开放时间</u>：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段，集合合同剩余存续期限不足365天时，份额的申购届时根据管理人公告办理 41、<u>《业务规则》</u>：指《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》、中国证券登记结算有限责任公司其他适用于证券投资基金的业务规则及对其不时做出的修订，以及管理人、销售机构<u>业务规则</u>等相关业务规则和实施细则 44、<u>份额转换</u>：指份额持有人按照本集合合同和管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有管理人管理的、某一集合计划的<u>份额</u>转换为管理人管理的其他大集合计划份额的行为 47、<u>巨额赎回</u>：指本集合计划单个开放日，集合计划净赎回申请（赎回申请份额总数加上份额转换中转出申请份额总数后扣除	日）之间的区间，<u>基金份额</u>在锁定持有期内不办理赎回业务。若该年度对日为非<u>开放日</u>或不存在对应日期的，则顺延至下一个<u>开放日</u> 44、<u>开放日</u>：指为投资人办理<u>基金份额</u>申购、赎回或其他业务的工作日（若该交易日非港股通交易日，则本基金可以不开放申购和赎回） 45、<u>开放时间</u>：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段 46、<u>《业务规则》</u>：指中国证券登记结算有限责任公司适用于证券投资基金的业务规则及对其不时做出的修订，以及<u>基金管理人</u>、销售机构等相关业务规则和实施细则 49、<u>基金转换</u>：指<u>基金份额</u>持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有<u>基金管理人</u>管理的、某一<u>基金</u>的<u>基金份额</u>转换为基金管理人管理的其他<u>基金份额</u>的行为 52、<u>巨额赎回</u>：指本基金单个开放日，<u>基金净赎回申请</u>（赎回申请基金份额总数加上<u>基金份额</u>转换中转出申请<u>基金份额</u>总数后扣除申购申请<u>基金份额</u>总数及<u>基金份额</u>转换中转入申请<u>基金份额</u>总数后的余额）超过上一开放日基金总<u>基金份额</u>的10% 57、<u>基金份额净值</u>：指计算日<u>各类基金份额</u>的基金资产净值除以计算日<u>该类基金份额</u>余额总数
---	--

	申购申请份额总数及份额转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日集合计划总份额的10% 52、<u>份额净值</u>：指计算日集合计划资产净值除以计算日份额总数 53、<u>份额累计净值</u>：指集合资产管理计划份额净值加上份额累计分红 55、<u>指定媒介</u>：指本集合计划选择的<u>中国证监会指定用以进行信息披露的全国性报刊、以及指定互联网网站（以下简称指定网站，包括管理人网站、托管人网站和中国证监会基金电子披露网站）等媒介</u> 	58、<u>基金份额累计净值</u>：指计算日各类基金份额的基金份额净值加上<u>该类基金份额累计分红</u> 60、<u>信用衍生品</u>：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 61、<u>信用保护买方</u>：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方 62、<u>信用保护卖方</u>：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方 63、<u>名义本金</u>：亦称交易名义本金，是一笔信用衍生品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准 64、<u>基金份额类别</u>：本基金将基金份额分为A类和C类不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费，不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；投资人申购基金时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，为C类基金份额（新增，以下序号依次调整） 65、<u>规定媒介</u>：指中国证监会规定的用以进行信息披露的全国性报刊及规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介 以上释义中涉及法律法规的内容，法律法规修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规为准。（新增）
第三部分 基金的基本情况	 二、<u>集合计划的类别</u> 债券型集合资产管理计划 本集合计划为大集合产品，系管理人依据《操作指引》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划。（删除） 四、<u>集合计划的投资目标</u> 本集合计划通过管理人积极主动的投资管理，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的长期稳定的投资收益。	 二、<u>基金的类别</u> 债券型证券投资基金 四、<u>基金的投资目标</u>

	<u>五、集合计划份额面值</u> 本集合计划份额面值为人民币1.00元。（删除，以下序号依次调整） <u>六、集合计划存续期限</u> 本集合计划自本集合合同生效日起存续期至2025年11月30日。 本集合计划自2025年11月30日后，按照中国证监会有关规定执行。	<u>在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。</u> <u>五、基金存续期限</u> <u>不定期</u>
第四部分 基金的历史沿革	 根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称变更为“广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效。	<u>广发乾利一年持有期债券型证券投资基金由广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更而来。广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划由广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划变更而来。（新增）</u> 根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合资产管理计划名称变更为“广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效。 <u>经中国证监会变更注册，广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更为“广发乾利一年持有期债券型证券投资基金”。X年X月X日至X年X月X日，广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划召开持有人大会，会议审议通过了《关于广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划变更管理人等事项的议案》，同意“广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划”变更为“广发乾利一年持有期债券型证券投资基金”，基金管理人变更为“广发基金管理有限公司”，并变更投资范围及比例、投资限制、估值及其他事宜。份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，并自通过之日起5日内报中国证监会备案。</u> <u>自X年X月X日起，广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计</u>

		划变更为“广发乾利一年持有期债券型证券投资基金”，《广发乾利一年持有期债券型证券投资基金基金合同》生效，原《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》失效。 (新增)
第五部分 基金的存续	《集合合同》生效后，连续20个工作日出现份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，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，管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合合同等，并6个月内召开份额持有人大会进行表决。本集合计划自本集合合同生效日起存续期至2025年11月30日。本集合计划自2025年11月30日后，按照中国证监会有关规定执行。如2025年11月30日后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开份额持有人大会。(删除)	《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5000万元人民币情形的，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10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。
第六部分 基金份额的申购与赎回	一、集合计划的运作方式 锁定持有期指集合合同生效日（对集合合同生效日登记在册的份额而言，下同）、集合计划份额申购确认日（对申购份额而言）起（即锁定持有期起始日），至集合合同生效日、集合计划份额申购确认日次年的年度对日前一日（即锁定持有期到期日）止，若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。集合计划份额在锁定持有期内不办理赎回业务。 每份集合计划份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期，期间可以办理赎回业务，每份集合计划份额的开放持有期首日为锁定持有期到期日的下一个工作日。 二、申购和赎回场所 本集合计划的销售机构包括管理人和管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由管理人在招募说明书中列明，并在管理人网站公示。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理	一、基金的运作方式 对于每份基金份额，锁定持有期指基金份额申购确认日（包括持有广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划至本基金合同生效日的基金份额以及基金合同生效后申购的基金份额）起（即锁定持有期起始日），至原集合计划份额或基金份额申购确认日次年的年度对日前一日（即锁定持有期到期日）之间的区间。若该年度对日为非开放日或不存在对应日期的，则顺延至下一个开放日。基金份额在锁定持有期内不办理赎回业务。 每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期，期间可以办理赎回业务，每份基金份额的开放持有期首日为锁定持有期到期日的下一个开放日。 二、申购和赎回场所 本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站予以公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与

人网站予以公示。<u>集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理份额的申购与赎回。</u> 三、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<u>份额</u>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<u>管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本集合合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</u> 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 <u>管理人自集合合同生效之日起不超过10个工作日开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。此后的每个工作日为本集合计划的申购业务开放日。集合合同剩余存续期限不足365天时，份额的申购届时根据管理人公告办理。</u> <u>本集合计划申购份额的锁定持有期到期后，管理人开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。对于每份集合计划份额，自其开放持有期首日起才能办理赎回。</u> 四、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日<u>收市后计算的份额净值</u>为基准进行计算； 3、当日的申购与赎回申请可以在<u>管理人规定的时间</u>以内撤销； 4、赎回遵循“先进先出”原则，即<u>按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</u> 	赎回。 三、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<u>基金份额</u>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>（若该交易日非港股通交易日，则本基金可以不开放申购和赎回）</u>，但<u>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。</u> 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 <u>基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。基金管理人自合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回业务，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</u> 对于每份基金份额，自其开放持有期首日起才能办理赎回。如果投资人多次申购基金份额，则其持有的基金份额的<u>赎回开放时间可能不同。</u> 四、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的<u>基金份额净值</u>为基准进行计算； 3、当日的申购与赎回申请可以在<u>基金管理人规定的时间</u>以内撤销，<u>但申请一旦被确认则不得撤销；</u> 4、赎回遵循“先进先出”原则，即<u>登记确认日期在前的基金份额先赎回，登记确认日期在后的基金份额后赎回；</u>
---	--

6、本<u>集合计划份额</u>分为多个类别，适用不同的申购费或销售服务费，投资者在申购时可自行选择<u>集合计划份额</u>类别。 五、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 <u>份额</u>持有人递交赎回申请，赎回成立；<u>份额</u>登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，<u>管理人</u>将在T+5日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本<u>集合合同</u>有关条款处理。 8、<u>法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</u> 发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且<u>管理人</u>决定暂停接受投资人申购申请时，<u>管理人</u>应当根据有关规定在<u>指定媒介</u>上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除	 6、本基金分为多个类别，适用不同的申购费或销售服务费，投资者在申购时可自行选择<u>基金份额</u>类别。 五、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 <u>基金份额</u>持有人递交赎回申请，赎回申请成立；<u>基金份额</u>登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，<u>基金管理人</u>将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本<u>基金合同</u>有关条款处理。 七、申购和赎回的价格、费用及其用途 8、<u>对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，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。针对基金投资者定期和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、基金赎回费率、转换费率和销售服务费率。(新增)</u> 八、拒绝或暂停申购的情形 8、<u>因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或停止接受买入申报，或者发生证券交易服务公司等机构认定的交易异常情况并决定暂停提供部分或者全部港股通服务，或者发生其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。</u> 9、<u>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销售系统、注册登记系统或会计系统无法正常运行。(新增，以下序号依次调整)</u> 10、<u>法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</u> 发生上述第1、2、3、5、6、8、9、10项暂停申购情形之一且<u>基金管理人</u>决定暂停接受投资人申购申请时，<u>基金管理人</u>应当根据有
--	--

时，<u>管理人</u>应及时恢复申购业务的办理。 十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：当<u>管理人</u>认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对<u>集合计划</u>资产净值造成较大波动时，<u>管理人</u>在当日接受赎回比例不低于上一<u>工作日</u><u>集合计划</u>总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。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<u>份额</u>；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<u>工作日</u>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<u>工作日</u>赎回申请一并处理，无优先权并以下一<u>工作日</u>的该类<u>份额</u>的<u>份额</u>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。 若本<u>集合计划</u>发生巨额赎回且单个<u>份额</u>持有人的赎回申请超过上一<u>工作日</u><u>集合计划</u>总份额10%的，<u>管理人</u>有权对该单个<u>份额</u>持有人超过该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个<u>份额</u>持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。 （3）暂停赎回：连续2日以上(含本数)发生巨额赎回，如<u>管理人</u>认为有必要，可暂停接受<u>集合计划</u>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<u>指定媒介</u>上进行公告。 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1、发生上述暂停申购或赎回情况的，<u>管理人</u>应在规定期限内	关规定在<u>规定媒介</u>上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，<u>基金管理人</u>应及时恢复申购业务的办理。 十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：当<u>基金管理人</u>认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对<u>基金</u>资产净值造成较大波动时，<u>基金管理人</u>在当日接受赎回比例不低于上一<u>开放日</u><u>基金</u>总<u>基金份额</u>的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。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<u>基金份额</u>；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<u>开放日</u>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<u>开放日</u>赎回申请一并处理，无优先权并以下一<u>开放日</u>的该类<u>基金份额</u>的<u>基金份额</u>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。 若本<u>基金</u>发生巨额赎回且单个<u>基金份额</u>持有人的赎回申请超过上一<u>开放日</u><u>基金</u>总<u>基金份额</u>20%的，<u>基金管理人</u>有权对该单个<u>基金份额</u>持有人超过该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个<u>基金份额</u>持有人剩余赎回申请与其他账户赎回申请按前述条款处理。 （3）暂停赎回：连续2个<u>开放日</u>以上(含本数)发生巨额赎回，如<u>基金管理人</u>认为有必要，可暂停接受<u>基金</u>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<u>规定媒介</u>上进行公告。 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告
---	--

	指定媒介上刊登暂停公告。若暂停时间超过1日，管理人可以根据《信息披露办法》自行确定增加公告次数。 	1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内规定媒介上刊登暂停公告。 十七、基金份额的转让 在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。（新增，以下序号依次调整）
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、管理人 （一）管理人简况 名称：广发证券资产管理（广东）有限公司 住所：珠海横琴新区荣珠道191号写字楼2005房 法定代表人：秦力 设立日期：2014年1月2日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会《关于核准广发证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监机构字【2013】1610号） 组织形式：有限公司 注册资本：10亿人民币 存续期限：持续经营 联系电话：（020）66338888 （二）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，管理人的义务包括但不限于： （12）保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 名称：广发基金管理有限公司 住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室 法定代表人：葛长伟 设立日期：2003年8月5日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]91号 组织形式：有限责任公司 注册资本：14,097.8万元人民币 存续期限：持续经营 （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：

资意向等。除《基金法》、<u>《集合合同》</u>及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露； <u>（24）未能达到集合计划的备案条件，《集合合同》不能生效的，管理人按规定提前终止本集合计划或者转为符合法律法规规定的私募资产管理计划；（删除，以下序号依次调整）</u> 二、<u>托管人</u> （一）<u>托管人简况</u> 法定代表人：<u>刘连舸</u> 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，<u>托管人</u>的义务包括但不限于： （21）执行生效的<u>份额持有人大会的决定</u>； 三、<u>份额持有人</u> <u>每份份额具有同等的合法权益。</u> 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，<u>份额持有人</u>的义务包括但不限于： （7）执行生效的<u>份额持有人大会的决定</u>；	 （12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、<u>《基金合同》</u>及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，<u>但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外</u>； 二、<u>基金托管人</u> （一）<u>基金托管人简况</u> 法定代表人：<u>葛海蛟</u> 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，<u>基金托管人</u>的义务包括但不限于： （21）执行生效的<u>基金份额持有人大会的决议</u>； 三、<u>基金份额持有人</u> <u>同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。本基金各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。</u> 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，<u>基金份额持有人</u>的义务包括但不限于：
---	---

		(7) 执行生效的<u>基金份额持有人大会的决议</u>；
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	 二、<u>管理人和托管人</u>的更换程序 (一) <u>管理人</u>的更换程序 7、审计：<u>管理人</u>职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对<u>集合计划</u>财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从<u>集合计划</u>财产中列支； (二) <u>托管人</u>的更换程序 7、审计：<u>托管人</u>职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对<u>集合计划</u>财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。 	 二、<u>基金管理人和基金托管人</u>的更换程序 (一) <u>基金管理人</u>的更换程序 7、审计：<u>基金管理人</u>职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对<u>基金财产</u>进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从<u>基金财产</u>中列支； (二) <u>基金托管人</u>的更换程序 7、审计：<u>基金托管人</u>职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对<u>基金财产</u>进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。
第十二部分 基金的投资	一、投资目标 <u>本集合计划通过管理人积极主动的投资管理，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的长期稳定的投资收益。</u> 二、投资范围 本<u>集合计划</u>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股票（含主板、<u>中小板</u>、创业板及其他经<u>中国证监会核准</u>上市的股票）、债券、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、<u>股指期货</u>、<u>国债期货</u>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<u>集合计划</u>主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券、混合资本债）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证	一、投资目标 <u>在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。</u> 二、投资范围 本<u>基金</u>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股票（含主板、<u>科创板</u>、创业板及其他依法发行上市的股票、<u>存托凭证</u>）、<u>港股通标的股票</u>、债券、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、<u>国债期货</u>、<u>信用衍生品</u>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<u>基金</u>主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行的国债、地方政府债、<u>政府支持债券</u>、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券、混合资本债）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、

	券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。<u>其中企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、中期票据、超短期融资券等信用债的主体、债项或担保方信用等级评级不低于AA，短期融资券债项评级不低于A-1。</u> 集合计划的投资组合比例为： 本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%；投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的20%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 	证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。 基金的投资组合比例为： 本基金为债券型基金，投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、可转换债券与可交换债券的比例合计不超过基金资产的20%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的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，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%，前述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 3、信用债投资策略 （2）基于信用债信用分析策略 本基金投资于信用债（包括资产支持证券，下同）的信用评级为AA+及以上，投资于信用评级为AA+的信用债占信用债资产的比例不高于50%，投资于信用评级为AAA的信用债占信用债资产的比例不低于50%。<u>上述信用评级为主体评级，如无主体评级，参考债项评级，评级机构及评级标准以本基金管理人认定为准。本基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，原则上在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。（新增）</u>
--	--	---

6、<u>股指期货、国债期货投资策略</u> 本集合计划对<u>股指期货、国债期货</u>的投资以套期保值，回避市场风险为主要目的。结合现货交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。 8、<u>股票投资策略</u> 本集合计划的投资目标是追求相对稳定的绝对回报，将参照多因素风险预算模型技术，根据市场环境的变化，动态调整股票仓位和投资品种，锁定收益、减少损失。股票投资主要采取指数化增强的方式，分享中国经济增长的投资机会；同时从中国资本市场行为特征出发，灵活运用多种低风险投资策略（如增发套利、转债转股价套利、转债转股套利、股权激励套利投资、事件驱动套利投资等），把握市场定价偏差带来的投资机会。	6、<u>国债期货投资策略</u> 本基金对国债期货的投资以套期保值，回避市场风险为主要目的。结合现货交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。 8、<u>股票投资策略</u> 本基金将主要遵循“自下而上”的分析框架，采用定性分析和定量分析相结合的方法，精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票构建股票组合。 <u>（1）定量分析</u> 通过财务和运营数据进行企业价值评估，初步筛选出具备优势的股票备选库。本基金主要从盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。 <u>1）盈利能力</u> 本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力，主要参考的指标包括净资产收益率（ROE），毛利率，净利率，EBITDA/主营业务收入等。 <u>2）成长能力</u> 投资方法上重视投资价值与成长潜力的平衡，一方面利用价值投资标准筛选低价股票，避免市场波动时的风险和股票价格高企的风险；另一方面，利用成长性投资可分享高成长收益的机会。本基金通过成长能力分析评估上市公司未来的盈利增长速度，主要参考的指标包括EPS 增长率和主营业务收入增长率等。 <u>3）估值水平</u> 本基金通过估值水平分析评估当前市场估值的合理性，主要参考的指标包括市盈率（P/E）、市净率（P/B）、市盈增长比率（PEG）、自由现金流贴现（FCFF，FCFE）和企业价值/EBITDA等。 <u>（2）定性分析</u> 从持续成长性、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司进
---	--

	四、投资限制 1、组合限制 集合计划的投资组合应遵循以下限制： （1）本集合计划债券的投资比例不低于计划资产的80%，投资	行进一步的精选。 1) 持续成长性方面，通过对上市公司生产、技术、市场、经营状况等方面的深入研究，评估具有持续成长能力的上市公司。 2) 在市场前景方面，需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用创新能力取得竞争优势、开拓市场、进而创造利润增长的能力。 3) 公司治理结构优劣对包括公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。本基金将从上市公司的管理层、战略定位和管理制度体系等方面对公司治理结构进行评价。 （3）港股通标的股票投资策略 考虑到香港股票市场与 A 股股票市场的差异，对于港股通标的股票，本基金除按照上述个股精选策略，还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为，以及世界主要经济体经济发展和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素，精选符合本基金投资目标的港股通标的股票。 （4）存托凭证投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。 9、信用衍生品投资策略 本基金若投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的，并遵守证券交易所或银行间市场的相关规定。管理人将结合根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，合理评估信用衍生品的价格和流动性，确定投资金额、期限、风险敞口等。管理人将加强交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。（新增） 四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制：
--	---	--

于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的20%； （2）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值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）本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的10%； （4）本管理人管理的全部基金及大集合产品持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%； （11）本集合计划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集合计划资产净值的40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期； （15）本集合计划参与股指期货交易，须遵守以下限制：<u>在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的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）、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，持有的卖出期货合约价值不得超</u>	（1）本基金债券的投资比例不低于基金资产的80%，投资于股票、可转换债券与可交换债券的比例合计不超过基金资产的20%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%）； （2）每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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（<u>同一家公司在境内和香港同时上市的A+H 股合并计算</u>），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（<u>同一家公司在境内和香港同时上市的A+H 股合并计算</u>），不超过该证券的10%； （11）<u>本基金参与信用衍生品投资，需遵守下列限制：本基金不得持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品；本基金不得持有合约类信用衍生品；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%；本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的10%；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，基金管理人应在3个月内进行调整；</u> （15）本基金参与国债期货交易，需遵守以下限制： （17）<u>本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；（新增，以下序号依次调整）</u> 除上述（2）、（9）、（11）、（13）、（14）情形之外，因证券市场波动、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
--	---

过集合计划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交易日集合计划资产净值的20%；本集合计划所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）应当符合本合同关于股票投资比例的有关约定；（删除，以下序号依次调整） （16）本集合计划参与国债期货交易，须遵守以下限制： 除上述（2）、（9）、（13）、（14）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，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。 五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：<u>中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%</u>。 本集合计划是债券型集合资产管理计划（大集合产品），主要投资于债券，争取集合计划资产的稳定增值，以<u>中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%</u>作为业绩比较基准，符合本集合计划的风险收益特征。 中债综合全价（总值）指数由<u>中央国债登记结算有限责任公司</u>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，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。 若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，管理人有权根据市场发展状况及本集合计划的投资范围和投资策略，调整本集合计划的业绩比较基准。业绩基准的变更须经管理人和托管人协商一致，及时公告，并	基金投资比例不符合上述规定投资比例的，<u>基金管理人</u>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。 五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：<u>中债-综合全价（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%</u>。 本<u>基金</u>是债券型基金，主要投资于债券，争取<u>基金</u>资产的稳定增值，以<u>中债-综合全价（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%</u>作为业绩比较基准，符合本<u>基金</u>的风险收益特征。 中债-综合全价（总值）指数由<u>中债金融估值中心有限公司</u>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，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。 若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，<u>基金管理人</u>有权根据市场发展状况及本<u>基金</u>的投资范围和投资策略，调整本<u>基金</u>的业绩比较基准。业绩基准的
---	--

	在更新的招募说明书和产品资料概要中列示，<u>按规定报中国证监会备案，无需召开集合计划份额持有人大会。</u> 六、风险收益特征 <u>本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），属于证券投资基金中的较低预期风险和较低预期收益品种，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。</u> 	变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，及时公告，并在更新的招募说明书和产品资料概要中列示，无需召开<u>基金份额持有人大会</u>。 六、风险收益特征 <u>本基金是债券型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。</u> <u>本基金资产若投资于港股，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。（新增）</u>
第十四部分 基金资产估值	 二、估值对象 <u>集合计划所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</u> 四、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不含权固定收益品种，选取	 二、估值对象 <u>基金所拥有的股票、国债期货合约、信用衍生品、资产支持证券、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</u> 四、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；

估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值； <u>(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；</u> <u>(4) 交易所上市交易的可转换债券，以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，按最近交易日可转换债券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。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；</u> <u>(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券以及交易所上市的资产支持证券品种，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。若第三方估值机构无估值数据，且估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；</u> <u>(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。(删除)</u> 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： <u>(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。</u> 	<u>(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价；交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价；</u> <u>(3) 交易所上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价；</u> <u>(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。</u> 2、处于未上市期间或流通受限的有价证券应区分如下情况处理： <u>(2) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；</u> <u>(4) 交易所未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息</u>
---	---

	3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。 4、股指期货合约，一般以估值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。 5、国债期货合约，一般以估值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。 6、存款的估值方法 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。 7、同业存单的估值方法 投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。 (删除，以下序号依次调整) 9、当发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。(删除，以下序号依次调整)	支持的估值技术确定其公允价值。(新增) 3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价；对全国银行间市场上含权的固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对全国银行间市场未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。 4、对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。 5、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其他可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。基金管理人在与托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。 6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。 7、期货合约以估值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。 8、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，但管理人依法承担的责任，不因委托而免除；选定的第三方估值机构未提供估值价格时，按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。 9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。 10、估值中的汇率选取原则：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。
--	---	---

	 根据有关法律法规，<u>集合计划</u>资产净值计算和<u>集合计划</u>会计核算的义务由<u>管理人</u>承担。本<u>集合计划</u>的<u>集合计划</u>会计责任方由<u>管理人</u>担任，因此，就与本<u>集合计划</u>有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照<u>管理人</u>对<u>集合计划</u>资产净值的计算结果对外予以公布。 五、估值程序 1、由于<u>集合计划</u>不同<u>份额</u>费用的不同，本<u>集合计划</u>不同类别<u>份额</u>将分别计算<u>份额</u>净值。计算公式为： <u>份额</u>净值是按照每个<u>工作日</u>闭市后，<u>集合计划</u>资产净值除以当日该类<u>份额</u>的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。<u>管理人</u>可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。 <u>管理人</u>于每个<u>工作日</u>计算<u>集合计划</u>资产净值及各类<u>份额</u>的<u>份额</u>净值，并按规定公告。 2、<u>管理人</u>应每个<u>工作日</u>对<u>集合计划</u>资产估值。但<u>管理人</u>根据法律法规或本<u>集合合同</u>的规定暂停估值时除外。<u>管理人</u>每个<u>工作日</u>对<u>集合计划</u>资产估值后，将各类<u>集合计划</u>份额的<u>份额</u>净值结果发送<u>托管人</u>，经<u>托管人</u>复核无误后，由<u>管理人</u>对外公布。 	11、当本基金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。（新增，以下序号依次调整） 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人<u>对基金</u>净值信息的计算结果对外予以公布。 五、估值程序 1、由于基金不同<u>基金份额</u>费用的不同，本基金不同类别<u>基金份额</u>将分别计算<u>基金份额</u>净值。计算公式为： <u>基金份额</u>净值是按照每个<u>估值日</u>闭市后，基金资产净值除以当日该类<u>基金份额</u>的余额总数计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。 基金管理人于每个<u>估值日</u>计算基金资产净值及各类<u>基金份额</u>的<u>基金份额</u>净值，并按规定公告。 2、基金管理人应每个<u>估值日</u>对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个<u>估值日</u>对基金资产估值后，将各类<u>基金份额</u>的<u>基金份额</u>净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。 九、特殊情形的处理 1、基金管理人按估值方法的第12项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；（新增，以下序号依次调整）
第十五部分 基金费用与税收	一、集合计划费用的种类 3、销售服务费；	一、基金费用的种类 3、从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；

..... 二、<u>集合计划</u>费用计提方法、计提标准和支付方式 1、<u>管理人</u>的管理费 本集合计划的管理费按前一日<u>集合计划</u>资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H=E\times 0.6\%\div 365$ 2、<u>托管人</u>的托管费 $H=E\times 0.15\%\div 365$ 3、<u>销售服务费</u> <u>销售服务费</u>可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类不收取销售服务费，C类销售服务费年费率为0.3%。各类集合计划份额的销售服务费计提的计算公式如下： $H=E\times \text{年销售服务费率}\div 365$ H为每日该类集合计划份额应计提的销售服务费 E为前一日该类集合计划份额的集合计划资产净值 上述“一、<u>集合计划</u>费用的种类”中第4—9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由<u>托管人</u>从集合计划财产中支付。 五、<u>集合计划</u>税收	 9、<u>因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用</u>；（<u>新增</u>，以下序号依次调整） 10、按照国家有关规定和《<u>基金合同</u>》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 <u>本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。（新增）</u> 二、<u>基金</u>费用计提方法、计提标准和支付方式 1、<u>基金管理人</u>的管理费 本基金的管理费按前一日<u>基金</u>资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$ 2、<u>基金托管人</u>的托管费 $H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$ 3、<u>销售服务费</u> <u>本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.30%。计算方法如下：</u> $H=E\times 0.30\%\div \text{当年天数}$ H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为C类基金份额前一日基金资产净值 <u>销售服务费</u>主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。（<u>新增</u>） 上述“一、<u>基金</u>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<u>基金托管人</u>从基金财产中支付。
--	---

	 本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。集合计划财产投资的相关税收，由份额持有人承担，管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。（删除）	
第十六部分 基金的收益与分配	 三、集合计划收益分配原则 1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，由公司根据产品特点自行约定收益分配次数、比例等，若《集合合同》生效不满3个月可不进行收益分配 五、收益分配方案的确定、公告与实施 集合计划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。（删除） 	 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，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； 5、因红利再投资所得的基金份额的持有期起始日，按原份额的持有期起始日开始计算，与原份额适用相同的锁定持有期；（新增，以下序号依次调整） 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，履行适当程序后，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。（新增）
第十七部分 基金的会计与审计	 二、集合计划的年度审计 1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的具有证券、期货相关业务从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。 	 二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
第十八部分		

基金的信息披露

二、信息披露义务人
本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称：指定报刊）和指定互联网网站（以下简称：指定网站）等媒介披露，并保证集合计划投资者能够按照《集合合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

.....

五、公开披露的集合计划信息

.....

（二）《集合合同》生效公告
管理人应当在向中国证监会办理集合计划备案手续完毕，获得中国证监会书面确认，并经征求投资者意见后在指定媒介上刊载《集合合同》生效公告。（删除，以下序号依次调整）

（三）集合计划净值信息
《集合合同》生效后，在开始办理份额申购或者赎回前，管理人应当至少每周在指定网站披露一次集合计划份额净值和份额累计净值。
在开始办理份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、销售机构网点或者营业网点披露开放日的份额净值和份额累计净值。

.....

（七）临时报告

.....

3、集合计划扩募、延长《集合合同》期限；（删除，以下序号依次调整）

.....

9、集合计划募集期延长或者提前结束募集；（删除，以下序号依次调整）

.....

二、信息披露义务人
本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会规定的全国性报刊（以下简称：规定报刊）和规定互联网网站（以下简称：规定网站）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

.....

五、公开披露的基金信息

.....

（二）基金净值信息
《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在规定网站披露一次各类基金份额净值和各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，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、销售机构网点或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

.....

（九）投资资产支持证券的信息披露
基金管理人应在基金年报及中期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内所有

	(十) <u>投资股指期货相关公告</u> <u>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）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</u> 	<u>的资产支持证券明细。</u> <u>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。（新增，以下序号依次调整）</u> (十) <u>投资信用衍生品的相关公告</u> <u>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）等文件中详细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及策略。</u> (十二) <u>投资港股通标的股票的相关公告</u> <u>基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和更新的招募说明书等文件中披露本基金投资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港股通投资香港股票市场的信息披露另有规定时，从其规定。（新增，以下序号依次调整）</u>
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	一、<u>《集合合同》的变更</u> 1、<u>变更集合合同涉及法律法规规定或本合同约定应经份额持有人大会决议通过的事项的，应召开份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和集合合同约定可不经份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</u> 二、<u>《集合合同》的终止事由</u> 1、<u>《集合合同》期限届满的；（删除，以下序号依次调整）</u> 三、<u>集合计划财产的清算</u> 	一、<u>《基金合同》的变更</u> 1、<u>变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。</u> 三、<u>基金财产的清算</u>

	2、<u>集合计划财产清算</u>小组组成：<u>集合计划财产清算</u>小组成员由<u>管理人、托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</u> 4、<u>集合计划财产清算</u>程序： （6）<u>将清算报告在指定网站上进行披露，在指定报刊上登载清算报告提示性公告，并按规定报中国证监会备案；</u> 六、<u>集合计划财产清算的公告</u> 清算过程中的有关重大事项须及时公告；<u>集合计划财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后按规定报中国证监会备案并按照规定进行披露。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告按规定报中国证监会备案后按规定进行披露。</u> 七、<u>集合计划财产清算账册及文件的保存</u> <u>集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存15年以上。</u>	2、<u>基金财产清算</u>小组组成：<u>基金财产清算</u>小组成员由<u>基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</u> 4、<u>基金财产清算</u>程序： （6）<u>将清算报告报中国证监会备案并公告；</u> 六、<u>基金财产清算的公告</u> 清算过程中的有关重大事项须及时公告；<u>基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后按规定报中国证监会备案并按照规定进行披露。基金财产清算公告于基金财产清算报告按规定报中国证监会备案后按规定进行披露。</u> 七、<u>基金财产清算账册及文件的保存</u> <u>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存20年以上。</u>
第二十部分 违约责任	一、<u>管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《集合合同》约定，给集合计划财产或者份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况，当事人可以免责：</u> 	一、<u>基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况之一的，当事人可以免责：</u>
第二十一部分 争议的处理和适用的法律	各方当事人同意，因《集合合同》而产生的或与《集合合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，<u>可向有管辖权的人民法院起诉。</u>	各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，<u>应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。</u> <u>争议处理期间，基金管理人和基金托管人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》规定</u>

	<u>《集合合同》受中国法律管辖。</u>	<u>的义务，维护基金份额持有人的合法权益。</u> <u>《基金合同》受中国法律（仅为《基金合同》之目的，不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律）管辖。</u>
第二十二部分 基金合同的效力	 1、<u>《集合合同》经管理人、托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，经管理人向中国证监会办理集合计划备案手续，获得中国证监会书面确认，并经征求投资者意见后生效。</u> 2、<u>《集合合同》的有效期自集合合同生效之日起至2025年11月30日。本集合计划自2025年11月30日后，按照中国证监会有关规定执行。</u> 4、<u>《集合合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，管理人、托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</u> 	 1、<u>《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。本基金合同由《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》修订而成。自X年X月X日起，本基金合同生效，原广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》失效。</u> 2、<u>《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案后并公告之日止。</u> 4、<u>《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式一份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</u>
第二十四部分 基金合同内容摘要		<u>依照正文更新</u>