

# 关于以通讯方式召开融通七天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次

## 提示性公告

融通基金管理有限公司（以下简称“公司”或“基金管理人”）已于2015年11月13日在融通基金管理有限公司网站（www.rtfund.com）及《证券时报》发布了《关于以通讯方式召开融通七天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。并于2015年11月16日在上述网站和报纸上发布了《关于以通讯方式召开融通七天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布融通基金管理有限公司关于以通讯方式召开融通七天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

### 一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《融通七天理财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，融通七天理财债券型证券投资基金（以下简称“融通七天理财基金”或“本基金”）的基金管理人融通基金管理有限公司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2015年11月19日起至2015年12月13日17:00止（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）

通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人。

### 3、会议通讯表决票的寄达地点：

收件人：融通基金管理有限公司

地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13层

联系电话：0755-26948088

传真：0755-26935005

邮政编码：518053

请在信封表面注明：“融通七天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-883-8088咨询。

### 二、会议审议事项

《关于融通七天理财债券型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明及基金合同的详细修订内容详见《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》（见附件四）。

### 三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2015年11月18日，即2015年11月18日交易时间结束后，在本基金注册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。

### 四、表决票的填写和寄交方式

- 1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站（www.rtfund.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，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）；
- （3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件，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；

(4) 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（详见附件三）。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) 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（详见附件三）。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）；

(6) 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和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）。

(7) 以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书，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授权书等相关文件自2015年11月19日起，至2015年12月13日17:00以前（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：融通基金管理有限公司

地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13层

联系电话：0755-26948088

传真：0755-26935005

邮政编码：518053

请在信封表面注明：“融通七天理财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400-883-8088咨询。

## 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（中国工商银行股份有限公司）授权代表的监督下于2015年12月14日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人经通知但拒绝到场监督，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的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，所提供文件符合本会议通知规定，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出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(2) 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；无效表决票不计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(3) 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作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数；

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，邮寄的以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准。

#### 六、决议生效条件

- 1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的本基金基金份额持有人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）；
- 2、《关于融通七天理财债券型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》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；
- 3、本次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。

#### 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》和《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同》的规定，本次持有人大会需要有效表决票所代表的本基金基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上方可举行。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 2013 年 6 月 1 日生效的新修订的《基金法》及《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同》，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：融通基金管理有限公司

联系地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

联系电话：0755-26948088

传真：0755-26935005

客户服务电话：4008838088

网址：www.rtfund.com

邮政编码：518053

2、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

3、公证机构：北京市中信公证处

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。
- 2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过融通基金管理有限公司网站查阅，投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-883-8088 咨询。
- 3、关于本次议案的说明见附件四《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》。
- 4、本通知的有关内容由融通基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于融通七天理财债券型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》

附件二：《融通七天理财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》（样本）

附件四：《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》

融通基金管理有限公司

二〇一五年十一月十七日

附件一：

关于融通七天理财债券型证券投资基金  
修改基金合同有关事项的议案

融通七理财债券型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，考虑到融通七理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的长期发展及持有人的利益，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《融通七理财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，基金管理人融通基金管理有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议变更本基金的名称和基金类别，修改基金的投资目标、投资范围、投资策略、费用、运作方式、收益分配方式等事项。同时鉴于《基金合同》生效于新《基金法》、《运作办法》实施前，《基金合同》的部分条款已经不能适应形势的需要，故本次《基金合同》在变更上述事项的同时，对其他部分条款按照现时有效的相关法律法规及中国证监会的有关规定一并进行修改。具体内容详见附件四《融通七理财债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》。同时根据《运作办法》的规定，提议授权基金管理人在转型实施前预留不少于二十个开放日供持有人选择赎回的前提下，制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排等事项的转型实施安排规则并提前公告。

为实施融通七理财债券型证券投资基金上述基金合同修改方案，提议授权基金管理人办理本次基金合同修改的有关具体事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求和《融通七理财债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书》的有关内容对基金合同进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

融通基金管理有限公司

二〇一五年十一月十三日

附件二：

融通七理财债券型证券投资基金  
基金份额持有人大会表决票



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

兹委托 代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2015 年 12 月 13 日的以通讯方式召开的融通七理财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。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。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

若融通七理财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）：\_\_\_\_\_

委托人身份证件号码或营业执照注册号：\_\_\_\_\_

委托人基金账户：\_\_\_\_\_

受托人（代理人）（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

受托人（代理人）身份证件号码或营业执照注册号：\_\_\_\_\_

委托日期：2015 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“委托人身份证件号码或营业执照注册号”，指基金份额持有人认购、申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。
- 2、本授权委托书为代表此基金份额持有人就其所持有的本基金所有份额的授权。

附件四：

融通七理财债券型证券投资基金基金合同修改方案说明书

一、声明

- 1、融通七理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同于 2013 年 3 月 14 日生效。考虑到本基金的

长期发展及持有人的利益，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《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，本基金管理人（融通基金管理有限公司）经与基金托管人（中国工商银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于融通七天理财债券型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》。

2、鉴于《基金合同》生效于新《基金法》、《运作办法》实施前，《基金合同》的部分条款已经不能适应形势的需要，故本次《基金合同》在修改上述事项的同时，对其他部分条款按照现时有效的相关法律法规及中国证监会的有关规定一并进行修改。

3、本次修改基金合同事宜属原注册事项的实质性变更，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

4、本次基金合同修改方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，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

5、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。

6、中国证监会对本次本基金变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或变更注册后基金的价值或投资人的收益做出实质性判断或保证。

## 二、基金合同修改内容汇总

融通七天理财债券型证券投资基金基金合同的修改请参见《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同修订对照表》。

融通七天理财债券型证券投资基金基金合同修订对照表

章节 《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同》 《融通汇财宝货币市场基金基金合同（草案）》

全文 指定媒体 指定媒介

第一部分前言 一、订立本基金合同的目的、依据和原则 一、订立本基金合同的目的、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》”）、《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律法规。 2、订立本基金合同的依据是《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》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《货币市场基金管理暂行规定》、《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》和其他有关法律法规。

第一部分前言 三、融通七天理财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”）核准。 三、融通汇财宝货币市场基金由融通七天理财债券型证券投资基金转型而来，融通七天理财债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 中国证监会对本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

第一部分前言 五、基金合同生效后，若因法律法规的修改或新法律法规的颁布施行导致基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。 五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

第二部分释义 1、基金或本基金：指融通七天理财债券型证券投资基金 1、基金或本基金：指融通汇财宝货币市场基金，本基金由融通七天理财债券型证券投资基金转型而来

4、基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《融通七天理财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 4、基金合同或本基金合同：指《融通汇财宝货币市场基金基金合同》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《融通七天理财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 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《融通汇财宝货币市场基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《融通七天理财债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新 6、招募说明书：指《融通汇财宝货币市场基金基金招募说明书》及其定期的更新

第二部分释义 7、基金份额发售公告：指《融通七天理财债券型证券投资基金基金份额发售公告》 删去

第二部分释义 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 8、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委 员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订 9、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》、根据 2012 年 6 月 19 日中国证监会《关于修改〈证券投资基金运作管理办法〉第六条及第十二条的决定》修订以及颁布机关对其不时做出的修订 11、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

第二部分释义 新增 17、合格境外机构投资者：指符合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

第二部分释义 18、投资人：指个人投资者、机构投资者和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 18、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和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

20、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 20、基金销售业务：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、转托管及定期定额投资等业务

21、销售机构：指融通基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构 21、销售机构：指融通基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户 25、基金交易账户：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、转托管及定期定额投资等业务导致基金份额变动及结余情况的账户

26、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 26、基金合同生效日：指《融通汇财宝货币市场基金基金合同》生效日，原《融通七天理财债券型证券投资基金基金合同》自同一日终止

第二部分释义 28、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月 删去

第二部分释义 新增 29、基金转型：指对包括融通七天理财债券型证券投资基金调整投资目标、投资范围、投资策略、基金费用、收益分配方式、估值方法、修订基金合同并更名为“融通汇财宝货币市场基金”等一系列事项的统称

第二部分释义 35、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为 删去

第二部分释义 新增 35、《业务规则》：指《融通基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管

理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

第二部分释义 37、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为 37、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

40、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式 40、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

43、基金收益：指基金投资所得债券利息、票据投资收益、银行存款利息收入以及其他收入。因运作基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。基金净收益为基金收益扣除相关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。 43、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

第二部分释义 44、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和 删去

45、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

46、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

47、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

48、运作期起始日：对于每份认购份额的第一个运作期起始日，指基金合同生效日；对于每份申购份额的第一个运作期起始日，指该基金份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日后的下一工作日

49、运作期到期日：对于每份基金份额，首个运作期到期日指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购申请日（对申购份额而言，下同）对应的下一个周对日（如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期到期日为基金合同生效日或基金份额申购申请日对应的次两周对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推

50、周对日：指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购申请日（对申购份额而言，下同）在后续日历周中的对应日期

51、基金份额分类：本基金设 A 类、B 类两类基金份额。本基金根据投资者认购、申购本基金的金额，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成不同的基金份额类别，即 A 类基金份额、B 类基金份额。A 类和 B 类基金份额单独设置基金代码，并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率

52、升级：指当投资人在单个基金账户保留的 A 类基金份额达到 B 类基金份额的最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资人在该基金账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额

53、降级：指当投资人在单个基金账户保留的 B 类基金份额不能满足该类基金份额的最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资人在该基金账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额

第七部分基金合同当事人及权利义务 新增 （16）在不违反法律法规和监管规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，为支付本基金应付的赎回、交易清算等款项；

第七部分基金合同当事人及权利义务 （17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

第七部分基金合同当事人及权利义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

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

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

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

份额的每万份基金已实现收益和7日年化收益率；

第七部分基金合同当事人及权利义务 (24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人; 删去

第七部分基金合同当事人及权利义务 (二) 基金托管人的权利与义务 (二) 基金托管人的权利与义务

(7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利 (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利  
第七部分基金合同当事人及权利义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于: 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格; (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的每万份基金已实现收益和7日年化收益率;

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会; (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定; (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

第七部分基金合同当事人及权利义务 三、基金份额持有人 三、基金份额持有人

每份基金份额具有同等的合法权益。 同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会; (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁; (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。 (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

第七部分基金合同当事人及权利义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于: 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1) 认真阅读并遵守《基金合同》; (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件;

(2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险; (2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;

(4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用; (4) 缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定; (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

第八部分 基金份额持有人大会 新增 本基金份额持有人大会暂未设日常机构,在符合相关法律法规规定及基金合同的约定的前提下,履行相应程序后可增设日常机构。

第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由 一、 召开事由

(3) 更换基金托管人; (3) 更换基金托管人,但因涉及本基金与其他基金合并的除外;

(4) 转换基金运作方式; (4) 转换基金运作方式(法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外);

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准(法律法规要求提高该等报酬标准的除外); (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高销售服务费,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

(8) 变更基金投资目标、范围或策略(法律法规另有规定的除外); (8) 变更基金投资目标、范围或策略(法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外);

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项; (12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

第八部分 基金份额持有人大会 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: 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) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用； (1) 调低基金管理费、基金托管费；  
(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率、销售服务费率或收费方式； (3)  
在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下调低基金的销售服务费率或变更收费方式，增加、减少或调整基金份额类别设置、调整基金份额分类及升降级规则；

第八部分 基金份额持有人大会 (4) 在未来系统条件允许的情况下，安排本基金的上市交易事宜； 删去

第八部分 基金份额持有人大会 (6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化； (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

第八部分 基金份额持有人大会 新增 (6) 在不违反法律法规、基金合同的约定以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人、销售机构、登记机构调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

第八部分 基金份额持有人大会 二、 会议召集人及召集方式 二、会议召集人及召集方式

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。 3、基金份额持有人大会未设立日常机构的，基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。 基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

第八部分 基金份额持有人大会 4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。 4、基金份额持有人大会未设立日常机构的，代表基金份额百分之十以上（含百分之十）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上（含百分之十）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

第八部分 基金份额持有人大会 新增 5、基金份额持有人大会设立日常机构的，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向该日常机构提出书面提议。

该日常机构应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金管理人、基金托管人和提出提议的基金份额持有人代表。该日常机构决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；该日常机构决定不召集，基金管理人、基金托管人或者代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，按照未设立日常机构的相关规定执行。

第八部分 基金份额持有人大会 5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。 6、代表基金份额百分之十以上（含百分之十）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金份额持有人大会的日常机构、基金管理人、基金托管人都不召集的，

单独或合计代表基金份额百分之十以上（含百分之十）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人大会日常机构、基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

第八部分 基金份额持有人大会 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。 3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

第八部分 基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式 四、基金份额持有人出席会议的方式

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金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、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金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、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。

第八部分 基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式

2、通讯开会。 删去

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

第八部分 基金份额持有人大会 新增 3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

4、重新召集基金份额持有人大会的条件

基金份额持有人大会应当有代表 二分之一以上（含二分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。

参加或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大会的持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金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基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加或直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，方可召开。

第八部分 基金份额持有人大会 六、表决 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》以特别决议通过方为有效。

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。

第八部分 基金份额持有人大会 八、生效与公告 八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金份额持有人大会日常机构、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对基金份

额持有人大会日常机构、全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

第八部分 基金份额持有人大会 新增 九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

十、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 （一） 基金管理人职责终止的情形 （一） 基金管理人职责终止的情形

4、法律法规和《基金合同》规定的其他情形。 4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。

（二） 基金托管人职责终止的情形 （二） 基金托管人职责终止的情形

4、法律法规和《基金合同》规定的其他情形。 4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。

第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 （一） 基金管理人的更换程序 （一） 基金管理人的更换程序

4、核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准生效后后方可执行； 4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议自表决通过之日起生效，自通过之日起五日内报中国证监会备案；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会核准后2个工作日内在指定媒体公告。 5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告；

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 （二） 基金托管人的更换程序

4、核准：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会核准生效后后方可执行； 4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议自表决通过之日起生效，自通过之日起五日内报中国证监会备案；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会核准后2个工作日内在指定媒体公告。 5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告；

第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 （三） 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

（三） 基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后2日内在指定媒体上联合公告。 3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介上联合公告。

第十一部分 基金份额的登记 三、 基金登记机构的权利 三、 基金登记机构的权利

5、法律法规规定的其他权利。 5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

第十一部分 基金份额的登记 四、 基金登记机构的义务 四、 基金登记机构的义务

3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录15年以上； 3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年；

4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其它情形除外； 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；

7、法律法规规定的其他义务。 7、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

第十二部分 基金的投资 一、 投资目标 一、 投资目标

在严格控制投资风险和保持资产流动性的前提下，追求稳定的当期收益，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

二、 投资范围 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：现金，通知存款，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，剩余期限（或回售期限）在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、中期票据，期限在一年以内

(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括:现金,通知存款,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,短期融资券,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据,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。

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。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。

### 第十二部分基金的投资 三、投资策略 三、投资策略

本基金主要投资于固定收益类品种。本基金采取自上而下的投资分析方法,在预判宏观经济形势的基础上,跟踪通胀走势和政策取向,对收益率曲线的变动进行分析和预测。在此基础上,综合使用各种投资策略,以确定组合构成。本基金的具体投资策略包括利率预期和资产配置策略、估值策略、久期控制和流动性管理策略、选时与套利策略等部分。

本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。

#### 1、利率预期和资产配置策略 1、利率策略

根据宏观经济指标(存贷款利率水平、CPI指标、GDP增长率、货币供应量、汇率等)判断当前经济周期所处的阶段,关注并预测未来利率变化趋势,以此决定基金投资组合的平均剩余期限;依照投资时钟理论,根据各大类属资产的收益水平、平均剩余期限、流动性特征(如平均日交易量、交易场所、机构投资者持仓情况、回购抵押情况等),决定基金投资组合中各类属资产的配置比例。本基金将首先采用“自上而下”的研究方法,综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况,建立经济前景的情景模拟,进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势,对影响资金面的因素进行详细分析与预判,建立资金面的场景模拟。

2、估值策略 在宏观分析与流动性分析的基础上,结合历史与经验数据,确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素,得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位,然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比,判断收益率曲线参数变动的程度和概率,确定组合的平均剩余期限,并据此动态调整投资组合。

根据以往债券收益率变动与宏观经济变量之间的联系,结合当期经济形势特点,建立不同品种债券的收益率曲线预测模型,并通过这些模型对债券进行估值,测算不同经济情景下各品种债券的价格中枢和变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及对债券估值变动的预测构建投资组合,合理选择不同市场中有投资价值的券种,并根据投资环境的变化相机调整。 2、骑乘策略

3、久期控制和流动性管理策略 当市场利率期限结构向上倾斜并且相对较陡时,投资并持有债券一段时间,随着时间推移,债券剩余年限减少,市场同样年限的债券收益率较低,这时将债券按市场价格出售,投资人除了获得债券利息以外,还可以获得资本利得。在多数情况下,这样的骑乘操作策略可以获得比持有到期更高的收益。

为控制风险、保证流动性,根据持有人的平均持有期限确定组合的平均持有期限,保证组合的平均剩余期限控制在127天以内。关注宏观经济指标和政策取向,预判资金面状况,提前安排资金以应对流动性紧张的市场环境。具体操作上,通过主动控制同业存款的比例、保留充足的可变现资产和平均安排回购到期期限,确保组合具有充足的流动性资产;预判市场流动性状况,提前对债券投资的比例和久期进行调整,在确保组合收益的前提下增强变现能力。 3、放大策略

4、选时与套利策略 放大策略即以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入资金,并购买剩余年限相对较长的债券,以期获取超额收益的操作方式。在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下,本基金将适时降低杠杆投资比例。

市场和品种的多样性以及风险收益差异提供了丰富的无风险套利机会,如: 4、信用债投资策略

(1)分析市场变动趋势,把握回购利率波动规律,对回购资产进行时间方向上的动态配置策略。根据回购利差进行回购品种的配置比例调整。(1)信用风险控制。本基金拟投资的每支信用债券必需经过融通基金债券信用评级系统进行内部评级,符合基金所对应的内部评级规定的方可进行投资,以事前防范和控制信用风险。

(2)把握大盘新股发行、季节因素、日历效应等,捕捉回购利率的高点。对银行间市场和交易所市场出现的跨市场

套利机会，进行跨市场套利。(2)信用利差策略。信用产品相对国债、政策性金融债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源。首先，伴随经济周期的波动，在经济周期上行或下行阶段，信用利差通常会缩小或扩大，利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。同时，研究不同行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定不同行业总体信用风险和利差水平的变动情况，投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业。其次，信用产品发行人资信水平和评级调整的变化会使产品的信用利差扩大或缩小，本基金将充分发挥内部评级在定价方面的作用，选择评级有上调可能的信用债，以获取因利差下降带来的价差收益。第三，对信用利差期限结构进行研究，分析各期限信用债利差水平相对历史平均水平所处的位置，以及不同期限之间利差的相对水平，发现更具投资价值的期限进行投资；第四，研究分析相同期限但不同信用评级债券的相对利差水平，发现偏离均值较多、相对利差有收窄可能的债券。

(3)对于跨期限套利，进行严格的实证检验，在控制风险的基础上进行操作。在短期债券的单个债券选择上利用收益率利差策略、收益率曲线策略选择收益率高或价值被低估的短期债券，进行投资决策。(3)类属选择策略。国内信用产品目前正经历着快速发展阶段，不同审批机构批准发行的信用产品在定价、产品价格特性、信用风险方面具有一定差别，本基金将考虑产品定价的合理性、产品主要投资人的需求特征、不同类属产品的持有收益和价差收益特点和实际信用风险状况，进行信用债券的类属选择。

#### 5、其他衍生工具投资策略 5、资产支持证券投资策略

本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向，一旦有新的产品推出市场，在履行适当程序后，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规通过利用其他衍生金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，并通过灵活运用趋势投资策略获取收益。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、其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向，一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资，本基金将在届时相应法律法规的框架内，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

#### 第十二部分基金的投资 四、投资操作程序 删去

投资决策委员会是公司投资方面最高层决策机构，定期就投资管理重大问题进行讨论，确定基金投资策略。

- 1、宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等分析市场利率的走向；
- 2、固定收益研究团队分析债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线变化情况；
- 3、固定收益研究团队负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整；
- 4、固定收益研究团队根据宏观经济形势和债券市场投资策略的研究结果，结合基金特点向基金经理提供债券投资策略和资产配置方案建议；
- 5、基金经理参考固定收益研究团队投资建议，拟定下一阶段基金投资债券配置方案，报投资决策委员会讨论；
- 6、投资决策委员会根据上报的投资策略建议和资产配置方案，进行久期决策并形成决议；
- 7、根据投资决策委员会批准的资产配置决议，基金经理综合流动性、收益和久期策略构建资产组合和进行个券选择，并负责债券组合日常管理和动态优化；
- 8、债券交易员接受指令进行询价和反馈后达成交易，并且跟踪券款交割情况；
- 9、风险管理部负责完成基金内部业绩和风险评估，提交评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况，对上述管理程序作出调整。

#### 第十二部分基金的投资 五、投资限制 四、投资限制

2、本基金不得投资于以下金融工具：（一）本基金不得投资于以下金融工具：

（3）剩余期限（或回售期限）超过397天的债券；（3）剩余期限（或回售期限）超过397天的债券、资产支持证券、中期票据；

(4) 信用等级在 A+ 级以下的企业债券； (4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；

(7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。 (7) 中国证监会禁止投资的其他金融工具。

## 第十二部分基金的投资 3、组合限制 (二) 投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制： 基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 127 天； (1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天；

(2) 投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%； (2) 本基金持有的一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(3) 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%； (3) 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%；

(4) 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%； (4) 除发生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个工作日内进行调整；

(5) 本基金的存款银行应为至少具有基金托管资格、基金代销资格或 QFII 托管人资格之一的商业银行； (5) 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%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金投资于定期存款（根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款除外）的比例，不得超过基金资产净值的 30%； (6) 本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；

(7) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的协议存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%； (7) 本基金的存款银行为具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的商业银行。存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；

(8) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%； (8) 本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，不受此限制；

(9) 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%；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%；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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）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； (9) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；

(10) 本基金投资的短期融资券的信用评级，应不低于以下标准： (10) 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%；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%；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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）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；

1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别； (11) 本基金投资的短期融资券的信用评级，应不低于以下标准：

2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别； 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融

资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。 i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

3) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。 ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。

4) 本基金持有短期融资券期间，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 20 个交易日内予以全部减持。 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

3) 本基金持有短期融资券期间，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 20 个交易日内予以全部减持；

(12) 本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；