

兴华基金管理有限公司

关于以通讯方式召开兴华瑞丰混合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

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《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，兴华瑞丰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人兴华基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）经与本基金的基金托管人招商证券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 2021 年 9 月 28 日起，至 2021 年 10 月 28 日 17:00 止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议表决票的寄达地点：

基金管理人：兴华基金管理有限公司

办公地址：山东省青岛市李沧区金水路 187 号青岛国际院士港产业加速器 2 号楼 8 层

联系人：阎坤

联系电话：400-067-8815

请在信封表面注明：“兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》（见附件一）

《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案》（见附件二）。

修改基金合同等有关事项议案的说明请参见《兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的方案说明书》（附件五）。

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 2021 年 9 月 27 日，即 2021 年 9 月 27 日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件三或登录本基金管理人网站（www.xinghuafund.com.cn）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，并提供本人有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

(2) 机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章或基金管理人认可的其他印章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

(3) 合格境外投资者自行投票的，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有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件，该合格境外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投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外投资者资格的证明文件的复印件。

(4) 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等文件，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2021 年 9 月 28 日起，至 2021 年 10 月 28 日 17:00 以前（送达时间以基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本公告第一条第 3 项所述的寄达地址，并请在信封表面注明：“兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、授权

本基金的基金份额持有人如不能亲自参与本次大会，可以授权委托基金管理人、基金托管人、基金销售机构或其他符合法律规定的机构和个人等代理人参与大会并通过纸质投票方式进行投票。

1、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，并提供个人投资者有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（可参照附件四）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

2、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（可参照附件四）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营

业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

3、合格境外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（可参照附件四）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份且基金管理人认可的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

4、如果代理人为基金管理人、基金托管人或基金销售机构，前述代理人将在取得基金份额持有人签署的授权委托书后统一办理委托投票手续（包括提供代理人有关证明文件）。

5、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等文件，以基金管理人的认可为准。

6、授权效力确定规则

（1）同一基金份额持有人送达了有效表决票，又存在有效纸面授权的，以其送达的有效表决票为准。

（2）如最后时间收到的纸面授权有多次，不能确定最后一次授权的，按以下原则处理：若多次授权的授权表示一致的，按照该相同的授权表示为准；若多次授权同一代理人但授权表示不一致的，视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权；若授权不同代理人且授权表示不一致的，视为授权无效，不计入有效票。

（3）如果委托人在授权委托书中明确其表决意见的，以委托人的表决意见为准；如果授权委托书中未明确委托人的表决意见的，即视为授权代理人按照代理人的意志全权行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人选择其中一种表决意见行使表决权。

六、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（招商证券股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议表决截止日期（即 2021 年 10 月 28 日）后 2 个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在规定时间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) 基金份额持有人送达了有效表决票，又存在有效纸面授权的，以其送达的有效表决票为准。

(3) 如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在规定时间之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。

(5) 基金份额持有人重复提交表决票或同时进行纸质投票的，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；

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。

七、决议生效条件

1、本次会议召开的条件为：本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

2、本次议案审议事项经提交有效表决票的本基金基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（二分之一）通过方为有效。

3、直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、《基金合同》和本公告的规定，并与登记机构记录相符；

4、本次基金份额持有人大会的决议，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，具体修改后的基金合同生效日期另行公告。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接出具有效表决意见或授权他人代表出具有效表决意见的基金份额持有人

所代表的基金份额达到在权益登记日基金总份额的二分之一以上（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》的规定和《基金合同》的约定，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。

重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。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，详细说明见基金管理人届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

九、本次大会相关机构

- 1、召集人（基金管理人）：兴华基金管理有限公司
- 2、基金托管人：招商证券股份有限公司
- 3、公证机关：北京市方圆公证处
联系人：崔军
联系电话：（010）85197622
- 4、律师事务所：上海市通力律师事务所

十、重要提示

- 1、关于本次会议审议事项请见附件一、附件二。
- 2、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。
- 3、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 400—067—8815（国内免长途话费）咨询。
- 4、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，就本次基金份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。
- 5、本公告的有关内容由兴华基金管理有限公司负责解释。

兴华基金管理有限公司

2021 年 9 月 24 日

附件一：《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》

附件二：《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案》

附件三：《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件四：《授权委托书》

附件五：《兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的方案说明书》

附件一：

关于兴华瑞丰混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案

兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人：

为提高产品的市场竞争力，更好地维护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《兴华瑞丰混合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招商证券股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开兴华瑞丰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，提议持续运作本基金。

为实施持续运作本基金，提议授权基金管理人办理本次持续运作本基金的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况，决定采取相关基金持续运作的措施以及确定基金持续运作各项工作的具体时间。

以上议案，请予审议。

基金管理人：兴华基金管理有限公司

2021年9月24日

附件二：

关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案

兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人：

为提高产品的市场竞争力，更好地维护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《兴华瑞丰混合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招商证券股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开兴华瑞丰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，审议本基金变更投资范围有关事项的议案，具体方案见附件五《兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的方案说明书》。

同时，为实施兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围方案，提议授权基金管理人办理本次兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关具体事宜，并根据现时有效的法律法规的规定和《兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的方案说明书》的有关内容对《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》、《兴华瑞丰混合型证券投资基金托管协议》和《兴华瑞丰混合型证券投资基金招募说明书》进行修改。

具体修改后的基金合同的生效时间另行公告。

以上议案，请予审议。

基金管理人：兴华基金管理有限公司

2021年9月24日

附件三：

兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票			
基金份额持有人姓名/名称：			
证件号码(身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码)	基金账户号		
受托人（代理人）姓名/名称：	受托人（代理人）证件号码（身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码）：		
审议事项	同意	反对	弃权
关于兴华瑞丰混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案			
审议事项	同意	反对	弃权
关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案			
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。对每一项议案，基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。 “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.xinghuafund.com.cn）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件四：

授权委托书

兹委托 _____ 代表本人（或本机构）参加投票截止日为 _____ 年 _____ 月 _____ 日的以通讯方式召开的兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议计票结束之日止。若兴华瑞丰混合型证券投资基金重新召集审议相同议案的基金份额持有人大会的，除有新的授权外，本授权继续有效。本授权不得转授权。

委托人（签字/盖章）： _____

委托人身份证号或营业执照号/统一社会信用代码： _____

委托人基金账户号： _____

受托人（代理人）（签字/盖章）： _____

受托人（代理人）身份证号或营业执照号/统一社会信用代码： _____

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。
- 3、受托人（代理人）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。

附件五：

兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的方案说明书

一、重要提示

1、为提高产品的市场竞争力，更好地维护基金份额持有人利益，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》和《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同（草案）》有关规定，基金管理人经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开兴华瑞丰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会，审议关于本基金变更投资范围有关事项的议案。

2、本次兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围的方案经提交有效表决票的本基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（二分之一）通过方为有效，因此本基金变更投资范围的方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。具体修改后的基金合同生效时间另行公告。中国证监会对本次兴华瑞丰混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议的备案，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、变更注册方案要点

（一）修改投资范围

投资范围增加国内依法发行和上市交易的央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、证券公司短期公司债券、二级资本债、政府支持机构债券、政府支持债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、资产支持证券、金融衍生品（包括股指期货、国债期货）。

（二）修改投资组合比例

根据变更注册后基金的特点，具体调整如下：

原《基金合同》表述为：“本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%；本基金投资同业存单不超过基金资产的20%；每个交易日日终，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。”

修改为“本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%；本基金投资同业存单不超过基金资产的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。”

（三）修改投资策略

根据变更注册后基金的特点，调整债券投资策略，新增信用债、证券公司短期公司债券、

可转换债券和可交换债券、杠杆、股指期货、国债期货、资产支持证券投资策略。

（四）修改投资限制

根据变更注册后基金的特点，调整部分投资限制条款，同时新增资产支持证券、股指期货、国债期货等投资限制。

（五）修改业绩比较基准

原业绩比较基准：“中债国债总全价指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%”

修改为：“中债综合指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”

（六）变更基金的估值对象、估值方法及公开披露的基金信息

由于基金投资范围的调整，据此修改基金的估值对象及估值方法，并增加公开披露的基金信息。

（七）其他情况

配合上述修改内容，根据现行有效的法律法规、监管机构相关要求，对本基金基金合同中的相关条款和描述进行修改和完善。除此之外，变更后的基金风险收益特征、收益分配等主要方面不发生变化。

基金合同的具体修改内容见本说明附件《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》。

三、修改基金合同的可行性

（一）法律可行性

根据《基金合同》约定，可以通过召开基金份额持有人大会的方式，修改基金投资范围、修改基金投资策略以及对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。按照《基金合同》的要求，以上变更事项需经基金份额持有人大会决议的一般决议通过，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效。

（二）授权基金管理人修订基金合同的可行性

本基金的基金合同、托管协议将按照法律法规的规定进行修订，修订后的基金合同、托管协议需经基金管理人和基金托管人签字盖章，基金管理人将在基金份额持有人大会召开前向中国证监会提交兴华瑞丰混合型证券投资基金变更注册申请，并将修订后的基金合同、托管协议、招募说明书等材料一并报送中国证监会审核。

本基金管理人将在基金份额持有人大会表决议案中提议授权基金管理人对基金合同进行必要的修改和补充。

四、本基金修改基金合同的主要风险及预备措施

（一）预防修改基金合同后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通,避免修改基金合同后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

(二) 修改基金合同公告后遭遇大规模赎回的风险

为降低部分基金份额持有人在修改基金合同后赎回对基金平稳运作的影响,在修改基金合同之后,基金管理人将择机进行持续营销,可在很大程度上降低修改基金合同对本基金规模的影响。

五、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系基金管理人:

名称: 兴华基金管理有限公司

客户服务热线: 400—067—8815 (国内免长途话费)

兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节	变更注册前	拟变更注册后	修改理由
第一部分 前言	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》”)、《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。	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。	根据法律法规的修订做出相应的修改。

<p>第二部分 分 释义</p>	<p>19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》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</p> <p>20、人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法：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</p> <p>21、投资人、投资者：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</p>	<p>19、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》及相关法律法规规定可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</p> <p>20、投资人、投资者：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</p>	<p>根据法律法规的修订做出相应的修改。</p>
<p>第四部分 基金份额的发售</p>	<p>3、发售对象</p> <p>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。</p>	<p>3、发售对象</p> <p>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。</p>	<p>根据法律法规的修订做出相应的修改。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券、期货交易市场、证券、期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照</p>	<p>根据本基金投资范围补充。</p>

	法》的有关规定在规定媒介上公告。	《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。	
第六部分 基金份额的申购与赎回	七、拒绝或暂停申购的情形 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。	七、拒绝或暂停申购的情形 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。	根据本基金投资范围补充。
第六部分 基金份额的申购与赎回	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。	八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。	根据本基金投资范围补充。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	二、基金托管人 (二) 基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： (4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算； 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： (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；	二、基金托管人 (二) 基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： (4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户、为基金办理证券、期货交易资金清算； 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： (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；	根据本基金投资范围补充。
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会	二、投资范围 本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注	根据本基金变更注册的实际调整

	<p>核准或注册上市的股票)、债券(国债、政策性金融债、地方政府债)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金不投资信用债、可交换债券及可转换债券。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%;本基金投资同业存单不超过基金资产的20%;每个交易日日终,现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>	<p>册上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、证券公司短期公司债券、二级资本债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%;本基金投资同业存单不超过基金资产的20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>	<p>投资范围和比例,删除不适用的条款。</p>
第十二	三、投资策略	三、投资策略	根据本基

<p>部分基金的投资</p>	<p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资策略为利率债投资策略。</p> <p>(1) 久期匹配策略</p> <p>在选择债券品种时,首先根据宏观经济、资金面动向、投资人行为、市场成交量和活跃度等方面的分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期。久期控制是根据宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效地控制利率波动风险。当宏观经济下行时,代表国家主权信用的10年期国债利率(无风险利率)往往下行,此时加大债券组合久期,配置长期利率品种,获得资本利得收益。当经济过热时,央行紧缩银根,无风险利率上行,此时缩短久期防御,采用以票息为主的配置策略。</p> <p>(2) 期限结构策略</p> <p>期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中期限策略、两端哑铃策略、均匀分布策略,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,通过收益率曲线的陡峭平缓状态,预判期限利差变化获利。骑乘操作是期限结构策略中的重要方法,具体操作为当收益率</p>	<p>3、债券投资策略</p> <p>1) 久期匹配策略</p> <p>在选择债券品种时,首先根据宏观经济、资金面动向、投资人行为、市场成交量和活跃度等方面的分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期。久期控制是根据宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效地控制利率波动风险。当宏观经济下行时,代表国家主权信用的10年期国债利率(无风险利率)往往下行,此时加大债券组合久期,配置长期利率品种,获得资本利得收益。当经济过热时,央行紧缩银根,无风险利率上行,此时缩短久期防御,采用以票息为主的配置策略。</p> <p>2) 期限结构策略</p> <p>期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中期限策略、两端哑铃策略、均匀分布策略,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,通过收益率曲线的陡峭平缓状态,预判期限利差变化获利。骑乘操作是期限结构策略中的重要方法,具体操作为当收益率曲线凸性很大且相对陡峭时,买入期限位于收益率曲线陡峭处</p>	<p>金投资范围调整的实际情况,删除不适用的条款,并补充信用债、证券公司短期公司债券、可转换债券和可交换债券、杠杆、股指期货、国债期货、资产支持证券投资策略。</p>
----------------	---	--	---

<p>曲线凸性很大且相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的利率品种，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。</p> <p>(3) 利率波段策略</p> <p>通过对宏观经济数据、市场成交量、投资者行为等因素进行深入分析，再结合期限利差走势，预判收益率曲线的变化趋势。挖掘被市场所低估的利率品种，把握左侧交易机会，具体策略为：</p> <p>a. 当宏观基本面向好，长端收益率快速上行，收益率曲线变陡峭时，通过测算期限利差所处的历史分位，加仓买入收益率涨幅超出市场预期的长端利率债；当经济数据走弱，宏观基本面不及预期时，收益率曲线平坦化，择机卖出长端利率债，获取资本利得收益。</p> <p>b. 当资金面流动性偏紧，回购利率中枢上行，短期收益率快速上行，收益率曲线变平坦时，通过测算期限利差所处的历史分位，加仓买入收益率涨幅超出市场预期的短期利率债；当资金面流动性压力逐渐缓解，回购利率中枢恢复到政策利率水平附近时，择机卖出短期利率债，获取资本利得收益。</p> <p>(4) 杠杆息差策略</p>	<p>的利率品种，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。</p> <p>3) 利率波段策略</p> <p>通过对宏观经济数据、市场成交量、投资者行为等因素进行深入分析，再结合期限利差走势，预判收益率曲线的变化趋势。挖掘被市场所低估的利率品种，把握左侧交易机会，具体策略为：</p> <p>(1) 当宏观基本面向好，长端收益率快速上行，收益率曲线变陡峭时，通过测算期限利差所处的历史分位，加仓买入收益率涨幅超出市场预期的长端利率债；当经济数据走弱，宏观基本面不及预期时，收益率曲线平坦化，择机卖出长端利率债，获取资本利得收益。</p> <p>(2) 当资金面流动性偏紧，回购利率中枢上行，短期收益率快速上行，收益率曲线变平坦时，通过测算期限利差所处的历史分位，加仓买入收益率涨幅超出市场预期的短期利率债；当资金面流动性压力逐渐缓解，回购利率中枢恢复到政策利率水平附近时，择机卖出短期利率债，获取资本利得收益。</p> <p>4) 杠杆息差策略</p> <p>杠杆息差策略属于债券套息策略的一种，是利用较为便宜的正</p>	
---	---	--

	<p>杠杆息差策略属于债券套息策略的一种，是利用较为便宜的正回购资金进行债券杠杆配置的策略，具体操作为通过在交易所和银行间市场买入国债、政策性金融债券，之后进行交易所国债正回购、银行间质押式正回购后再买入利率债品种，增厚账户的整体收益率；杠杆息差策略的收益归因主要为债券静态收益率、杠杆息差和债券交易资本利得三部分。一般来讲，在趋势相对明确的市场环境中，即长端收益率趋势稳定，短端资金成本可控或预期稳定的情况下，息差杠杆策略能够在风险可控的前提下获得较为稳定的超额收益。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>	<p>回购资金进行债券杠杆配置的策略，具体操作为通过在交易所和银行间市场买入国债、政策性金融债券，之后进行交易所国债正回购、银行间质押式正回购后再买入利率债品种，增厚账户的整体收益率；杠杆息差策略的收益归因主要为债券静态收益率、杠杆息差和债券交易资本利得三部分。一般来讲，在趋势相对明确的市场环境中，即长端收益率趋势稳定，短端资金成本可控或预期稳定的情况下，息差杠杆策略能够在风险可控的前提下获得较为稳定的超额收益。</p> <p>5) 信用债投资策略</p> <p>信用债投资策略是本基金债券投资策略的重要部分。本基金将从经济周期、国家政策、市场特征、行业发展趋势、债券发行人的公司背景、盈利能力、偿债能力、流动性等因素等多个方面考量信用利差的整体变化趋势与单个信用债的投资价值。本基金的信用债投资策略可以具体分为市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。</p> <p>(1) 市场整体信用利差曲线策略</p> <p>本基金将综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。</p> <p>本基金将从经济周期、市场特征</p>	
--	--	---	--

		<p>和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场容量、信用债结构以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征。另外，本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。</p> <p>(2) 单个信用债信用分析策略</p> <p>信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金主要通过发行主体偿债能力、抵押物质量、契约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平，对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。</p> <p>我们的投资不完全依赖于外部评级，但其中 AA 级信用债占本基金所投资的信用债比例为 0-20%；AA+级信用债占本基金所投资的信用债比例为 0-70%；AAA 级信用债占本基金所投资的信用债比例为 30%-100%。本基金对信用债券评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级。</p>	
--	--	--	--

		<p>6) 证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究,分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。</p> <p>基金投资证券公司短期公司债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</p> <p>7) 可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下,在综合分析可转换债券的固定收益类证券特征、权益类证券特征等因素的基础上,选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择,对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注,选择投资价值较高的个券进行投资。</p> <p>可交换债券同样兼具权益类证券特性和固定收益类证券特性,其中固定收益类证券特性与可转换债券相同,即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值</p>	
--	--	---	--

		<p>和票面利息；而对于权益类证券特性的分析则需关注目标公司的股票价值以及发行人作为股东的换股意愿等。本基金将通过目标公司股票的投资价值、可交换债券的债券价值、以及条款带来的期权价值等综合分析，进行投资决策。</p> <p>此外，本基金还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债和可交换债券新券的申购。本基金投资于可转债和可交换债的比例合计不超过基金资产净值的 20%。</p> <p>8) 杠杆投资策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>为更好的实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。</p> <p>(1) 股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低</p>	
--	--	---	--

		<p>股票仓位频繁调整的交易成本，以达到降低投资组合整体风险的目的。</p> <p>(2) 国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>	
第十二部分	四、投资限制 1、组合限制	四、投资限制 1、组合限制	根据法律法规及本

<p>基金的投资</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-30%；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%；</p> <p>（2）本基金每个交易日日终，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>（5）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>（6）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，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；</p> <p>（7）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-30%；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%；</p> <p>（2）本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 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；</p> <p>（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>（5）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%；</p> <p>（6）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%；</p> <p>（7）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%；</p>	<p>基金投资范围调整的实际情况调整投资比例限制。</p>
--------------	---	--	-------------------------------

<p>发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；</p> <p>（8）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（9）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>（10）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；</p> <p>（11）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第（2）、（8）和（9）项另有约定外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定</p>	<p>（8）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%；</p> <p>（9）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>（10）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>（11）本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的 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；</p> <p>（12）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受</p>	
---	--	--

	<p>投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	<p>前述比例限制；</p> <p>（13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>（14）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>（15）在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>（16）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；在任何交易</p>	
--	--	--	--

		<p>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基金资产净值的 20%；</p> <p>（17）在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；</p> <p>（18）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；</p> <p>（19）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第（2）、（9）、（13）和（14）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>	
--	--	---	--

第十二部分 基金的投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中债国债总全价指数收益率*85%+沪深300指数收益率*15%</p> <p>中债国债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的记账式国债的整体价格走势和投资回报情况。沪深300指数选样科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。</p> <p>基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%</p> <p>本基金为混合型基金。在充分考虑本基金资产配置特点和股票组合构建原则，并对市场上主要股票、债券指数的编制方案与历史表现进行考察的基础上，本基金选择市场广泛认同的选择中债综合指数作为本基金债券组合的业绩基准、选择沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准，同时参照本基金的资产配置中枢设定了债券业绩基准、股票业绩基准的相对权重。其中，中债综合指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，指数样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券、企业债券、中期票据、短期融资券、公司债等组成。沪深300指数由中证指数有限公司编制，指数样本覆盖了沪深市场自由流通市值最大、流动性最好的300只股票，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。</p> <p>选用上述业绩比较基准在当前市场能够反映本基金的风险收益特征。</p>	<p>根据本基金投资范围调整的实际调整业绩比较基准。</p>
第十三	三、基金财产的账户	三、基金财产的账户	根据本基

部分 基金的 财产	基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。	基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。	金投资范围补充。
第十四 部分 基金资 产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。	二、估值对象 基金所拥有的股票、资产支持证券、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、其他投资等资产及负债。	根据本基金投资范围调整的实际调整估值对象。
第十四 部分 基金资 产估值	四、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (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，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、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	四、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价； (5) 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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值； 。。。 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	根据本基金投资范围调整的实际调整估值方法。

	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。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。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	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。 。。 6、本基金投资股指期货合约、国债期货合约，按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。	
第十四部分 基金资产估值	七、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；	七、暂停估值的情形 1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；	根据本基金投资范围补充。
第十四部分 基金资产估值	九、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7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。 2、由于证券交易场所及其登记结算公司、第三方估值机构发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免	九、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。 2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司、第三方估值机构发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免	调整序号。 根据本基金投资范围补充。

	除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。	免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。	
第十五部分 基金费用与税收	一、基金费用的种类 。。。 7、基金的证券交易费用；	一、基金费用的种类 。。。 7、基金的证券/期货交易费用；	根据本基金投资范围补充。
第十八部分 公开披露的基金信息	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 。。。 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 。。。 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。 《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。 本基金在招募说明书（更新）等文件中披露股指期货和国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，	根据本基金投资范围调整的实际相关情况表述。

	<p>。 。 。</p> <p>(六) 基金定期报告, 包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>。 。 。</p>	<p>并充分揭示股指期货和国债期货交易对基金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。</p> <p>。 。 。</p> <p>(六) 基金定期报告, 包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>。 。 。</p> <p>本基金在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告等文件中披露股指期货和国债期货交易情况, 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和国债期货交易对基金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。</p> <p>本基金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的资产支持证券明细; 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。</p> <p>本基金在基金年报及中期报告中披露其持有的流通受限证券总额、流通受限证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的流通受限证券明细。</p>	
--	---	--	--

		o o o	
--	--	-------	--