

富国基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围删除新三板精选层股票并修订基金合同及托管协议的公告

鉴于北京证券交易所已整体承接全国中小企业股份转让系统精选层，全国中小企业股份转让系统精选层挂牌股票（以下简称“新三板精选层股票”）已全部转为北京证券交易所上市股票，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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规，以及富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金以及富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金该三只基金的基金合同的约定，富国基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与该三只基金的基金托管人协商一致，决定自2022年9月28日起对该三只基金投资范围中删除新三板精选层股票，同时对基金合同及托管协议中涉及的条款进行相应修改。

本次修订内容为删除三只基金投资范围中的新三板精选层股票，具体包括删除新三板精选层股票的投资策略、投资比例限制、估值方法及信息披露、投资风险等相关约定。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响，故无需召开基金份额持有人大会。基金合同的具体修订内容详见附件。

重要提示：

1、基金合同的修订已经履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定，无需召开基金份额持有人大会。

2、本公司于本公告日在公司网站上同时公布经修改后的基金合同、托管协议；招募说明书、产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

3、投资者可以登陆富国基金管理有限公司网站（www.fullgoal.com.cn）或拨打富国基金管理有限公司客户服务热线95105686、4008880688（全国统一，均免长途费）进行相关咨询。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，

但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同和招募说明书等法律文件，确认已知悉基金产品资料概要，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。基金具体风险评级结果以销售机构提供的评级结果为准。

附件一：富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同修订对照表

附件二：富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修订对照表

附件三：富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修订对照表

特此公告。

富国基金管理有限公司

2022年9月26日

附件一：富国清洁能源产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同修

订对照表

章节	修改前	修改后
第一部分前言	<p>八、基金投资全国中小企业股份转让系统（以下简称“全国股转系统”）精选层挂牌股票，由于全国股转系统的挂牌条件、转让规则等制度与上海、深圳证券交易所存在较大差别，基金投资全国股转系统精选层挂牌股票将面临特有风险，包括流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、挂牌公司终止挂牌风险、精选层市场波动风险，具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。</p> <p>九、本基金可根据投资策略需要，选择将部分基金资产投资于新三板精选层股票或选择不将基金资产投资于新三板精选层股票，基金资产并非必然投资新三板精选层股票。</p>	
第二部分释义	<p>60、新三板精选层股票：指在全国中小企业股份转让系统精选层挂牌并公开转让的股票</p>	
第十二部分基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、新三板精选层股票、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）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的相关规定）。</p> <p>本基金所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合；基金所投资精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例 0-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），其中投资于本基金定义的清洁能源产业相关的股票及存托</p>

	<p>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：股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例 0-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%），其中投资于本基金定义的清洁能源产业相关的股票（含新三板精选层股票）及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。</p>	<p>凭证不低于非现金基金资产的 80%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。</p>
	<p>三、投资策略</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>.....</p> <p>5、新三板精选层股票投资策略</p> <p>本基金将精选优质的新三板精选层挂牌公司纳入本基金的股票投资组合。此外，本基金还将关注新三板精选层挂牌公司股票的交易活跃度 and 公司的股权分散度。</p>	
	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；其中投资于本基金定义的清洁能源产业相关的股票（含新三板精选层股票）及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>.....</p> <p>（18）本基金投资于新三板精选层股票的市值合计不得超过本基金资产净值的 5%；</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（2）、（9）、（14）、（15）、（18）条外，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</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；其中投资于本基金定义的清洁能源产业相关的股票及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>.....</p> <p>（18）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（2）、（9）、（14）、（15）条外，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>

	<p>规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>因证券市场波动、挂牌公司或上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（18）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。</p>	
	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担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。本基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票，会面临参与挂牌公司股票交易产生的公司风险、流动性风险、信息风险等特有风险。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌的有价证券的估值</p> <p>（1）除本部分另有约定的品种外，交易所上市的有价证券（包括股票等）或全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，以其估值日在证券交易所或全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>（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机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（5）交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。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。</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>（1）除本部分另有约定的品种外，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的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>（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机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。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。</p> <p>2、处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，</p>

	<p>2、处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理： (1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所(或全国中小企业股份转让系统)挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p>	<p>按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p>
	<p>四、估值方法 7、本基金所投资的新三板精选层股票价值存在重大不确定性且面临潜在大额赎回申请时，基金管理人可基于保护基金份额持有人利益的原则，履行相应程序后启用侧袋机制。 九、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9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；</p>	<p>四、估值方法 九、特殊情形的处理 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；</p>
<p>第十八部分基金的信息披露</p>	<p>（十四）投资于新三板精选层股票的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告中披露其持有的挂牌股票总额、挂牌股票市值占基金资产净值比例、报告期内持有的挂牌股票明细。</p>	

附件二：富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修

订对照表

章节	修改前	修改后
第一部分前言	<p>八、本基金的投资范围包括全国中小企业股份转让系统（以下简称“新三板”）精选层股票，由于新三板的挂牌条件、转让规则等制度与上海、深圳证券交易所存在较大差别，基金投资新三板精选层股票将面临特有风险，包括流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、挂牌公司终止挂牌风险、精选层市场波动风险等，具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。本基金可根据投资策略需要，选择将部分基金资产投资于新三板精选层股票或选择不将基金资产投资于新三板精选层股票，基金资产并非必然投资新三板精选层股票。</p>	
第二部分释义	<p>60、新三板精选层股票：指在全国中小企业股份转让系统精选层挂牌并公开转让的股票</p>	
第十二部分基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、新三板精选层股票、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（权证、股指期货等）以及法律法规允许或经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合；基金所投资精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外。</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>二、投资范围</p> <p>本基金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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、衍生工具（权证、股指期货等）以及法律法规允许或经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须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：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指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</p>

	<p>基金的投资组合比例为：股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>	<p>值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
	<p>三、投资策略 3、新三板精选层股票投资策略 本基金将精选优质的新三板精选层挂牌公司纳入本基金的股票投资组合。此外，本基金还将关注新三板精选层挂牌公司股票的交易活跃度和公司的股权分散度。</p>	
	<p>四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%； （23）本基金投资于新三板精选层股票的市值合计不得超过本基金资产净值的 5%； （24）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。 除第（2）、（13）、（20）、（21）、（23）条外，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。 因证券市场波动、挂牌公司或上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（23）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。</p>	<p>四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%； （23）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。 除第（2）、（13）、（20）、（21）条外，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>
	<p>六、风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票，会面临参与挂牌公司股票交易产生的公司风险、流动性风险、信息风险等特有风险。</p>	<p>六、风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。</p>

<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌的有价证券的估值</p> <p>(1) 除本部分另有约定的品种外，交易所上市的有价证券（包括股票等）或全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，以其估值日在证券交易所或全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(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机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(5) 交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。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。</p> <p>2、处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所（或全国中小企业股份转让系统）挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>……</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 除本部分另有约定的品种外，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的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(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机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；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。</p> <p>2、处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>……</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>（十五）投资于新三板精选层股票的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告中披露其持有的挂牌股票总额、挂牌股票市值占基金资产净值比例、报告期内持有的挂牌股票明细。</p>	

附件三：富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修

订对照表

章节	修改前	修改后
第一部分前言	八、本基金的投资范围包括全国中小企业股份转让系统（以下简称“新三板”）精选层股票，由于新三板的挂牌条件、转让规则等制度与上海、深圳证券交易所存在较大差别，基金投资新三板精选层股票将面临特有风险，包括流动性风险、挂牌公司经营风险、挂牌公司降层风险、挂牌公司终止挂牌风险、精选层市场波动风险等，具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。本基金可根据投资策略需要，选择将部分基金资产投资于新三板精选层股票或选择不将基金资产投资于新三板精选层股票，基金资产并非必然投资新三板精选层股票。	
第二部分释义	60、新三板精选层股票：指在全国中小企业股份转让系统精选层挂牌并公开转让的股票	
第十二部分基金的投资	<p>二、投资范围</p> <p>本基金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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、新三板精选层股票、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金所投资新三板精选层挂牌公司被调出精选层的，自调出之日起，基金管理人不得新增投资该股票，并应当逐步将该股票调出投资组合；基金所投资精选层挂牌公司因转板上市被调出精选层的除外。</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：股票（含新三板精选层</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须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>股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p>	<p>基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p>
	<p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>3、新三板精选层股票投资策略</p> <p>本基金将精选优质的新三板精选层挂牌公司纳入本基金的股票投资组合。此外，本基金还将关注新三板精选层挂牌公司股票的交易活跃度和公司的股权分散度。</p>	
	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票（含新三板精选层股票）及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%；</p> <p>.....</p> <p>（21）本基金投资于新三板精选层股票的市值合计不得超过本基金资产净值的 5%；</p> <p>（22）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>除第（2）、（12）、（18）、（19）、（21）条外，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>因证券市场波动、挂牌公司或上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（21）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-95%；</p> <p>.....</p> <p>（21）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>除第（2）、（12）、（18）、（19）条外，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>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票，会面临参与挂牌公司股票交易产生的公司风险、流动性风险、信息风险等特有风险。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。</p>

<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌的有价证券的估值</p> <p>(1) 除本部分另有约定的品种外，交易所上市的有价证券（包括股票等）或全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，以其估值日在证券交易所或全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(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机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(5) 交易所上市或全国中小企业股份转让系统挂牌不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。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。</p> <p>2、处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所（或全国中小企业股份转让系统）挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>.....</p> <p>6、本基金所投资的新三板精选层股票价值存在重大不确定性且面临潜在大额赎回申请时，基金管理人可基于保护基金份额持有人利益的原则，履行相应程序后启用侧袋机制。</p> <p>.....</p> <p>八、特殊情形的处理</p> <p>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；</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 除本部分另有约定的品种外，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的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(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机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。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。</p> <p>2、处于未上市或未挂牌期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>.....</p> <p>八、特殊情形的处理</p> <p>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；</p>
----------------------------	---	---

第十八部分基金的信息披露	(十五)投资于新三板精选层股票的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告中披露其持有的挂牌股票总额、挂牌股票市值占基金资产净值比例、报告期内持有的挂牌股票明细。	