

海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通一年定期开放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

海富通基金管理有限公司决定以通讯方式召开海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会,并于2023年12月21日在指定媒介发布了《海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、会议基本情况
海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1062号文准予注册募集的海富通一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2013年10月24日成立。

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《海富通一年定期开放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,基金管理人经与基金托管人协商一致,决定召开本基金基金份额持有人大会,审议关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案。会议具体安排如下:

1. 会议召开方式:通讯开会方式。
2. 会议投票表决时间:自2023年12月29日起,至2024年1月23日17:00止(投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准)。

3. 通讯表决票将送达至基金管理人,具体地址和联系方式如下:

收件人:吴晨露
地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号19层1901-1908室
联系电话:021-38650821
邮政编码:200120

在信封表面注明“海富通一年定期开放债券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
本次持有人大会审议的事项为《关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案》(以下简称“《议案》”),《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2023年12月28日,即在2023年12月28日证券交易所交易结束后,在登记机构登记在册的基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、纸质表决票的填写和寄交方式

1. 本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站(<http://www.hftfund.com>)、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)下载并打印等方式获取表决票。

2. 基金份额持有人应当按照表决票的填写要求填写相关内容,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机构公章或基金管理人认可的相关业务专用章(以下合称“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身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件等的复印件;
(4)基金份额持有人可授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。

①个人投资者委托他人投票的,应由受托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,以及授权的授权委托书原件(参照附件二)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托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);

②机构投资者委托他人投票的,应由受托人在表决票上签字或盖章,并提供持有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)的批文、开户证明或登记证书复印件及其他有效证明文件的复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件等的复印件;如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托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);

③合格境外机构投资者委托他人投票的,应由受托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证明文件的复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;如受托人为个人,还需提供受托人的身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

(5)以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等,以基金管理人的认可为准。
3. 基金份额持有人或其受托人需将填写完整的表决票和所需的相关文件于会议投票表决起止时间内(自2023年12月29日起,至2024年1月23日17:00止,送达时间以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送达或邮寄的方式送达至基金管理人的办公地址,并请在信封表面注明:“海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

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)授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机关对计票过程予以公证。

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)纸质表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的,表决时间以基金管理人收到表决票时间为准。2023年12月23日17:00以后送达收件人的纸质表决票,均为无效表决。

(2)纸质表决票的效力认定:

①有效表决票:完整清晰,所提供文件符合本公告规定,且在截止时间之前送达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,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

②如纸质表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或相互矛盾,但其他各项符合会议通知规定的,视为有效表决票。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。

③如纸质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受托人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前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基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

④基金份额持有人重复提交纸质表决票的,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:

i. 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;
ii. 送达时间为同一天的,按如下原则确定:先送达的以实际送达时间为准,后送达的以实际送达时间为准;
iii. 送达时间按如下原则确定:专人送达的以实际送达时间为准,邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

六、决议生效条件

1. 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权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一);

2. 《关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案》应当由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(含二分之一)通过方为有效;

3. 本基金基金份额持有人大会表决通过的事项,将由基金管理人在自通过之日起5日内报中国证监会备案,并于决议生效之日起2日内在规定媒介上公告,基金份额持有人大会决议的事项自基金份额持有人大会表决通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定,本次持有人大会的召开需要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)。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,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。重新召集基金份额持有人大会时除将授权文件有效载明本次基金份额持有人大会授权期限外,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:海富通基金管理有限公司
地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号18层1802-1803室以及19层1901-1908室
客服电话:40088-40099

联系人:吴晨露
联系电话:021-38650821
网址:<http://www.hftfund.com>

2. 公证机构:上海市东方公证处
地址:上海市凤阳路598号

联系人:林奇
联系电话:021-62154848

3. 见证律师:上海市通力律师事务所
注册及办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话:021-31358666

4. 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

九、重要提示

1. 本基金已于2023年05月25日起进入封闭期,封闭期内不接受申购、赎回及转换申请(详见基金管理人于2023年4月21日发布的《海富通一年定期开放债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换业务公告》)。

2. 请基金份额持有人及时在邮寄表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

3. 上述基金份额持有人大会有关公告可通过海富通基金管理有限公司网站(<http://www.hftfund.com>)、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)查阅,投资者如有任何疑问,可致电40088-40099咨询。

4. 根据《基金合同》的规定,本次基金份额持有人大会费用以及会计师费、公证费、律师费等相关费用可从基金资产中列支。

5. 本公告的有关内容由海富通基金管理有限公司解释。

特此公告。

海富通基金管理有限公司

2023年12月22日

附件一:《关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案》及其说明

附件二:授权委托书(样本)

附件三:《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件四:《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同/修改要点对照表》

附件五:

关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案

海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人:根据市场环境变化,为了更好地满足投资者需求,保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《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,拟在海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围新增国债期货、修改业绩比较基准,降低C类基金份额销售服务费,以及因法律法规更新,完善本基金实际运作等修改基金合同、托管协议中的相关内容。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过,基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改,并可根据届时有效的法律法规且在不涉及基金合同当事人权利和义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,对《基金合同》进行其他修改或必要补充。本基金的招募说明书、托管协议和基金产品资料概要也将进行必要的修改或补充。

关于上述修改的具体方案可参见《关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案的说明》。
以上议案,请予审议。

海富通基金管理有限公司
2023年12月21日

关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案的说明

《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)于2013年10月24日生效,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。根据市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保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《基金合同》的有关规定,拟对海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围中新增国债期货并依法法规更新,完善本基金实际运作等修改基金合同,托管协议中的相关内容,具体方案如下:

一、方案要点

在海富通一年定期开放债券型证券投资基金的投资范围中新增国债期货,修改业绩比较基准、降低C类基金份额销售服务费,并因法律法规更新,完善本基金实际运作修改基金合同、托管协议中的相关内容,修改点如下:

- 1.在投资范围中新增国债期货,并据此增加国债期货的投资策略、投资限制、估值方法、信息披露等相关内容。
- 2.将海富通一年定期开放债券型证券投资基金的业绩比较基准由一年期银行定期存款税后收益率+1.2%修改为中债综合全价(总值)指数。
- 3.将海富通一年定期开放债券型证券投资基金C类基金份额销售服务费年费率由0.4%下调至0.25%。
- 4.将上述主要修改外,因法律法规更新,完善本基金实际运作同步修改《基金合同》中基金份额持有人大会、基金资产估值、基金的收益分配等章节,托管协议中的相关内容同步修改。
- 5.《基金合同》具体修改内容可见后附的《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》修改要点对照表。

二、在海富通一年定期开放债券型证券投资基金的投资范围中新增国债期货,修改业绩比较基准,降低C类基金份额销售服务费,并因法律法规更新,完善本基金实际运作修改基金合同、托管协议中相关内容的可行性

- 1.法律层面

《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》“第九部分 基金份额持有人大会”之“一、召开事由”约定:“1.除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外,当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:……(8)变更基金投资目标、范围或策略;(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;……”,因此,基金管理人应就《基金合同》上述修改事项召开基金份额持有人大会,由基金份额持有人大会决定是否同意。

同时,《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》“第九部分 基金份额持有人大会”章节约定:“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。本次审议变更基金投资范围中新增国债期货事项属于一般决议事项。”

《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》“第九部分 基金份额持有人大会”之“(3)召开事由”约定:“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:……(3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调低基金销售服务费、调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;”“第十三部分 基金的投资”之“五、业绩比较基准”约定:“……本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况下业绩比较基准进行相应调整。经履行适当程序,本基金可以变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。”

因此,海富通一年定期开放债券型证券投资基金变更投资范围,修改业绩比较基准,降低C类基金份额销售服务费,并相应修订基金合同、托管协议等内容不存在法律方面的障碍。

2.准备工作有序推进

为了保障海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的顺利召开,基金管理人成立了专门的工作小组,筹备基金份额持有人大会事宜,并与律师事务所、公证机构、机构投资者和部分个人客户进行了沟通,制定了客户通过通讯方式参与基金份额持有人大会的方式方法,从而保证基金份额持有人大会可以顺利进行。

三、调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围的主要风险及预备措施

本次本基金投资范围中新增国债期货并因法律法规更新,完善本基金实际运作修改基金合同、托管协议中相关内容的议案,主要风险是议案被基金份额持有人大会否决的风险。

在提交议案并设计具体方案之前,基金管理人已与基金份额持有人进行了联系,认真听取了相关意见,拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。议案公告后,我司还将再次征询基金份额持有人的意见。如果议案未获得基金份额持有人大会通过,基金管理人计划在规定时间内,按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交相关议案。

附件三:

授权委托书(样本)

兹全权委托 先生/女士或 机构代表本人(或本机构)参加以通讯开会方式召开的海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为行使所有有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。若在法定时间内就同一议案重新召开海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会,除本人(或本机构)重新作出授权外,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章): _____
委托人证件号码(填写): _____
委托人基金账号(填写): _____
受托人(签字/盖章): _____
受托人证件号码(填写): _____

签署日期: 年 月 日

附注:

- 1.基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、销售机构以及其他符合法律规定的机构和個人,代為行使本次基金份额持有人大会上的表决权。
- 2.本授权委托书(样本)中“委托人证件号码”指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新,“受托人证件号码”指受托人的身份证件号码或营业执照注册号。
- 3.同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的,应当填写基金账户号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人的基金所有份额。
- 4.如本次持有人大会权益登记日,投资者未持有本基金的基金份额,则其授权无效。

附件三:

海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称:			
证件号码(身份证件号/营业执照号):			
基金账号:			
提议事项:	同意	反对	弃权
关于调整海富通一年定期开放债券型证券投资基金投资范围及修改基金合同有关事项的议案			
基金份额持有人(或受托人)签名或盖章:			
年 月			
说明:请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选或字迹无法辨认、模糊不清或互相矛盾的,但其他各项符合会议通知规定的表决意见均视为投票人放弃表决权,基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签名或盖章部分填写不清晰、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或受托人有效授权的证明文件的,或未能在规定时间内送达本公告规定的收件人的,表决票计为无效表决票。同一基金份额持有人拥有多个此类基金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,应当填写基金账户卡号,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。			
表决票效力认定的其他规则详见本次持有人大会公告。			

附件四:

《海富通一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》修改要点对照表

本基金基金合同的修改要点如下表(因法律法规更新,完善本基金实际运作而修改的相关内容未包含在表内)。

章节	变更前	变更后
第十三部分 基金的投资	本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转债、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。	本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可转债、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款、国债期货等,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。
二、投资范围	本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,但可持有因可转债转股所形成的股票以及股票质押或可分离交易可转债分离交易的权证等资产。因上述原因持有的股票、权证等权益类资产,基金将在其可交易之日起的6个月内卖出。	本基金不直接从二级市场买入股票等权益类资产,但可持有因可转债转股所形成的股票等资产。因上述原因持有的股票等权益类资产,基金将在其可交易之日起的6个月内卖出。
第十三部分 基金的投资策略	基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(但应开放流动性需要,为保护基金份额持有人利益,开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制);本基金持有的股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中持有的全部权证市值不超过基金资产净值的3%;开放期内,本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等)或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%,封闭期内不受上述5%的限制。	基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(但应开放流动性需要,为保护基金份额持有人利益,开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制);本基金持有的股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%。开放期内,本基金每个交易日,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或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,封闭期内不受上述5%的限制。
第十三部分 基金的投资策略	3、中小企业私募债券投资策略 与传统的信用债相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析债券的实际信用风险,并寻求足够收益补偿,增加基金收益。本基金管理人将对单个信用资质进行详尽的分析,从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,进而预测信用水平变化趋势,决定投资策略。在流动性风险控制上,本基金将重点放在一级市场,并根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模,严格防范流动性风险。	6、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

<p>第十三部分 基金的投资 四、投资 限制</p>	<p>1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： (1)本基金债券资产的比例不低于基金资产的80%(但应开放流动性需要,为保护基金份额持有人利益,开放期开始前一个月至开放期结束后三个月内不受此比例限制);本基金持有的股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%; (2)开放期内,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后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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;封闭期内不受上述5%的限制; (3)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%; (4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%; (5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%; (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%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期; (7)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%; (8)除上述第(2)、(3)、(4)、(5)、(6)、(7)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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,基金管理人应当在相关证券可交易之日起的10个交易日内进行调整,法律法规另有规定的,从其规定。 2、禁止行为</p>	<p>1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： (1)本基金债券资产的比例不低于基金资产的80%(但应开放流动性需要,为保护基金份额持有人利益,开放期开始前一个月至开放期结束后三个月内不受此比例限制);本基金持有的股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%; (2)开放期内,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后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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、应收申购款等,封闭期内不受上述5%的限制; (3)本基金参与国债期货交易,应遵循以下中国证监会规定的投资限制: (1)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的5%; (2)本基金在任何交易日日终,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%; (3)本基金在任何交易日日内交易(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%; (4)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。 除上述第(2)、(10)、(11)、(12)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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,法律法规另有规定的,从其规定。 2、禁止行为 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事内幕交易、操纵市场交易,应当符合基金合同约定的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>
<p>第十三部分 基金的投资 五、业绩 比较基准</p>	<p>本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款税后收益率+12%。 在每个封闭期首日至下一个开放期最后一日,上述一年期银行定期存款税后收益率"指当期封闭期(含首个工作日,则为基金合同生效日)中国人民银行公布的一年期定期存款人民币存款基准利率,以后每一个封闭期首日开始进行调整。 如果今后法律法规发生变化,或中国人民银行调整或停止该基准利率的发布,或证券市场中有其他更具代表性更强或更权威的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,对相关业绩比较基准进行相应调整。经履行适当程序后,本基金将以变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。</p>	<p>本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围更加广泛,具有客观、公正、透明、覆盖更全面的特点,能够更好地反映债券市场的整体水平和变动趋势,因此亦可较好的反映本基金的风险收益特征。 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本基金业绩比较基准中涉及的指数更名或停止发布,本基金管理人可以在维护持有人利益的前提下,按照法律法规的相关规定,在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,适当调整业绩比较基准并及时公告。</p>
<p>第十三部分 基金的投资 六、风险 收益特征</p>	<p>本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于较低风险水平的投资品种。</p>	<p>本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。</p>
<p>第十五部分 基金资产估值 二、估值 对象</p>	<p>基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p>	<p>基金所拥有的股票、债券、银行存款本息、应收款项、国债期货合约、其它投资等资产及负债。</p>
<p>第十五部分 基金资产估值 三、估值原 则</p>	<p>基金管理人应当在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、《监管部门有关规定》。 (一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。 与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用方式等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。 (二)对不存在活跃市场的投资品种,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公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。 (三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。</p>	<p>基金管理人应当在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、《监管部门有关规定》。 (一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。 与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用方式等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。 (二)对不存在活跃市场的投资品种,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公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。 (三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。</p>
<p>第十五部分 基金资产估值 四、估值 方法</p>	<p>1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了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,确定公允价值; (2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,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,按最近交易日的收盘价估值。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,确定公允价值; (3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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,确定公允价值;</p>	<p>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了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,确定公允价值; (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全价进行估值; (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全价或推荐估值全价进行估值; (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。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; (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,应以活跃市场上最近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。</p>

<p>(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。交易所上市的资产支持证券,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。</p> <p>2.处于上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</p> <p>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的公允价值估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3.全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。</p> <p>4.因持有股票而享有的配股权,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。</p> <p>6.中小企业私募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。</p>	<p>2.处于上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(1)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。</p> <p>(2)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>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全价估值;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全价或推荐估值全价估值。对于含权固定收益品种的固定收益品种,使用回售权的,在回售登记日至实际收款日期间按照建议选取第三方估值机构提供的估值全价估值;未使用回售权的按照最近交易日(含当日)后未使用回售权的建议按照长待偿期所对应的价格进行估值。</p> <p>5.国债期货合约估值方法</p> <p>本基金投资国债期货合约,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发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。</p>	
<p>第十六部分 基金费用与税收</p> <p>二、基金费用计提标准</p> <p>和支付方式</p>	<p>3.C类基金份额的销售服务费</p> <p>本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费率为0.4%,按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。</p> <p>销售服务费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$ <p>H为C类基金份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E为前一日C类基金份额的基金资产净值</p>	<p>3.C类基金份额的销售服务费</p> <p>本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费率为0.25%,按前一日C类基金资产净值的0.25%年费率计提。</p> <p>销售服务费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ <p>H为C类基金份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E为前一日C类基金份额的基金资产净值</p>
<p>第十九部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p>	<p>公开披露的基金信息包括:</p> <p>(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</p> <p>1.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指定网站上;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。</p> <p>2.基金产品资料概要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,基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金产品资料概要并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要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产品资料概要。</p> <p>3.基金托管协议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,基金托管协议发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金托管协议并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金托管协议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托管协议。</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金发售的日前,将基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在指定网站上,将基金合同摘要、基金产品资料概要、基金销售机构网站或营业网点;基金托管协议登载在指定网站上,并将基金合同和基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点;基金托管协议登载在指定网站上。</p> <p>(二)基金份额发售公告</p> <p>基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。</p> <p>(三)《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定报刊和网站上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>(四)基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后,在基金的封闭期间,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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,通过其指定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。</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>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>(七)临时报告</p> <p>本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。</p> <p>(八)澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>(十)清算报告</p> <p>基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>(十一)投资中小企业私募债券相关公告</p> <p>基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。</p> <p>基金管理人应当在本基金季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。</p>	<p>公开披露的基金信息包括:</p> <p>(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</p> <p>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指定网站上;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。</p> <p>4.基金产品资料概要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,基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金产品资料概要并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点;基金产品资料概要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产品资料概要。</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金发售的日前,将基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在指定网站上,并将基金合同摘要、基金产品资料概要、基金销售机构网站或营业网点;基金托管协议登载在指定网站上,并将基金合同和基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点;基金托管协议登载在指定网站上。</p> <p>(二)《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定报刊和网站上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>(三)《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定报刊和网站上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>(四)基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后,在基金的封闭期间,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>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,通过其指定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。</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>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>(七)临时报告</p> <p>本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定网站上。</p> <p>(八)澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>(十)清算报告</p> <p>基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>(十一)投资中小企业私募债券相关公告</p> <p>基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。</p> <p>基金管理人应当在本基金季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。</p>