

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智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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）有限公司已于2025年5月21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智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划份额持有人大会的公告》。为了使本次份额持有人大会顺利召开，现发布《关于以通讯方式召开广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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，广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会2021年10月21日《关于准予广发增强型基金优选集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2021〕3261号）准予，由广发增强型基金优选集合资产管理计划变更而来。《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《集合合同》）自2022年4月11日起生效。

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”），集合计划托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“托管人”或“招商银行”）。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6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《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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5月26日起，至2025年6月23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《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）有关事项的议案》，详见附件一。

上述议案的内容说明见《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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5月23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：“广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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5月26日09:30起，至2025年6月23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）

为方便份额持有人参与大会投票，自2025年5月26日起，至2025年6月23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（仅适用于销售机构为广发证券股份有限公司的个人投资者）

为方便份额持有人参与大会投票，自2025年5月26日起，至2025年6月23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。份额持有人可自行通过易淘金APP参与本次投票，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（招商银行股份有限公司）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.《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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：招商银行股份有限公司

住所及办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

联系电话：0755-86206039

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：《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）有关事项的议案》

附件二：《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）有关事项的说明》

附件三：《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划份额持有人大会表决票》

附件四：《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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：《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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5月23日

附件一：关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）有关事项的议案

广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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招商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智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划份额持有人大会，提议审议广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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、变更投资限制、变更业绩比较基准、变更投资策略、变更估值方法、变更申购费、变更律师事务所等以及进行份额折算，并相应修订产品法律文件。具体方案可参见附件二《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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：《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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，广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会2021年10月21日《关于准予广发增强型基金优选集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]3261号）准予，由广发增强型基金优选集合资产管理计划变更而来。《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《集合合同》”）自2022年4月11日起生效。

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”），集合计划托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“托管人”或“招商银行”）。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6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”），广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划相应变更为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）的议案。

（二）本次广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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日内在指定媒介上公告。

二、变更的主要内容

（一）变更产品名称

产品名称由“广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划”变更为“广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）”。

（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吕琪”变更为“广发基金管理有限公司旗下基金经理曹建文”。

（四）变更存续期限

存续期限从“自本集合合同变更生效日起存续期至2025年6月30日”变更为“不定期”。

（五）变更投资范围

投资范围增加“公募REITs，资产支持证券”，明确权益类的混合型基金的界定为

“基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产60%的混合型基金，或者根据基金披露的定期报告最近4个季度中任一季度股票投资占基金资产的比例均不低于60%的混合型基金”。

（六）变更投资限制

根据投资范围的变动相应修改投资限制，并删除“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。

（七）变更业绩比较基准

“沪深300指数收益率×20%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×5%+中债总指数收益率×75%”变更为“沪深300指数收益率×25%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%+中债-综合全价(总值)指数收益率×65%+银行活期存款利率(税后)×5%”。

（八）变更投资策略

修改基金投资策略（含公募REITs投资策略），并增加资产支持证券投资策略。

（九）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）变更申购费：申购金额大于等于500万元收取申购费率从“0%”变更为“1000元/笔”，其他不变。

（十一）变更律师事务所：将律师事务所由上海市通力律师事务所变更为广东广信君达律师事务所。

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。具体修订内容请阅附件五：《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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），本集合计划份额在此期间的赎回、转出不受六个月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.《广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的生效
赎回选择期结束后，管理人将根据份额持有人大会决议执行基金的正式变更，《广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的生效时间及重新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智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金份额。持有人可在广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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，广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）默认的收益分配方式为现金分红。

4.本集合计划将于《广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效日前进行份额折算，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。

附件四：广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金

（FOF）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）持有广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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）参加广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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：《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》修改前后条文对照表

章节	广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同	广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同
全文	广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划	广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）
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	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
第一部分 前言	<p>第一部分 前言</p> <p>一、订立本集合合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本集合合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》、《证券公司大集合资产管理</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》（以下简称“《指引》”）、《基金中基金估值业务指引（试行）》和其他有关法律法规。</p>

	<p>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》(以下简称“《操作指引》”)和其他有关法律法规。</p> <p>三、<u>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划</u>(以下简称“<u>集合计划</u>”或“<u>本集合计划</u>”)由<u>广发增强型基金优选集合资产管理计划</u>变更而来,广发增强型基金优选集合资产管理计划由管理人依照《基金法》等法律法规及中国证券监督管理委员会(以下简称“<u>中国证监会</u>”)的规定变更,并经<u>中国证监会</u>批准。</p> <p>中国证监会对<u>广发增强型基金优选集合资产管理计划</u>变更为本集合计划的批准,并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本集合计划没有风险。</p> <p>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集合计划财产,但不保证投资于本集合计划一定盈利,也不保证最低收益。</p> <p>.....</p>	<p>三、<u>广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金(FOF)</u>由<u>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划</u>变更而来,并经<u>中国证券监督管理委员会</u>(以下简称“<u>中国证监会</u>”)注册。</p> <p><u>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划</u>由<u>广发增强型基金优选集合资产管理计划</u>变更而来,广发增强型基金优选集合资产管理计划由<u>广发证券资产管理(广东)有限公司</u>依照《基金法》等法律法规及<u>中国证监会</u>的规定变更,并经<u>中国证监会</u>批准。</p> <p><u>中国证监会</u>对原集合计划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。</p> <p>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基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益,也不保证本金不受损失。</p> <p>.....</p> <p><u>七、本基金的投资范围</u>包括存托凭证,除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险,详见本基金招募说明书。<i>(新增,序号依次调整)</i></p> <p><u>九、红利再投资的基金份额的持有期起始日</u>,按原份额的持有期起始日计算。<i>(新增)</i></p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>第二部分 释义</p> <p>1、<u>集合计划或本集合计划</u>:指<u>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划</u></p> <p>2、<u>管理人</u>:指<u>广发证券资产管理(广东)有限公司</u></p>	<p>第二部分 释义</p> <p>1、<u>基金或本基金</u>:指<u>广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金(FOF)</u>,本基金由<u>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划</u>变更而来</p> <p>2、<u>基金管理人</u>:指<u>广发基金管理有限公司</u></p> <p>4、<u>基金中基金(FOF)</u>:指将80%以上的基金资产投资于经<u>中国证监会</u>依法核准或注册的公开募集的基金份额的基金</p> <p>5、<u>股票型基金</u>:指将80%以上的基金资产投资于股票的基金</p>

<p>15、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</p> <p>17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会</p> <p>21、合格境外机构投资者：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>22、人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和</p>	<p>6、债券型基金：指将80%以上的基金资产投资于债券的基金</p> <p>7、货币市场基金：指仅投资于货币市场工具的基金</p> <p>8、混合型基金：指投资于股票、债券、货币市场工具或其他基金份额，并且股票投资、债券投资、基金投资的比例不符合《运作办法》第四章第三十条第（一）项、第（二）项、第（四）项规定的基金（新增4-8项，序号依次调整）</p> <p>20、大集合产品、集合计划或集合资产管理计划：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</p> <p>22、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</p> <p>26、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</p> <p>27、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>30、销售机构：指广发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协议，办理基金销售业务的机构</p> <p>35、基金合同生效日：指《广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基</p>
--	---

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，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、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

26、销售机构：指广发证券资产管理（广东）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管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

31、集合合同生效日：指根据《操作指引》变更后的《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》生效日

32、集合合同终止日：指2025年6月30日，或者根据集合合同约定提前终止之日，中国证监会另有规定或要求的，按其规定或要求执行

33、存续期：指集合合同生效至终止之间的期限

39、《业务规则》：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、销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则

41、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，基金管理人有权暂停本基金的申购、赎回等业务，具体以届时公告为准）

45、巨额赎回：指本集合计划单个开放日，集合计划净赎回申请

金（FOF）基金合同》生效之日，原《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效

36、基金合同终止日：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

37、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

43、《业务规则》：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，以及基金管理人、销售机构等相关业务规则和实施细则

41、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若该工作日为非港股通交易日，基金管理人有权暂停本基金的申购、赎回等业务，具体以届时公告为准）

49、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%

54、基金份额净值：指计算日各类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额余额总数

55、基金份额累计净值：指计算日各类基金份额的基金份额净值加上该类基金份额累计分红

59、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回

	<p>(赎回申请份额总数加上<u>份额转换</u>中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及<u>份额转换</u>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%</p> <p>50、<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</p> <p>51、<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</p> <p>55、<u>流动性受限资产</u>:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p> <p>61、<u>锁定持有期</u>:对于每份集合计划份额,锁定持有期指集合计划份额申购确认日(包括持有<u>广发增强型基金优选集合资产管理计划</u>至本集合计划合同生效日的份额以及集合合同生效后的申购份额)起(即锁定持有期起始日),至集合计划份额申购确认日满6个月对日的前一日(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。若满6个月的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</p>	<p>购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、<u>资产支持证券</u>、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</p> <p>65、<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<u>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金(FOF)</u>集合资产管理计划至本基金合同生效日的份额以及基金合同生效后的申购份额)起(即锁定持有期起始日),至<u>基金份额</u>申购确认日满6个月对日的前一日(即锁定持有期到期日)之间的区间,基金份额在锁定持有期内不办理赎回业务。若满6个月的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</p> <p>……</p> <p><u>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,相关内容以修订后的法律法规为准。</u></p>
<p>第三部分 基金的基本情况</p>	<p>第三部分 <u>集合计划</u>的基本情况</p> <p>一、<u>集合计划名称</u></p> <p><u>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划</u></p> <p>二、<u>集合计划的类别</u></p> <p><u>混合型FOF集合资产管理计划</u></p> <p>五、<u>初始份额面值</u></p> <p><u>本集合计划初始份额面值为人民币1.00元。(删除,序号依次调</u></p>	<p>第三部分 <u>基金</u>的基本情况</p> <p>一、<u>基金名称</u></p> <p><u>广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金(FOF)</u></p> <p>二、<u>基金的类别</u></p> <p><u>混合型基金中基金(FOF)</u></p>

	<p>整)</p> <p>六、集合计划存续期限</p> <p>本集合计划自本集合合同变更生效日起存续期至2025年6月30日。 本集合计划自2025年6月30日后，按照中国证监会有关规定执行。</p>	<p>五、基金存续期限</p> <p>不定期。</p>
<p>第四部分 基金的历史沿革</p>	<p>第四部分 集合计划的历史沿革</p> <p>广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划由广发增强型基金优选集合资产管理计划变更而来。广发增强型基金优选集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于2007年1月10日经中国证券监督管理委员会（证监机构字【2007】5号）核准确认，于2007年2月9日成立，自2007年1月24日开始募集，并于2007年2月2日结束募集工作。</p> <p>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》，广发增强型基金优选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。</p> <p>经中国证监会批准，广发增强型基金优选集合资产管理计划变更为“广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划”，变更后的《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公告的生效之日起生效，《广发增强型基金优选集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革</p> <p>广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）由广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更而来。广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划由广发增强型基金优选集合资产管理计划变更而来。</p> <p>广发增强型基金优选集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于2007年1月10日经中国证券监督管理委员会（证监机构字【2007】5号）核准，自2007年1月24日开始募集，于2007年2月2日结束募集工作，并于2007年2月9日成立。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》，广发增强型基金优选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，变更为“广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划”。</p> <p>经中国证监会批准，广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更为“广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）”，基金管理人变更为“广发基金管理有限公司”。X年X月X日至X年X月X日，广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划召开持有人大会，会议审议通过了《关于广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更管理人并变更注册为广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）有关事项的议案》，同意本基金变更为“广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）”，基金管理人变更为“广发基金管理有限公司”，并变更存续期</p>

		<p>限、投资范围、投资限制、基金估值及其他事宜。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。</p> <p>自X年X月X日起，广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划变更为“广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）”，《广发智荟多元配置六个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》生效，原《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》失效。</p>
第五部分 基金的存续	<p>第五部分 集合计划的存续</p> <p>《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变更生效日起存续期至2025年6月30日。本集合计划自2025年6月30日后，按照中国证监会有关规定执行。如2025年6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。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	<p>第五部分 基金的存续</p> <p>《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，基金管理人应当在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。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>
第六部分 基金份额的申购与赎回	<p>第六部分 份额的申购与赎回</p> <p>一、集合计划的运作方式</p> <p>对于本集合计划每份集合计划份额设定锁定持有期，锁定持有期为6个月。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份集合计划份额自开放持有期首日起才能办理赎回业务。</p> <p>锁定持有期指集合计划份额申购确认日（包括持有广发增强型基金优选集合资产管理计划至本集合计划合同生效日的份额以及集合合同生效后的申购份额）起（即锁定持有期起始日），至集合计划份</p>	<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>一、基金的运作方式</p> <p>对于本基金每份基金份额设定锁定持有期，锁定持有期为6个月。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份基金份额自开放持有期首日起才能办理赎回业务。</p> <p>锁定持有期指基金份额申购确认日（包括持有广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划至本基金合同生效日的份额以及基金合同生效后的申购份额）起（即锁定持有期起始日），至基金份额申购确认日满6个月对日的前一日（即锁定持有期到期日）止，若满6个月的对日</p>

额申购确认日满6个月对日的前一日（即锁定持有期到期日）止，若满6个月的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。集合计划份额在锁定持有期内不办理赎回业务。

.....

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，并在管理人网站予以公示。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。

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基金份额的申购和赎回，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（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，基金管理人有权暂停本基金的申购、赎回等业务，具体以届时公告为准），但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。

.....

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人自集合合同生效之日起不超过3个月开始办理申购业务，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

管理人自集合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。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。如果投资人多次申购集合计划份额，则其持有的集合计划份额的赎回开放时间可能不同。

四、申购与赎回的原则

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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。

.....

二、申购和赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和其他销售机构。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基金份额的申购和赎回，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（若该工作日为非港股通交易日，基金管理人有权暂停本基金的申购、赎回等业务，具体以届时公告为准），但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。

.....

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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赎回开放时间可能不同。

五、申购与赎回的程序

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；份额登记机构确认份额时，申购生效。

份额持有人递交赎回申请，赎回成立；份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在T+10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集合合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本集合计划登记机构在T+3日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+4日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，管理人、托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

在法律法规允许的范围内，管理人或登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，管理人将于调整实施前按照有关规定予以公告。

七、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本集合计划 A 类份额、C 类份额分别设置代码，分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。本集合计划各类份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T日的各类份额净值在T+3日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算

四、申购与赎回的原则

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，但申请一旦被确认则不得撤销；

五、申购与赎回的程序

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请成立；本基金登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回申请成立；本基金登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T+10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基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+3日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+4日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不生效，则申购款项退还给投资人。

在法律法规允许的范围内，基金管理人或登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人将于调整实施前按照有关规定予以

或公告。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

7、占相当比例的被投资基金暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本集合计划单个开放日内的份额净赎回申请（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）超过前一工作日的集合计划总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当集合计划出现巨额赎回时，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（2）部分延期赎回：当管理人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集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日集合计划总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期

公告。

七、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金 A 类份额、C 类份额分别设置代码，分别计算和披露基金份额净值和基金份额累计净值。本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在T+3日内披露。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或披露。

8、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）

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

7、占相当比例的被投资基金暂停赎回或延缓支付赎回对价、暂停上市或二级市场交易停牌。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总

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份额；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，将自动转入下一个工作日继续赎回，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工作日赎回申请一并处理，无优先权并以下一工作日的该类别份额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。

若本集合计划发生巨额赎回且单个份额持有人的赎回申请超过上一工作日集合计划总份额20%的，管理人有权对该单个份额持有人超过该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个份额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，如管理人认为有必要，可暂停接受集合计划的赎回申请；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，并应当在规定媒介上进行公告。

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，管理人应在规定期限内在规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。

2、暂停结束，集合计划重新开放申购或赎回时，管理人应依照《信息披露办法》的有关规定，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个工作日的份额净值；如在暂停公告中已明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放公告。

十六、集合计划份额的冻结和解冻

集合计划登记机构只受理国家有权机关依法要求的份额的冻结与解

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份额；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，将自动转入下一个开放日继续赎回，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开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类别基金份额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。

若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额20%的，基金管理人有权对该单个基金份额持有人超过该比例的赎回申请实施延期办理，对该单个基金份额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个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；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，并应当在规定媒介上进行公告。

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，基金管理人应当在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

	<p>冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。</p>	<p><u>十六、基金份额的冻结、解冻与质押</u> <u>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。</u> <u>如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。</u></p> <p><u>十八、基金份额的折算</u> <u>基金份额折算是指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值。</u> <u>基金份额折算由基金管理人向登记结算机构申请办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。</u> <u>基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响的前提下，无需召开基金份额持有人大会审议。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记结算机构遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算。</u> <u>基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定公告，基金份额折算的具体安排详见相关公告。（新增，序号依次调整）</u></p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p>	<p>第七部分 集合合同当事人及权利义务</p> <p>一、管理人</p> <p><u>（一）管理人简况</u> <u>名称：广发证券资产管理（广东）有限公司</u> <u>住所：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-285</u> <u>法定代表人：秦力</u></p>	<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p> <p>一、基金管理人</p> <p><u>（一）基金管理人简况</u> <u>名称：广发基金管理有限公司</u> <u>住所：广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室</u> <u>法定代表人：葛长伟</u></p>

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、投资意向等。除《基金法》、《集合合同》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；

(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，序号依次调整）

二、托管人

(二) 托管人的权利与义务

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《集合合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(15) 依据《基金法》、《集合合同》及其他有关规定，召集份额持有人大会或配合份额持有人依法召集份额持有人大会；

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：

(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》、《基金合同》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，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；

二、基金托管人

(二) 基金托管人的权利与义务

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，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

	<p>(21) 执行生效的份额持有人大会的决定；</p> <p>三、份额持有人</p> <p>(7) 执行生效的份额持有人大会的决定；</p>	<p>提供的情况除外；</p> <p>(15) 依据《基金法》、<u>《基金合同》</u>及其他有关规定，召集<u>基金份额持有人大会</u>或配合<u>基金管理人、基金份额持有人</u>依法召集<u>基金份额持有人大会</u>；</p> <p>(21) 执行生效的<u>基金份额持有人大会的决议</u>；</p> <p>三、<u>基金份额持有人</u></p> <p>(7) 执行生效的<u>基金份额持有人大会的决议</u>；</p>
第八部分 基金份额持有人大会	<p>第八部分 份额持有人大会</p> <p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规、<u>集合合同</u>或中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开份额持有人大会：</p> <p>(1) <u>提前终止《集合合同》</u>；</p> <p>四、份额持有人出席会议的方式</p> <p><u>(5) 会议通知公告前按规定报中国证监会备案。(删除)</u></p>	<p>第八部分 <u>基金份额持有人大会</u></p> <p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规、<u>基金合同</u>或中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开<u>基金份额持有人大会</u>：</p> <p>(1) 终止<u>《基金合同》</u>；</p>
第八部分 基金份额持有人大会	<p><u>书面</u>表决意见</p> <p><u>书面</u>意见</p>	<p>表决意见</p> <p><u>书面</u>表决意见</p>
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	<p>第九部分 管理人、托管人的更换条件和程序</p> <p>一、管理人和托管人职责终止的情形</p> <p>(一) 管理人职责终止的情形</p> <p>有下列情形之一的，管理人职责终止：</p> <p>1、被依法取消<u>证券资产管理业务</u>管理资格；</p>	<p>第九部分 <u>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</u></p> <p>一、<u>基金管理人</u>和<u>基金托管人</u>职责终止的情形</p> <p>(一) <u>基金管理人</u>职责终止的情形</p> <p>有下列情形之一的，<u>基金管理人</u>职责终止：</p> <p>1、被依法取消<u>基金管理资格</u>；</p> <p><u>四、新任或临时基金管理人接收基金管理业务或新任或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原任基金管理人或原任基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。(新增)</u></p>
第十一部分	第十一部分 份额的登记	第十一部分 <u>基金份额</u> 的登记

<p>基金份额的登记</p>	<p>二、<u>集合计划</u>登记业务办理机构</p> <p>本<u>集合计划</u>的登记业务由管理人或管理人委托的其他符合条件的机构办理。管理人委托其他机构办理本<u>集合计划</u>登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确管理人和代理机构在投资者<u>集合计划</u>账户管理、份额登记、清算及<u>集合计划</u>交易确认、发放红利、建立并保管份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护份额持有人的合法权益。</p>	<p>二、<u>基金</u>登记业务办理机构</p> <p>本<u>基金</u>的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理，<u>但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除</u>。基金管理人委托其他机构办理本<u>基金</u>登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者<u>基金</u>账户管理、<u>基金份额</u>登记、清算及<u>基金</u>交易确认、发放红利、建立并保管<u>基金份额</u>持有人名册等事宜中的权利和义务，保护<u>基金份额</u>持有人的合法权益。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>第十二部分 <u>集合计划</u>的投资</p> <p>二、投资范围</p> <p>本<u>集合计划</u>的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括QDII基金、商品基金（含商品期货基金和黄金ETF）和香港互认基金，下同）、国内依法发行上市的股票及存托凭证（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、公开发行的次级债）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。</p> <p>本<u>集合计划</u>投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于<u>集合计划</u>资产的80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（<u>权益类资产比例不低于60%</u>）合计占<u>集合计划</u>资产的比例为20%-65%（本<u>集合计划</u>投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%）。本<u>集合计划</u>应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于<u>集合计划</u>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>如法律法规或监管机构以后允许<u>集合计划</u>投资其他品种或对投资比</p>	<p>第十二部分 <u>基金</u>的投资</p> <p>二、投资范围</p> <p>本<u>基金</u>的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括<u>公开募集基础设施证券投资基金</u>（以下简称“<u>公募REITs</u>”）、QDII基金、商品基金（含商品期货基金和黄金ETF）和香港互认基金，下同）、国内依法发行上市的股票及存托凭证（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、公开发行的次级债<u>以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具</u>）、<u>资产支持证券</u>、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。</p> <p>本<u>基金</u>投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于<u>基金</u>资产的80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（<u>基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产60%的混合型基金，或者根据基金披露的定期报告最近4个季度中任一季度股票投资占基金资产的比例均不低于60%的混合型基金</u>）合计占<u>基金</u>资产的比例为20%-65%（本<u>基金</u>投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%）。本<u>基金</u>应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于<u>基金</u>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>

例要求发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。

三、投资策略

2、基金投资策略

本集合计划将主要投资于证券投资基金，构建本集合计划的核心组合。基金投资具体策略如下：首先，根据晨星等第三方评级机构对基金的评级、风险调整后的收益（IR, Sharpe）、规模和流动性等一系列量化指标对基金进行初步筛选。然后，本集合计划将从定量和定性的角度对基金进行二次筛选，确定投资组合。

（1）定量分析：运用基金分析评价体系，对适选基金进行收益风险特征分析、业绩风格与行业归因分析、投资策略横向对比分析，再次精选基金，保证备选基金长期业绩显著战胜基准、投资风格不漂移且有能力在市场极端情况下控制回撤。对基金经理投资风格以及其适合和擅长的市场环境进行综合评价后确定核心基金经理和对应的基金池。主要指标包括：

1) 基金的表现分析(Performance Analysis)：分析并确认所投资基金绝对和相对收益表现，长期显著优于同类基金平均水平；采用长、中、短期相结合并兼顾基于市场状态划分的分析以考察基金经理业绩的稳定和持续性以及基金经理在各种市场特征中的表现。基于市场状态划分的业绩分析主要用来考察基金经理擅长的市场环境特征。收益性维度主要包含年化收益率、特定区间的滚动收益率、

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求发生变更，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

三、投资策略

2、基金投资策略

本基金管理人依托专业的研究力量，建立基金综合评价体系，力求从不同资产类别、不同风险收益特征以及不同风格的基金中精选出优质的基金品种，确定本基金的组合配置情况。

基金综合评价指标主要包含：基金业绩分析、基金绩效归因、定性调研分析等。

（1）通过对基金进行业绩分析，比较各类型基金在不同市场行情环境下的业绩表现情况，评估其收益风险特质。具体如下：

收益分析：如绝对收益率、超额收益率等；

风险分析：如年化波动率、最大回撤、相对最大回撤等；

风险调整后收益分析：如夏普比率、信息比率、索提诺比率等。

（2）通过对基金进行绩效归因，寻求基金的收益来源解释，分析其业绩稳定性和持续性，结合对未来市场的研判评估基金的投资价值。具体如下：

配置分析：如资产配置情况、行业配置情况等；

持仓分析：如重仓持股情况、重仓持债情况等；

交易分析：如持仓稳定性、换手情况等。

（3）在定量分析的基础上，本基金将通过对基金进行定性调研分析，对基金管理人和基金经理有一个更加深刻全面的认知。具体包括：基金管理人基本情况、投研团队稳定性、投资方法及投资理念等。

结合上述定量与定性分析，筛选出各类型基金中优质的基金品种进行配置。本基金将持续跟踪投资组合业绩，并基于基金综合评价指标，对投资组合进行动态调整和优化，力争实现基金资产的长期稳健资产增值。

（4）公募REITs投资策略

本基金可投资公募REITs。本基金将对公募REITs进行筛选和评估，综合考虑

相对业绩基准或市场指数的超额收益等细分指标。风险收益有效性维度主要包含：信息比率、夏普比率等细分指标。风险度指标主要包含年化标准差、跟踪误差等细分指标。回撤控制维度主要包含最大回撤绝对值以及与业绩基准或市场指数最大回撤的比较等指标。

2) 基金表现的归因分析(Attribution Analysis): 深入了解基金投资流程和分析管理人行业配置与选股能力; 将投资经理战胜基准的超额收益进行拆解, 计算各个行业与风格配置收益和个股选择收益, 确定投资经理所擅长投资领域、投资策略与交易模式。

3) 基金的风险分析(Risk Analysis): 确认基金总体投资风险水平适当可控, 对两种市场环境进行情景分析: 极端市场环境下的业绩下行风险, 对于温和市场环境下相对基准超额收益的明显波动。确保候选基金风险来源可识别、策略风险可预测。在本集合计划投资运作当中, 对所投基金底层持仓进行跟踪, 如所投底层资产出现风险事件, 需要与管理人进行沟通, 了解其是否及时处理并启动应急处理方案。

4) 基金的投资风格分析(Style Analysis): 确认基金的投资风格与其宣称的投资风格相符并长期保持一致。主要通过量化工具构建主流行业、风格投资策略库, 通过归因算法将基金收益-风险特征还原到底层策略维度上。同时在本集合计划投资运作当中, 定期对所投基金与其对应投资策略收益进行模式匹配, 对于明显偏离既定投资风格的基金, 需要及时与投资经理进行沟通。如其宣称策略与收益仍出现明显偏离, 本集合计划将进行相应调整。

(2) 定性分析精选基金: 通过对每只备选基金进行电话会议、正式拜访和对其主要客户的问卷调查, 在充分了解基金管理公司、基金产品和投资团队的基础上, 最终选择投研团队稳定、投研实力突出、风险内控制度完备和长期可查业绩良好的基金。

1) 基金公司(organization): 公司历史、规模和管理者, 股东结构、产品种类、竞争优势、主要客户和法律纠纷;

公募REITs 底层资产所属行业基本面、估值合理性、收益水平以及原始权益人行业地位和运营管理水平等因素, 对公募REITs的投资价值进行深入研究, 选择运营相对稳健、现金分派率或内部收益率相对合理的公募REITs进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化, 可选择将部分基金资产投资于公募REITs, 但本基金并非必然投资公募REITs。

2) 基金产品(fund information):成立时间、投资理念、费率水平、资产增长、客户分布状况和投资限制等。在同等条件下优选低费率基金产品；

3) 投资流程(Investment process):基金决策机制、业绩增长模式(依靠人员还是依靠流程)、投资人员和研究人员的权责划分、研究优势、信息来源和独立研究机构和卖方机构研究支持等；

4) 投资团队(Investment team):团队结构稳定性、成员职责和从业经历、团队的绩效评价体系和备选基金的基金经理管理其它基金的情况；

5) 风险控制(Risk control): 公司风控体系、流程、员工风险意识、风险事故汇报路径和重大事件的应急处理方案。

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) 本集合计划投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金(权益类资产比例不低于60%)合计占集合计划资产的比例为20%-65%；本集合计划投资于港股通标的股票

不超过股票资产的50%；

(3) 本集合计划管理人管理的全部基金中基金持有单只证券投资基金的比例不超过该被投资证券投资基金净资产的20%，被投资证券投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(4) 本集合计划不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额；

(9) 本集合计划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（不含证券投资基金，同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），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；（删除，序号依次调整）

6、资产支持证券投资策略

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。

（新增，序号依次调整）

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) 本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产60%的混合型基金，或者根据基金披露的定期报告最近4个季度中任一季度股票投资占基金资产的比例均不低于60%的混合型基金）合计占基金资产的比例为20%-65%；本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%；

(3) 除ETF联接基金外，本基金管理人管理的全部基金中基金持有单只证券投资基金的比例不超过该被投资证券投资基金净资产的20%，被投资证券投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(4) 本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，中国证监会另行规定的除外；

(9) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含证券投资基金，同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），不超过该证券

(12) 本集合计划管理人管理的全部开放式基金及大集合产品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%；本集合计划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；

因证券市场波动、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不符合上述第(2)、(3)项的，管理人应当在20个交易日内进行调整；除上述(7)、(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。

.....

2、禁止行为

(4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；(删除，序号依次调整)

五、业绩比较基准

沪深300指数收益率×20%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)×5%+中债总指数收益率×75%。

的10%；

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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%；

(14) 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%；

(15) 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；

(新增(11)-(15)项，序号依次调整)

(16) 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前述比例限制；

(22) 基金管理人运用基金中基金财产投资于股票、债券等金融工具的，投资品种和比例应当符合基金中基金的投资目标和投资策略；(新增，序号依次调整)

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(2)、(3)项的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整；除上述(2)、(3)、(7)、(15)、(17)、(18)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。

	<p>本集合计划A股的业绩基准采用市场通用的沪深300指数，沪深300指数选样科学客观，行业代表性好，流动性好，抗操纵性强，是目前市场比较有影响力的A股投资业绩比较基准。港股的业绩基准采用恒生指数，恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。固定收益部分的业绩基准则采用了市场上通用的中债总指数。如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，在对份额持有人无实质性不利影响的前提下，经管理人与托管人协商并取得托管人同意后，本集合计划可以变更业绩比较基准并及时公告，并在更新的招募说明书和产品资料概要中列示，按规定报中国证监会备案。</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本集合计划为混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>沪深300指数收益率×25%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%+中债-综合全价(总值)指数收益率×65%+银行活期存款利率(税后)×5%。</p> <p>本基金A股的业绩基准采用沪深300指数，沪深300指数是中证指数有限公司编制的，具有良好的市场代表性，是目前市场比较有影响力的A股投资业绩比较基准。港股的业绩基准采用恒生指数，恒生指数是由恒生指数有限公司编制，是目前市场比较有影响力的港股投资业绩比较基准。固定收益部分的业绩基准则采用了市场上通用的中债-综合全价(总值)指数。</p> <p>如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，基金管理人可以根据具体情况，经与基金托管人协商一致后可变更业绩比较基准，需履行适当程序并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>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推出，或者未来上述业绩比较基准不再适合、或有更加适合本基金的业绩比较基准时，基金管理人可以根据具体情况，经与基金托管人协商一致后可变更业绩比较基准，需履行适当程序并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金中基金（FOF），其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。</p> <p>.....</p>
第十四部分	第十四部分 集合计划资产估值	第十四部分 基金资产估值

<p>基金资产估值</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、对于未在交易所上市的证券投资基金的估值</p> <p><u>（1）本集合计划投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。若与本集合计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。</u></p> <p><u>（2）本集合计划投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。</u></p> <p>2、对于在交易所上市的证券投资基金的估值</p> <p><u>（1）本集合计划投资的交易型开放式指数基金（ETF），按所投资基金估值日的收盘价估值。</u></p> <p><u>（2）本集合计划投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值。</u></p> <p><u>（3）本集合计划投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。</u></p> <p><u>（4）本集合计划投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。</u></p> <p><u>（5）本集合计划投资的交易所交易型开放式指数基金（ETF）、境内上市开放式基金（LOF）、境内上市的其他开放式基金等提供二级市场交易方式和一级市场份额申购赎回方式的标的基金，可根据投资份额的计划退出方式选取合理的估值价格。</u></p> <p>3、对于证券投资基金特殊情况的估值处理</p> <p>如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，管理人根据以下原则进行估值：</p>	<p>四、估值方法</p> <p>本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：</p> <p>1、基金估值方法</p> <p><u>（1）非上市基金估值</u></p> <p><u>1）本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。</u></p> <p><u>2）本基金投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。</u></p> <p><u>（2）上市基金估值</u></p> <p><u>1）本基金投资的ETF基金、境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。</u></p> <p><u>2）本基金投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的基金份额净值估值。</u></p> <p><u>3）本基金投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。</u></p> <p><u>（3）如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，基金管理人根据以下原则进行估值：</u></p> <p><u>1）以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。</u></p> <p><u>2）以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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。</u></p> <p><u>3）如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位及份额分红金额、折算拆分比</u></p>
---------------	--	--

(1) 以所投资基金的份额净值估值的，若所投资基金与本集合计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值。

(2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的份额净值为基础或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) 若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

4、证券交易所上市的有价证券（不含证券投资基金）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) 港股通投资上市流通的股票按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币等主要货币对人民币汇率的，应当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。

(3) 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；

(4) 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

例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

当基金管理人认为本基金所投资基金按照上述第（1）-（3）项进行估值存在不公允时，应与基金托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。

2、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；

(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；

(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。

3、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：

(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；

(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；

(3) 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；

净价进行估值；

（5）交易所上市交易的可转换债券及实行全价交易的可交换债券，以估值日收盘价减去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，按最近交易日收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

交易所上市交易的实行净价交易的可交换债券，以估值日收盘价进行估值；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，按最近交易日收盘价进行估值。

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；

（6）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，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；

（7）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，估值技术无法计量的，按成本估值；

5、处于未上市期间的有价证券（不含证券投资基金）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；

（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；

（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支持的估值技术确定其公允价值。

4、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。

5、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。

6、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其它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。

7、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。

8、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。

9、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。

10、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。

11、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基

(3) 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。

6、本集合计划投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

7、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。

8、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。

9、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

10、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。

11、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

12、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。

13、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如管理人或托管人发现集合计划估值违反集合合同订明的估值方

金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

12、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

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，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。

法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，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，按照管理人对集合计划净值的计算结果对外予以公布。

五、估值程序

1、T日的各类集合计划份额净值不迟于T+3日内计算并披露。各类集合计划份额净值是按照每个估值日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。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。

八、集合计划净值的确认

用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个估值日后三个工作日内计算集合计划资产净值和各类份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人按规定予以公布。

五、估值程序

1、T日的各类基金份额净值不迟于T+3日内计算并披露。各类基金份额净值是按照每个估值日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额总数计算，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。

八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日后三个工作日内计算基金资产净值和

		<p>各类<u>基金份额净值</u>并发送给基金托管人。<u>基金托管人</u>对净值计算结果复核确认后发送给<u>基金管理人</u>，由<u>基金管理人</u>按规定予以公布。</p>
<p>第十五部分 基金的费用与 税收</p>	<p>第十五部分 <u>集合计划费用与税收</u> 一、<u>集合计划费用</u>的种类</p> <p>二、<u>集合计划费用</u>计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、<u>管理人的管理费</u> 管理人不得对<u>集合计划</u>财产中持有的自身管理的其他<u>集合资产管理计划</u>和<u>公开募集证券投资基金</u>的部分收取管理费。本<u>集合计划</u>的管理费按前一日<u>集合计划资产净值</u>的0.8%的年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.8\% \div 365$ H为每日应计提的<u>集合计划管理费</u> E为前一日的<u>集合计划资产净值</u>中扣除本<u>集合计划</u>持有的管理人自身管理的其他<u>集合资产管理计划</u>和<u>公开募集证券投资基金</u>所对应<u>资产净值</u>后的余额（若为负数，则取0）</p> <p>2、<u>托管人的托管费</u> 托管人不得对<u>集合计划</u>财产中持有的自身托管的其他<u>集合资产管理计划</u>和<u>公开募集证券投资基金</u>的部分收取托管费。本<u>集合计划</u>的托管费按前一日<u>集合计划资产净值</u>的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div 365$ H为每日应计提的<u>集合计划托管费</u> E为前一日的<u>集合计划资产净值</u>中扣除本<u>集合计划</u>持有的托管人自</p>	<p>第十五部分 <u>基金的费用与税收</u></p> <p>一、<u>基金费用</u>的种类</p> <p><u>本基金终止清算</u>时所发生费用，按实际支出额从<u>基金财产总值</u>中扣除。（<u>新增</u>）</p> <p>二、<u>基金费用</u>计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、<u>基金管理人的管理费</u> <u>基金管理人</u>不得对<u>基金财产</u>中持有的自身管理的其他<u>公开募集证券投资基金</u>的部分收取管理费。本<u>基金</u>的管理费按前一日<u>基金资产净值</u>中扣除本<u>基金</u>持有的<u>基金管理人</u>自身管理的其他<u>公开募集证券投资基金</u>所对应<u>资产净值</u>后的余额的0.8%的年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$ H为每日应计提的<u>基金管理费</u> E为前一日的<u>基金资产净值</u>中扣除本<u>基金</u>持有的<u>基金管理人</u>自身管理的其他<u>公开募集证券投资基金</u>所对应<u>资产净值</u>后的余额（若为负数，则取0）</p> <p>2、<u>基金托管人的托管费</u> <u>基金托管人</u>不得对<u>基金财产</u>中持有的自身托管的其他<u>公开募集证券投资基金</u>的部分收取托管费。本<u>基金</u>的托管费按前一日<u>基金资产净值</u>中扣除本<u>基金</u>持有的<u>基金托管人</u>自身托管的其他<u>公开募集证券投资基金</u>所对应<u>资产净值</u>后的余额的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ H为每日应计提的<u>基金托管费</u> E为前一日的<u>基金资产净值</u>中扣除本<u>基金</u>持有的<u>基金托管人</u>自身托管的其他<u>公开募集证券投资基金</u>所对应<u>资产净值</u>后的余额（若为负数，则取0）</p>

	<p>身托管的其他集合资产管理计划和公开募集证券投资基金所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）</p> <p>.....</p> <p>3、C类份额的销售服务费</p> <p>本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.4%。</p> <p>C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.4%的年费率计提，销售服务费计算方法如下：</p> $H = E \times 0.4\% \div 365$ <p>H 为C类份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E 为C类份额前一日集合计划资产净值</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>3、C类份额的销售服务费</p> <p>本基金A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.4%。</p> <p>C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.4%的年费率计提，销售服务费计算方法如下：</p> $H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为C类份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E 为C类份额前一日基金资产净值</p> <p>.....</p>
<p>第十六部分 基金的收益与分配</p>	<p>第十六部分 集合计划的收益与分配</p> <p>三、集合计划收益分配原则</p> <p>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；</p> <p>四、收益分配方案</p> <p>集合计划收益分配方案中应载明截至集合计划收益分配基准日的可供分配利润、集合计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比</p>	<p>第十六部分 基金的收益与分配</p> <p>三、基金收益分配原则</p> <p>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；</p> <p>.....</p> <p>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，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）</p> <p>四、收益分配方案</p> <p>基金收益分配方案中应载明截至基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额、分配方式等内容。</p>

	<p>例、分配方式等内容。</p>	
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>第十八部分 集合计划的信息披露</p> <p>五、公开披露的集合计划信息</p> <p><u>(二)《集合合同》生效公告</u></p> <p>管理人应当在规定媒介上登载《集合合同》生效公告。<i>(删除, 序号依次调整)</i></p> <p><u>(三) 集合计划净值信息</u></p> <p>《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规定网站披露一次各类集合计划份额净值和份额累计净值。</p> <p>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第3个工作日, 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份额净值和份额累计净值。</p> <p>管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的第3个工作日, 在规定网站披露半年度和年度最后一日的集合计划各类份额净值和份额累计净值。</p> <p><u>(十) 投资证券投资基金的信息披露</u></p> <p>管理人在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露所持基金以下情况:</p> <p><u>1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等;</u></p> <p><u>2、交易及持有基金产生的费用, 包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等;</u></p> <p><u>3、持有的基金发生的重大影响事件, 如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等;</u></p> <p><u>4、集合计划投资于管理人以及管理人关联方所管理基金或集合资产管理计划的情况;</u></p> <p>管理人应在定期报告中披露本集合计划参与基金的基金份额持有人大会的表决意见。</p>	<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p><u>(二) 基金净值信息</u></p> <p>《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。</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第3个工作日, 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。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的第3个工作日, 在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</p>

(删除, 序号依次调整)

(十二)管理人在招募说明书及定期报告等文件中应当设立专门章节披露所持基金以下情况, 并揭示相关风险。

- 1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等。
- 2、交易及持有基金产生的费用, 包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等, 招募说明书中应当列明计算方法并举例说明。
- 3、本集合计划持有的基金发生的重大影响事件, 如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等。
- 4、本集合计划投资于管理人以及管理人关联方所管理集合资产管理计划和基金的情况。

(十)基金管理人在招募说明书及定期报告等文件中应当设立专门章节披露所持基金以下情况, 并揭示相关风险。

- 1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等。
- 2、交易及持有基金产生的费用, 包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等, 招募说明书中应当列明计算方法并举例说明。
- 3、本基金持有的基金发生的重大影响事件, 如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等。
- 4、本基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。

基金管理人应在定期报告中披露本基金参与基金的基金份额持有人大会的表决意见。

(十三)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的资产支持证券明细。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, 序号依次调整)

		<p>六、信息披露事务管理</p> <p>.....</p> <p><u>基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。</u></p> <p><i>(新增)</i></p> <p>.....</p>
<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>第十九部分 集合合同的变更、终止与集合计划财产的清算</p> <p>一、《集合合同》的变更</p> <p>1、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，<u>并按规定报中国证监会备案。</u></p> <p>二、《集合合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合合同》应当终止：</p> <p>1、<u>《集合合同》期限届满的；</u></p> <p><i>(删除，序号依次调整)</i></p>	<p>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p> <p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经<u>基金份额持有人大会</u>决议通过的事项的，应召开<u>基金份额持有人大会</u>决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经<u>基金份额持有人大会</u>决议通过的事项，由基金管理人<u>和基金托管人</u>同意后变更并公告。</p>
<p>第二十部分 违约责任</p>	<p>第二十部分 违约责任</p> <p>一、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<u>集合计划财产</u>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<u>集合计划财产</u>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。管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给<u>集合计划财产</u>或委托人造成的损失</p>	<p>第二十部分 违约责任</p> <p>一、<u>基金管理人、基金托管人</u>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<u>基金财产</u>或者<u>基金份额持有人</u>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<u>基金财产</u>或者<u>基金份额持有人</u>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。<u>基金管理人或基金托管人</u>任一方不因另一方的失职行为而给<u>基金财产</u>或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。但是发生下列</p>

	向委托人承担连带责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：	情况之一的，当事人可以免责：
第二十一部分 争议的处理和 适用的法律	第二十一部分 争议的处理和适用的法律 《集合合同》受中国法律管辖。	第二十一部分 争议的处理和适用的法律 《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。
第二十二部分 基金合同的效 力	第二十二部分 集合合同的效力 《集合合同》是约定集合合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、《集合合同》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，并履行相应程序后生效，原《广发增强型基金优选集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 2、《集合合同》的有效期自本集合合同变更生效日起至2025年6月30日。本集合计划自2025年6月30日后，按照中国证监会有关规定执行。	第二十二部分 基金合同的效力 《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、《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《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）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《广发资管智荟广易六个月持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划资产管理合同》失效。 2、《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。
第二十四部分 基金合同内容 摘要		第二十四部分 基金合同内容摘要（新增章节） 一、基金合同当事人及权利义务 （一）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （1）依法募集资金； （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规独立运用并管理基金财产； （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用； （4）销售基金份额； （5）按照规定召集基金份额持有人大会； （6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部

门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

(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。

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；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(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净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(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》、《基金合同》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，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；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(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托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料20年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、

变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（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：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（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；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(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。

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：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和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；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，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；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料20年以上；
- (12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (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；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
- (三) 基金份额持有人
- 基金投资者持有本基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。
- 同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (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；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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》、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；
- (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；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。

(一) 召开事由

1、除法律法规、基金合同或中国证监会另有规定外，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：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费率，但法律法规要求调整该等报酬标准的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人或基金托管人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(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；

(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
 - (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，调低销售服务费率或调整基金份额类别设置；
 - (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
 - (4) 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) 基金管理人、登记机构、销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关申购、赎回、转换、交易、非交易过户、转托管等业务规则；
 - (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。
- (二) 会议召集人及召集方式
- 1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
 - 2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。
 - 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。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，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
 - 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。并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

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、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（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

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者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，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金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）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》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）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金

托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）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）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金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（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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，并与基金登记机构记录相符；

3、在法律法规或监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规或监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

(六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，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；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大

会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，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。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金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。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

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。

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金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的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、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；

7、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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）基金管理人代表本基金出席本基金持有的基金的基金份额持有人大会并参与表决的特别约定

本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时，基金管理人应当代表本基金基金份额持有人的利益参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

（十一）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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，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。

三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金所投资证券投资基金的分红收入、利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(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；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，再投资基金份额的持有期限与原持有基金份额相同（红利再投资取得的份额，其锁定持有期的起算日与原持有基金份额相同）；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配日的基金份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类和 C 类份额的费用收取方式存在不同，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别下每一基金份额享有同等分配权；

5、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，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。

(四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金管理人的管理费

基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的其他公开募集证券投资基金的部分收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金所对应资产净值后的余额的0.8%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（二）基金托管人的托管费

基金托管人不得对基金财产中持有的自身托管的其他公开募集证券投资基金

的部分收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金所对应资产净值后的余额的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（三）C类份额的销售服务费

本基金A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.4%。

C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.4%的年费率计提，销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

五、基金资产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募REITs”）、QDII基金、商品基金（含商品期货基金和黄金

ETF)和香港互认基金,下同)、国内依法发行上市的股票及存托凭证(含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、公开发行的次级债以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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)。

本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%,其中,股票、股票型基金、混合型基金(基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产60%的混合型基金,或者根据基金披露的定期报告最近4个季度中任一季度股票投资占基金资产的比例均不低于60%的混合型基金)合计占基金资产的比例为20%-65%(本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%)。本基金应当保持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、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求发生变更,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

(二) 投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%,其中,股票、股票型基金、混合型基金(基金合同中明确约定股票投资比例不低于基金资产60%的混合型基金,或者根据基金披露的定期报告最近4个季度中任一季度股票投资占基金资产的比例均不低于60%的混合型基金)合计占基金资产的比例为20%-65%;本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%;

(2) 本基金持有单只基金，其市值不高于本基金资产净值的20%，且不持有其他基金中基金；

(3) 除ETF联接基金外，本基金管理人管理的全部基金中基金持有单只证券投资基金的比例不超过该被投资证券投资基金净资产的20%，被投资证券投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(4) 本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，中国证监会另行规定的除外；

(5) 本基金投资的基金的运作期限应当不少于1年，最近定期报告披露的基金净资产应当不低于1亿元；

(6) 本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的比例不超过本基金资产净值的10%，但不包括ETF、LOF等可上市交易的基金；

(7) 本基金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；

(8) 本基金持有一家公司发行的证券（不含证券投资基金，同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），其市值不超过基金资产净值的10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含证券投资基金，同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），不超过该证券的10%；

(10) 本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；

(11) 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%；

(12) 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%；

(13) 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%；

(14) 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%；

（15）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；

（16）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前述比例限制；

（17）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；

（18）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本基金合同约定的投资范围保持一致；

（19）本基金投资于货币市场基金的比例不超过基金资产净值的15%；

（20）本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

（21）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；

（22）基金管理人运用基金中基金财产投资于股票、债券等金融工具的，投资品种和比例应当符合基金中基金的投资目标和投资策略；

（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。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第（2）、（3）项的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整；除上述（2）、（3）、（7）、（15）、（17）、（18）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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，但中国证监会认可或批准的特殊基金中基金除外；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金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。

法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后

的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人在履行适当程序后可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更。

六、基金净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（二）基金净值信息的公告方式

《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后的3个工作日内，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。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日后的3个工作日内，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或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。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，按规定报中国证监会备案，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；
2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
3、《基金合同》约定的其他情形；
4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、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。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
（3）对基金财产进行估值和变现；
（4）制作清算报告；
（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
（6）将清算报告按规定报中国证监会备案并公告；
（7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；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公告。基金财产清算小组应将基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

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。

八、争议的处理和适用的法律

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，应提交深圳国际仲裁院，根据该院当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳市，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。

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》规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

