

# 关于以通讯方式召开东方成长收益平衡混合型证券投资基金 基金份额持有人大会的第一次提示性公告

东方基金管理有限责任公司已于 2017 年 12 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及东方基金管理有限责任公司网站发布了《关于以通讯方式召开东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第一次提示性公告。

## 一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关法律法规的规定，以及《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，东方成长收益平衡混合型证券投资基金（以下简称“东方成长收益平衡”或“本基金”）的基金管理人东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开基金份额持有人大会。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2017 年 12 月 19 日起，至 2018 年 1 月 15 日 17:00 止（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）

3、会议通讯表决票的寄达地点：

公证机关：北京市长安公证处

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 6 号首创大厦 7 层

收件人：林永梅

电话：010-65543888-8014

邮政编码：100027

请在信封表面注明：“东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

## 二、会议审议事项

本次基金份额持有人大会拟审议的事项为《关于修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（详见附件一）。

对上述议案的说明及《基金合同》的详细修订内容请详见附件四《修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》。

## 三、基金份额持有人的权益登记日

本次基金份额持有人大会的权益登记日为 2017 年 12 月 18 日，即 2017 年 12 月 18 日下午交易时间结束后，在本基金登记机构登记在册的东方成长收益平衡的基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

## 四、表决票的填写和寄交方式

本次持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。纸质表决票的填写和寄交方式如下：

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印附件二或登录本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括居民第二代身份证及基金管理人认可的其他有效身份证件）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（或基金管理人认可的相关的业务专用章，下同），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）；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（包括居民第二代身份证及基金管理人认可的其他有效身份证件）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) 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代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2017年12月19日起，至2018年1月15日17:00以前（以基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本次基金份额持有人大会公证机关的办公地址，并在信封表面注明：“东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-628-5888（免长途话费）咨询。

## 五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

### 1、委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书，待申购申请确认后，授权委托书自动有效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以东方基金管理有限责任公司的登记为准。

### 2、受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和個人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

### 3、授权方式

本基金的基金份额持有人可以通过书面授权方式授权代理人代为行使表决权，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（www.orient-fund.com）等方式获取授权委托书样本。

（1）基金份额持有人进行书面授权所需提供的文件：

个人基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证件（包括居民第二代身份证及基金管理人认可的其他有效身份证件）正反面复印件。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括居民第二代身份证及基金管理人认可的其他有效身份证件）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人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）。

机构基金份额持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供该机构基金份额持有人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）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括居民第二代身份证及基金管理人认可的其他有效身份证件）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人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）。合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括居民第二代身份证及基金管理人认可的其他有效身份证件）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

(2) 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) 对基金管理人的书面授权文件的送达

基金份额持有人通过书面方式对基金管理人进行授权的，可通过邮寄、专人送达授权文件或在基金管理人柜台办理授权事宜。基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件送交基金管理人办公地点。

#### 4、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额存在多次有效书面方式授权的，以最后一次书面授权为准。不能确定最后一次书面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的书面授权为准；

(2) 如果同一基金份额在委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权代理人按照代理人意志行使表决权；

(3) 如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权代理人选择其中一种授权表示行使表决权；

(4) 如委托人既进行委托授权，又送达了有效表决票，则以有效表决票为准。

#### 5、对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为 2018 年 1 月 15 日 16:00。将书面授权委托书寄送或专人送达给基金管理人办公地点，授权时间以基金管理人收到时间为准。

## 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国邮政储蓄银行股份有限公司）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，并由公证机关对其计票过程予以公证并形成决议。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额

额总数。

(2) 如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(3) 如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入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，计入弃权表决票；

3) 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人委托的公证机关收到的时间为准。

## **七、决议生效条件**

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；

2、本次议案需经参加会议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；

3、本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人自决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

## **八、重新召集基金份额持有人大会及二次授权**

根据《基金合同》的约定，本次基金份额持有人大会需要出席大会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）方可举行。根据《基金法》的规定，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，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基

金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效,但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 九、本次大会相关机构

- 1、召集人(基金管理人):东方基金管理有限责任公司
- 2、基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
- 3、公证机关:北京市长安公证处
- 4、见证律师:上海市通力律师事务所

## 十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决票。

2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站([www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com))查阅,投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-628-5888(免长途话费)咨询。

3、本公告的有关内容由东方基金管理有限责任公司负责解释。

附件一:《关于修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》

附件二:《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三:《授权委托书》

附件四:《修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》

东方基金管理有限责任公司

2017年12月15日

附件一

**《关于修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》**

东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人：

东方成长收益平衡混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 5 月 11 日根据《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》的约定转型而来，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》等相关法律法规的规定以及《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与本基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致，本基金管理人提议修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金的投资范围、投资限制、投资策略、业绩比较基准、基金费率等内容，同时更名为“东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金”。

此外，根据中国证监会于 2017 年 8 月 31 日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关要求，本次修改将一并补充、调整《基金合同》相关内容。

修改《基金合同》的具体方案和程序可参见附件四《关于修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》。

为实施本基金上述《基金合同》修改方案，提议授权基金管理人办理本次基金合同修改的有关具体事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求和《修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》的有关内容对基金合同、托管协议及招募说明书进行修改。更新后的具体内容届时可详见本基金管理人网站的相关公告。

以上议案，请予以审议。



附件二

《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会 表决票			
基金份额持有人姓名/名称			
基金份额持有人证件号码 (身份证件号/营业执照号)			
基金账户			
受托人(代理人)姓名/名称			
受托人(代理人)证件号码 (身份证件号/营业执照号)			
审议事项表决			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》			
基金份额持有人/受托人(代理人) 签名或盖章			
年 月 日			

说明：

请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。基金份额持有人必须且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的（但其他各项符合会议通知规定）的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。签字/盖章部分不完整、不清晰的，将视为无效表决。

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。

附件三

授权委托书

兹授权\_\_\_\_\_代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2018 年 1 月 15 日的以通讯方式召开的东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。

上述授权有效期自本委托授权书签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

委托人身份证件号/营业执照号：\_\_\_\_\_

委托人基金账户：\_\_\_\_\_

受托人（代理人）（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

受托人（代理人）身份证件号/营业执照号：\_\_\_\_\_

委托日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

授权委托书填写注意事项：

- 1、授权委托书可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）等方式获取，在填写完整并签字盖章后均为有效；
- 2、委托人为机构的应当盖章，个人则为本人签字；
- 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。此处出现空白、多填、错填、无法识别等情况的，以上授权将被视为是持有人就其持有的本基金全部份额向代理人所做授权；
- 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。

## 附件四

### 《修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》

#### 一、重要提示

(一) 东方成长收益平衡混合型证券投资基金于 2017 年 5 月 11 日根据《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》的约定转型而来,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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关法律法规的规定以及《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》的约定,经与东方成长收益平衡混合型证券投资基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致,东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金管理人提议修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金的投资范围、投资限制、投资策略、业绩比较基准、基金费率等内容,同时更名为“东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金”(以下简称“本基金”)。本次修改还将根据《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》”)的相关要求补充、调整相关内容。

(二) 本次持有人大会议案需经参加本次持有人大会的基金份额持有人或代理人所持表决权的 50%以上(含 50%)通过,存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

(三) 基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,并自通过之日起五日内报中国证监会备案。中国证监会对本次持有人大会决议的备案,不代表其对本次转型方案或东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金的投资价值、市场前景或收益做出实质性判断或保证。

二、修改《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》的方案要点简述如下(详情请参见后附《基金合同》修订内容对照表):

#### (一) 修改基金名称

修改后的基金名称:东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金

#### (二) 在“释义”部分增加《流动性风险管理规定》的相关表述

“11.《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及不时作出的修订

54. 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、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

55. 摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待”

**（三）在“第六部分 基金份额的申购与赎回”部分补充《流动性风险管理规定》的相关要求，修改后的相关章节约定如下：**

“五、申购与赎回的数额限制

.....

4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

.....

六、申购费用和赎回费用

.....

3. 赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，其中对持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.50%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

.....

8. 当发生大额申购情形时，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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

七、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：

.....

6. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

.....

#### 八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

.....

5. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

.....

#### 九、巨额赎回的情形及处理方式

.....

##### 2. 巨额赎回的处理方式

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 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，投资者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。

(3) 如果基金发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请，可以进行延期办理。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。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人根据前段“（1）全部赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

(4) 本基金连续 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，并应当在至少一家指定媒介公告。

.....”

#### **（四）修改投资范围**

修改后的投资范围：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券、分离交易的可转换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、股指期货、国债期货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）。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。”

#### **（五）修改业绩比较基准**

修改后的业绩比较基准为：

沪深 300 指数收益率×30%+中债总全价指数收益率×70%

#### **（六）修改投资限制**

修改后的投资限制：

1. 本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%；

2. 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

3. 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
4. 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
5. 本基金管理人管理的全部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%；
6. 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本基金不符合本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
7. 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
8. 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%；
9. 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%；
10. 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%；
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. 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；
17. 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；
18. 基金参与股指期货合约或国债期货合约交易，应当遵守下列要求：



①在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

②本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；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 15%；

③本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；

④本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

19. 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关规定；

20. 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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。

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，除上述第 2、6、7、15 项外，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。

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或调整上述限制，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或按调整后的规定执行。

## （七）修改基金估值相关表述

1、修改后的“五、估值方法”补充“摆动定价”相关表述：

“7. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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。”

2、修改后的“七、暂停估值的情形”：

- “1. 与本基金投资有关的证券/期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定时，经与基金托管人协商一致的；
4. 中国证监会认定的其他情形。”

### （八）修改费率结构

修改《基金合同》之后，基金申购费率保持不变，拟调整基金管理费率、基金托管费率及基金赎回费率。具体调整如下：

1、基金管理费率

原基金管理费率：1.50%/年

调整后基金管理费率：1.30%/年

2、基金托管费率

原基金托管费率：0.25%/年

调整后基金托管费率：0.20%/年

3、申购费率（保持不变）

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.20%
100 万 ≤ M < 500 万	1.00%
M ≥ 500 万	每笔 1000 元

4、赎回费率

原赎回费率为：

持有时长	赎回费率	计入基金资产比例
7 日以内	1.50%	100%
7 日（含）-30 日	0.75%	100%
30 日（含）-3 个月	0.50%	75%
3 个月（含）-6 个月	0.50%	50%
6 个月（含）-1 年	0.50%	25%
1 年（含）-2 年	0.25%	25%
2 年以上（含）	0	0

调整后赎回费率为：

持有时长	赎回费率	计入基金资产比例
$T < 7$ 日	1.50%	100%
$7 \text{ 日} \leq T < 30$ 日	0.75%	100%
$30 \text{ 日} \leq T < 90$ 日	0.50%	75%
$90 \text{ 日} \leq T < 180$ 日	0.50%	50%
$T \geq 180$ 日	0.00%	0%

**(九) 在“第十八部分 基金的信息披露”补充相关内容:**

“4. 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，……。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

5. 临时报告

……

(25) 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(26) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值时；

……”

**三、《东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的生效**

自基金份额持有人大会表决通过之日的次一工作日起，原《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》失效，同时《东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

**四、《基金合同》修订内容对照表（详见下一页）**

#### 四、《基金合同》修订内容对照表

章节	《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》	《东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
第一部分 前言	<p>为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范东方成长收益平衡混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”或“《基金合同》”）。</p> <p>《基金合同》是规定《基金合同》当事人之间权利义务的基本法律文件，其他与本基金相关的涉及《基金合同》当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本基金合同为准。……</p> <p>本基金由东方保本混合型开放式证券投资基金转型而来。东方保本</p>	<p>为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称<u>《流动性风险管理规定》</u>）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”或“《基金合同》”）。</p> <p>《基金合同》是规定《基金合同》当事人之间权利义务的基本法律文件，其他与本基金相关的涉及《基金合同》当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，<u>如与基金合同有冲突</u>，均以本基金合同为准。……</p>

混合型开放式证券投资基金由基金管理人按照法律法规和《基金合同》的规定募集，并经中国证监会核准。中国证监会对东方保本混合型开放式证券投资基金募集的核准并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

《基金合同》应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法

东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金由东方成长收益平衡混合型证券投资基金变更注册而来，东方成长收益平衡混合型证券投资基金由基金管理人依照《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》约定由东方保本混合型开放式证券投资基金转型而来，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）备案。

中国证监会对本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，遵循基金投资“买者自负”的原则，全面认识产品风险收益特征和产品特征，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场和基金的投资价值，在对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

《基金合同》应当适用《基金法》及相应法律法规之规定，若因法

	<p>律法规的修改或更新导致《基金合同》的内容与届时有效的法律法规的规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。</p>	<p>律法规的修改或更新导致《基金合同》的内容与届时有效的法律法规的规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时作出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1. 基金或本基金：指东方成长收益平衡混合型证券投资基金</p> <p>4. 基金合同或本基金合同：指《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效的修订和补充</p> <p>6. 法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充</p> <p>12. 招募说明书：指《东方成长收益平衡混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新</p> <p>13. 托管协议：指基金管理人与基金托管人签订的《东方成长收益平衡混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充</p>	<p>1. 基金或本基金：指东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金</p> <p>4. 基金合同或本基金合同：指《东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效的修订和补充</p> <p>6. 法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章<u>及其他规范性文件及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等</u>以及对于该等法律法规的不时修改和补充</p> <p><b><u>11. 《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及不时作出的修订</u></b></p> <p>13. 招募说明书：指《东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新</p> <p>14. 托管协议：指基金管理人与基金托管人签订的《东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充</p>

<p>20. 注册登记业务：指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等</p> <p>21. 基金注册登记机构：指东方基金管理有限责任公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构</p> <p>25. 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构</p> <p>27. 基金合同生效日：指《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》生效日</p> <p>33. T日：指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日</p> <p>35. 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基</p>	<p><u>21. 登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容</u> <u>包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的</u> <u>确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和</u> <u>办理非交易过户等</u></p> <p><u>22. 登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东方基金</u> <u>管理有限责任公司或接受东方基金管理有限责任公司委托代为办理登记</u> <u>业务的机构</u></p> <p>26. 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的<b>机构投资者</b></p> <p>28. 基金合同生效日：指《东方成长收益<b>灵活配置</b>混合型证券投资基金基金合同》生效日</p> <p><u>29. 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，</u> <u>基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期</u></p> <p>35. T日：<u>指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务</u> <u>申请的开放日</u></p> <p>37. 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者<b>按基金合同和</b></p>
---	--

<p>金基金份额的行为</p> <p>36. 赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为</p> <p>37. 巨额赎回：指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形</p> <p>38. 基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户</p> <p>39. 交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户</p> <p>40. 转托管：基金份额持有人将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务</p> <p><del>50. 货币市场工具：指现金，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券，期限在一年以内（含一年）的债券回购；</del></p>	<p><u>招募说明书的规定</u> 申请购买本基金基金份额的行为</p> <p>38. 赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同<u>和招募说明书的规定</u>要求<u>将基金份额兑换为现金的行为</u></p> <p>39. 巨额赎回：指在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换入申请份额总数后的余额）超过上一<u>开放日</u>本基金总份额的 10% 时的情形</p> <p>40. 基金账户：指登记机构为基金投资者开立的记录其持有的、<u>基金管理人所管理的</u>基金份额余额及其变动情况的账户</p> <p>41. 交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管<u>及定期定额投资等</u>业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户</p> <p>42. 转托管：<u>指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作</u></p> <p>52. 指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它<u>媒介</u></p> <p><u>54. 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</u></p>
---	--



	<p>中央银行票据，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具</p> <p>51. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体</p>	<p><u>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、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</u></p> <p><u>55. 摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待</u></p>
第三部分 基金的基本情况	<p>（一）基金名称</p> <p>东方成长收益平衡混合型证券投资基金</p> <p>（四）基金的投资目标</p> <p>力争在股票、债券、现金等大类资产的适度平衡配置下，有效控制投资组合的风险，追求长期资本增值和稳定收益。</p>	<p>一、基金名称</p> <p>东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金</p> <p>四、基金的投资目标</p> <p>力争在股票、债券、现金等大类资产的<u>灵活配置</u>下，有效控制投资组合的风险，追求长期资本增值和稳定收益。</p>
第四部分 基金的历史沿革	<p>东方成长收益平衡混合型证券投资基金根据《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》的约定，由东方保本混合型开放式证券投资基金转型而来。</p> <p>东方保本混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方保本”）经</p>	<p><u>东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金由东方成长收益平衡混合型证券投资基金变更注册而来。</u></p> <p><u>根据《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》的约定，东方保本混合型开放式证券投资基金自 2017 年 5 月 11 日起转型为东方成</u></p>

	<p>2011年4月14日经中国证监会基金部函[2011]237号文核准生效，基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。东方保本为保本型基金，保本周期为三年。根据《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》的约定，于2014年5月5日起进入第二个保本周期，2017年5月5日为第二个保本周期到期日。</p> <p>由于东方保本在第二个保本周期届满后不再符合保本基金存续条件，根据《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》的约定，东方保本转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“东方成长收益平衡混合型证券投资基金”。</p> <p>东方保本第二个保本周期到期操作期间为2017年5月5日至2017年5月10日，自2017年5月11日起“东方保本”转型为“东方成长收益平衡混合型证券投资基金”，《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》及《东方成长收益平衡混合型证券投资基金托管协议》自该日起生效。</p>	<p><u>长收益平衡混合型证券投资基金，基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》于2017年5月11日起生效。</u></p> <p><u>2017年12月19日至2018年1月15日，东方成长收益平衡混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于修改东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，同意东方成长收益平衡混合型证券投资基金变更投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、基金费率等内容，修订基金合同与托管协议，并同意将东方成长收益平衡混合型证券投资基金更名为“东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。根据该持有人大会决议，自2018年XX月XX日起，《东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。</u></p>
<p>第五部分 基金的存续</p>		<p><u>一、基金份额的变更登记</u></p> <p><u>基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。</u></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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>	<p><b>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</b></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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p>
<p>第六部分 基金份额的 申购与赎回</p>	<p>(二) 申购与赎回的开放日及时间</p> <p>本基金的申购、赎回自《基金合同》生效后不超过 3 个月内开始办理，届时由基金管理人根据基金实际运作情况决定并在开始办理申购赎回的具体日期前 2 日在至少一家指定媒体公告。</p> <p>申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外）。根据对市场及可投资品种的判断，基金管理人保留不接受新申购资金的权利。投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告。</p> <p>若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日 2 日</p>	<p>二、申购与赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>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，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。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>

<p>前在至少一家指定媒体公告。</p> <p>(三) 申购与赎回的原则</p> <p>3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回，以确定所适用的赎回费率。对于由东方保本混合型开放式证券投资基金转型而来的基金份额，其持有期将从原份额取得之日起连续计算；</p> <p>5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。</p> <p>(四) 申购与赎回的程序</p> <p>2. 申购和赎回申请的确认</p> <p>T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1</p>	<p><b>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</b></p> <p><b><u>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。</u></b></p> <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回，以确定所适用的赎回费率。对于由<b>东方成长收益平衡混合型证券投资基金</b>变更注册而来的基金份额，其持有期将从原份额取得之日起连续计算；</p> <p>5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在至少一家<b>指定媒介</b>公告并报中国证监会备案。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2. 申购和赎回申请的确认</p> <p>T 日规定时间受理的申请，正常情况下，基金登记机构在 T+1 日内为</p>
--	---

<p>日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。</p> <p>基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。</p> <p>基金销售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以<u>注册</u>登记机构的确认结果为准。</p> <p>3. 申购和赎回的款项支付</p> <p>申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。</p> <p>投资者 T 日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。</p> <p>（五）申购与赎回的数额限制</p>	<p>投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者应向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。</p> <p>基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并按照《信息披露办法》的有关规定在<u>指定媒介</u>上公告并报中国证监会备案。</p> <p>基金销售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，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。<b><u>对于申请的确认情况，投资人应及时查询。</u></b></p> <p>3. 申购和赎回的款项支付</p> <p>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，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p>五、申购与赎回的数额限制</p>
--	---

<p>1. 基金管理人可以规定投资者首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额。具体规定请参见《招募说明书》；</p> <p>2. 基金管理人可以规定投资者每个交易账户的最低基金份额余额。具体规定请参见《招募说明书》；</p> <p>3. 基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》；</p> <p><del>4. 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额、赎回的份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额上限的数量限制，但基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。</del></p> <p>(六) 申购费用和赎回费用</p> <p>1. 本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由基金赎</p>	<p>1. 基金管理人可以规定投资者首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额。具体规定请参见《招募说明书》<u>或相关公告</u>；</p> <p>2. 基金管理人可以规定投资者每个交易账户的最低基金份额余额。具体规定请参见《招募说明书》<u>或相关公告</u>；</p> <p>3. 基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。具体规定请参见《招募说明书》<u>或相关公告</u>；</p> <p><b><u>4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告；</u></b></p> <p>5. 基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额、赎回的份额、最低基金份额余额和累计持有基金份额上限的数量限制，但基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家<u>指定媒介</u>公告并报中国证监会备案。</p> <p>六、申购费用和赎回费用</p> <p>1. 本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 日的基金份额净值</p>
---	--

<p>回人承担。</p> <p>2. 投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。</p> <p>3. 本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%。</p> <p>4. 本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒体公告。</p>	<p>在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>2. 申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按舍去尾数方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3. 赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，<b>其中对持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.50% 的赎回费并全额计入基金财产。</b>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4. 本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担。</p>
---	---

5. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或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相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

~~（七）申购份额与赎回金额的计算~~

~~1. 本基金申购份额的计算：~~

~~基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：~~

~~申购费用=申购金额/（1+申购费率）×申购费率~~

~~净申购金额=申购金额-申购费用~~

~~申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值~~

~~2. 本基金赎回金额的计算：~~

~~采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：~~

~~赎回费用=赎回份额×赎回当日基金份额净值×赎回费率~~

~~净赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值-赎回费用~~

5. 投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

6. 本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据《基金合同》的规定确定并在《招募说明书》中列示。基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒介公告。

7. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或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相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

**8. 当发生大额申购情形时，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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。**



	<p>3. 本基金基金份额净值的计算：—</p> <p>T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金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，由此产生的误差计入基金财产。—</p> <p>4. 申购份额、余额的处理方式：—</p> <p>申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，上述涉及基金份额、费用的计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍弃，舍弃部分归入基金财产；上述涉及金额的计算结果均按四舍五入法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。—</p> <p>5. 赎回金额的处理方式：—</p> <p>赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。—</p> <p>—(八) 申购和赎回的注册登记</p> <p>投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记</p>	
--	--	--

<p>权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。</p> <p>投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。</p> <p>基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的规定在至少一家指定媒体公告，并报中国证监会备案。</p> <p>（九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；</li> <li>2. 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；</li> <li>3. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；</li> <li>4. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持</li> </ol>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的申购申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；</li> <li>2. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请；</li> <li>3. 证券/期货交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；</li> <li>4. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或</li> </ol>
---	--

<p>有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；</p> <p>5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；</p> <p>发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停申购公告，并报中国证监会备案。</p> <p>（十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>1. 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；</p> <p>2. 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日</p>	<p>可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；</p> <p>5. 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形；</p> <p><b><u>6. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</u></b></p> <p>7. 基金管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。</p> <p>8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；</p> <p>发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述 1、2、3、4、<b><u>6、8</u></b> 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当在至少一家指定媒介刊登暂停申购公告，并报中国证监会备案。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式</p> <p>除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有</p>
---	--

<p>基金资产净值；</p> <p>3. 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；</p> <p>4. 发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；</p> <p>5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。</p> <p>同时，在出现上述第 3 款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体公告，并报中国证监会备案。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。</p> <p>暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体刊登暂停赎回公告，并报中国证监会备案。</p> <p>在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，</p>	<p>人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：</p> <p>1. 不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；</p> <p>2. 证券交易场所依法决定非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；</p> <p>3. 连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回；</p> <p>4. 出现继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，可暂停接受投资人的赎回申请；</p> <p><b><u>5. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</u></b></p> <p>6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生</p>
---	--

<p>并依照有关规定在至少一家指定媒体公告，并报中国证监会备案。</p> <p>(十一) 巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1. 巨额赎回的认定</p> <p>本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。</p> <p>2. 巨额赎回的处理方式</p> <p>当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申</p>	<p>的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。若出现上述第 3 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。</p> <p>暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒介刊登暂停赎回公告，并报中国证监会备案。</p> <p>在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒介公告，并报中国证监会备案。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1. 巨额赎回的认定</p> <p>本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换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%时，即认为发生了巨额赎回。</p> <p>2. 巨额赎回的处理方式</p> <p>当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> <p>(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申</p>
--	--

请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 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，投资者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。

(3) 如果基金发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请，可以进行延期办理。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。对

	<p>(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过至少一家指定媒体或销售机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。</p> <p>本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；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，并应当在至少一家指定媒体公告，并报中国证监会备案。</p>	<p>于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人根据前段“（1）全部赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。</p> <p><u>（4）本基金连续 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，并应当在至少一家指定媒介公告。</u></p> <p><u>3、</u>巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应在 2 日内通过至少一家指定媒介或销售机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。</p>
--	---	--

<p>(十二) 重新开放申购或赎回的公告</p> <p>如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。</p> <p>如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日内在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个开放日的基金份额净值。</p> <p>如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。</p> <p>(十三) 基金的转换</p> <p>为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以依照基金管理人的有关规定选择在本基金和基金管理人管理的其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体</p>	<p>十、重新开放申购或赎回的公告</p> <p>如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在至少一家指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。</p> <p>如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日内在至少一家指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。</p> <p>如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一家指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。</p> <p>十一、基金转换</p> <p>基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基</p>
---	--



<p>规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。</p> <p>（十四）转托管</p> <p>本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从销售机构转入另一个销售机构进行交易。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金销售机构的业务规则。</p> <p>（十五）定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。</p> <p>（十六）基金的非交易过户</p> <p>非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。</p> <p>基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份</p>	<p>金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。</p> <p>十二、基金的转托管</p> <p>基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。</p> <p>十三、定期定额投资计划</p> <p>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。</p> <p>十四、基金的非交易过户</p> <p>基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。</p> <p>继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性</p>
--	--

<p>额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体 的情形；“司法执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有 人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。 无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和《基金 合同》规定的持有本基金份额的投资者的条件。办理非交易过户必须提 供基金注册登记机构要求提供的相关资料。</p> <p>基金注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不 得办理该项业务。</p> <p>对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。</p> <p>（十七）基金的冻结与解冻</p> <p>基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金 份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的 权益一并冻结。</p>	<p>质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机关依据生效司法文书 将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他 组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对 于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登 记机构规定的标准收费。</p> <p>十五、基金份额的冻结与解冻</p> <p>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 金份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。基金份额 被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家 有权机关的要求以及登记机构业务规定来处理。</p> <p>十六、基金份额的转让</p> <p>在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额</p>
---	---

		<p>持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。</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>1. 基金管理人基本情况</p> <p>注册资本: 贰亿元人民币</p> <p>2. 基金管理人的权利</p> <p>(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构, 办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用, 按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;</p> <p>3. 基金管理人的义务</p> <p>(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;</p> <p>(25) 建立并保存基金份额持有人名册, 定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;</p> <p>2. 基金托管人的权利</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人基本情况</p> <p>注册资本: <u>叁</u>亿元人民币</p> <p><b><u>经营范围: 基金募集; 基金销售; 资产管理; 从事境外证券投资管理业务; 中国证监会许可的其他业务</u></b></p> <p>(二) 基金管理人的权利</p> <p>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, 按照基金合同规定对基金登记代理机构进行必要的监督和检查;</p> <p>(三) 基金管理人的义务</p> <p>24. 执行生效的基金份额持有人大会的<b><u>决议</u></b>;</p> <p>25. 建立并保存基金份额持有人名册;</p>

<p>(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；</p> <p>(三) 基金份额持有人</p> <p>基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额，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。</p> <p>1. 基金份额持有人的权利</p> <p>(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；</p> <p>(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；</p> <p>2. 基金份额持有人的义务</p> <p>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：</p>	<p>(二) 基金托管人的权利</p> <p>6. 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司、<u>银行间市场清算所股份有限公司</u>开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>基金投资者<u>持有</u>本基金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<u>自依据《基金合同》取得基金份额</u>，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。</p> <p>(一) 基金份额持有人的权利</p> <p>4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会<u>或者召集基金份额持有人大会；</u></p> <p>8. 对基金管理人、基金托管人、基金<u>服务</u>机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；</p> <p>(二) 基金份额持有人的义务</p> <p>根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人</p>
---	--

	<p>(1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；</p> <p>(2) 缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> <p>(3) 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；</p> <p>(4) 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；</p> <p>(5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、销售机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；</p> <p>(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；</p> <p>(7) 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。</p>	<p>的义务包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；</li> <li>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；</li> <li>3. 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；</li> <li>4. 缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</li> <li>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；</li> <li>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；</li> <li>7. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；</li> <li>8. 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；</li> <li>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。</li> </ol>
<p>第八部分 基金份额持 有人大会</p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>(一) 召开事由</p> <p>1. 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</p>	<p><b><u>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。</u></b>基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>一、召开事由</p> <p>1. 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</p>

<p>会：</p> <p>(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的持有人（以基金管理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；</p> <p>(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>2. 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率；</p> <p>(4) 《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；</p> <p>(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以外的其他情形。</p> <p>(二) 会议召集人及召集方式</p> <p>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</p>	<p>会：</p> <p>(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的<b>基金份额</b>持有人（以基金管理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；</p> <p>(12) 对基金<b>合同</b>当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；</p> <p>2. 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率<b>或变更收费方式</b>；</p> <p>(4) 《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<b>重大变化</b>；</p> <p>(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。</p> <p>二、会议召集人及召集方式</p> <p>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</p>
--	--

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。

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。

（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 40 天，在至少一家指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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。**

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 天**，在至少一家**指定媒介**公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

<p>2. 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式以及表决票的送达地址等内容。</p> <p>（四）基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。</p> <p>会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人、决定转换基金运作方式、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开。</p> <p>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：</p> <p>（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、身份证明、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证、身份证明、及委托人的代理投票授权委托符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有</p>	<p>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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式以及法律法规或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。</p> <p>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：</p> <p>（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；</p>
--	--



<p>基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；</p> <p>(2) 经核对，汇总到会者出示的在权利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 50% (含 50%)。</p> <p>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召集人约定的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人。通讯开会应以召集人约定的非现场方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>(1) 会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；</p> <p>(2) 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；</p> <p>(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 50% (含 50%)；</p>	<p>(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基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。</p> <p>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在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>(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；</p> <p>(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）到指定地点对书面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）</p>
--	---

<p>(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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符,并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定;</p> <p>(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。</p> <p>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;表面符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决,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。</p>	<p>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书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;</p> <p>(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,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);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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(含三分之一)以上基金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;</p> <p>(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。</p> <p>3. 在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场</p>
--	---

	<p>(五) 议事内容与程序</p> <p>1. 议事内容及提案权</p> <p>议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。</p> <p>基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额10%（含10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少35天前提交召集人并由召集人公告。</p> <p>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。</p> <p>召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日30天前公告。大会召集人</p>	<p>方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。</p> <p>4. 在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p> <p>五、议事内容与程序</p> <p>1. 议事内容及提案权</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--	---	--

应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。

<p>否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。</p> <p>2. 议事程序</p> <p>(1) 现场开会</p> <p>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, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。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。</p> <p>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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名 (或单位名称) 等事项。</p> <p>(2) 通讯开会</p> <p>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</p>	<p>2. 议事程序</p> <p>(1) 现场开会</p> <p>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二分之一以上 (含二分之一) 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。</p> <p>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。</p> <p>(2) 通讯开会</p> <p>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</p>
---	---

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

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，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，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。

~~基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。~~

#### （七）计票

##### 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。

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

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，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

##### 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

<p>如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序；如基金托管人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合，则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序；</p> <p>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。</p> <p>（八）生效与公告</p> <p>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。</p> <p>基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在至少一家指定媒体公告。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。</p>	<p>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。</p> <p>八、生效与公告</p> <p>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。</p> <p>基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在至少一家<b>指定媒介</b>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。</p>
--	--

		<p><u>九、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</u></p>
<p>第九部分 基金管理人、 基金托管人 的更换条件 和程序</p>	<p>(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>1. 基金管理人的更换程序</p> <p>(1) 提名: 新任基金管理人由基金托管人或由代表 10%以上(含 10%)基金份额的持有人提名;</p> <p>(3) 备案并公告: 基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内, 由大会召集人报中国证监会备案, 并应自决议生效后 2 日内在至少一种指定媒体上公告;</p> <p>(5) 审计并公告: 基金管理人职责终止的, 应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计, 并将审计结果予以公告, 同时报中国证监会备案;</p> <p>2. 基金托管人的更换程序</p> <p>(1) 提名: 新任基金托管人由基金管理人或由代表 10%以上(含 10%)基金份额的持有人提名;</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>1. 基金管理人的更换程序</p> <p>(1) 提名: 新任基金管理人由基金托管人或由代表 10%以上(含 10%)基金份额的<u>基金份额</u>持有人提名;</p> <p>(3) 备案并公告: 基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内, 由大会召集人报中国证监会备案, 并应自决议生效后 2 日内在至少一种<u>指定媒介</u>上公告;</p> <p>(5) 审计并公告: 基金管理人职责终止的, 应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计, 并将审计结果予以公告, 同时报中国证监会备案。<u>审计费用从基金财产中列支</u>;</p> <p>2. 基金托管人的更换程序</p> <p>(1) 提名: 新任基金托管人由基金管理人或由代表 10%以上(含 10%)基金份额的<u>基金份额</u>持有人提名;</p>



	<p>(3) 备案并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会备案，并应自决议生效后 2 日内在指定媒体上公告；</p> <p>(5) 审计并公告：基金托管人职责终止的，基金管理人应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。</p> <p>(三) 基金管理人与基金托管人的同时更换</p> <p>3. 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体上联合公告。</p>	<p>(3) 备案并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会备案，并应自决议生效后 2 日内在<u>指定媒介</u>上公告；</p> <p>(5) 审计并公告：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。<u>审计费用从基金财产中列支。</u></p> <p>三、基金管理人与基金托管人的同时更换</p> <p>3. 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在<u>指定媒介</u>上联合公告。</p>
第十部分 基金的托管	<p>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立《东方成长收益平衡混合型证券投资基金托管协议》。</p> <p>订立托管协议的目的是明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。</p>	<p>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立《东方成长收益<u>灵活配置</u>混合型证券投资基金托管协议》。</p> <p>订立托管协议的目的是明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。</p>
第十一部分	(一) 基金注册登记业务	一、基金份额的登记业务

<p>基金份额的 登记</p>	<p>本基金的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容 包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发 放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。</p> <p>(二) 基金注册登记业务办理机构</p> <p>本基金的注册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。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的， 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 基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、 建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额 持有人的合法权益。</p> <p>(三) 基金注册登记机构的权利</p> <p>基金注册登记机构享有以下权利：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 取得注册登记费；</li> <li>2. 建立和管理投资者基金账户；</li> <li>3. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册 等；</li> <li>4. 在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，</li> </ol>	<p>本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务， 具体内容 包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的 确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册 和办理非交易过户等。</p> <p>二、基金登记业务办理机构</p> <p>本基金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。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，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 基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建 立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额 持有人的合法权益。</p> <p>三、基金登记机构的权利</p> <p>基金登记机构享有以下权利：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 取得登记费；</li> <li>2. 建立和管理投资者基金账户；</li> <li>3. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册 等；</li> </ol>
---------------------	---	--

<p>并依照有关规定于开始实施前在至少一家指定媒体上公告；</p> <p>5. 法律法规规定的其他权利。</p> <p>（四）基金注册登记机构的义务</p> <p>基金注册登记机构承担以下义务：</p> <p>1. 配备足够的专业人员办理本基金份额的注册登记业务；</p> <p>2. 严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的注册登记业务；</p> <p>3. 妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；</p> <p>4. 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外；</p> <p>5. 按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；</p> <p>6. 接受基金管理人的监督（基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的）；</p>	<p>4. 在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在至少一家指定媒介上公告；</p> <p>5. 法律法规规定的其他权利。</p> <p>四、基金登记机构的义务</p> <p>基金登记机构承担以下义务：</p> <p>1. 配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；</p> <p>2. 严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；</p> <p>3. 妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；</p> <p>4. 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外；</p> <p>5. 按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；</p> <p>6. 接受基金管理人的监督（基金管理人委托其他机构办理本基金登</p>
---	--

	7. 法律法规规定的其他义务。	记业务的)； 7. 法律法规规定的其他义务。
第十二部分 基金的投资	<p>(一) 投资目标</p> <p>力争在股票、债券、现金等大类资产的适度平衡配置下，有效控制投资组合的风险，追求长期资本增值和稳定收益。</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，包括国内依法公开发行的债券（包括国债、央行票据、企业债、公司债、金融债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券及其他法律法规或中国证监会允许的债券类金融工具）、A 股股票（包含中小板和创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> <p>本基金各类资产的投资比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-80%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 20%-60%，其中，现金及到期日不超过 1 年的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人</p>	<p>一、投资目标</p> <p>力争在股票、债券、现金等大类资产的灵活配置下，有效控制投资组合的风险，追求长期资本增值和稳定收益。</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，包括国内依法公开发行的<u>股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券、分离交易的可转换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、股指期货、国债期货</u>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>如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，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>在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>(三) 投资理念</p> <p>通过挖掘具有成长潜力的上市公司股票，充分分享中国经济长期增长的成果；通过投资优质债券，获取稳定的投资回报。同时动态把握大类资产的适度配置，实现基金资产的长期稳定增长。</p> <p>(四) 业绩比较基准</p> <p>沪深 300 相对成长指数收益率×55%+中证全债指数收益率×45%。</p> <p>沪深 300 风格指数系列采用七个因子来衡量样本公司的成长和价值特征。其中衡量成长特征的因子有：过去 3 年主营业务收入增长率，过去 3 年净利润增长率和内部增长率；衡量价值特征的因子有：股息收益率、每股净资产与价格比率、每股净现金流与价格比率、每股收益与价格比率。沪深 300 相对成长指数以沪深 300 指数样本股为样本空间，样本股的市值按照一定的成长风格权重分配到相对成长指数中。该指数侧重成长性因子，进一步刻画了沪深 300 指数样本股的成长性，正体现了本基金的股票投资部分“通过挖掘具有成长潜力的上市公司股票，充分分享中国经济长期增长的成果”的投资理念，所以本基金选择沪深 300 相对成长指数作为股票投资部分的业绩比较基准。</p>	<p><b><u>基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</u></b></p> <p>三、业绩比较基准</p> <p>沪深 300 指数收益率×<b>30%</b>+中债总全价指数收益率×<b>70%</b>。</p> <p>本基金选择沪深 300 指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场 60%左右的市值，具有良好的市场代表性和可投资性。</p> <p>本基金选择中债总全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债总全价指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威，应用也最广的指数。中债总全价指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标的，反映债券市场的整体价格和投资回报情况。</p> <p>若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的</p>
---	--

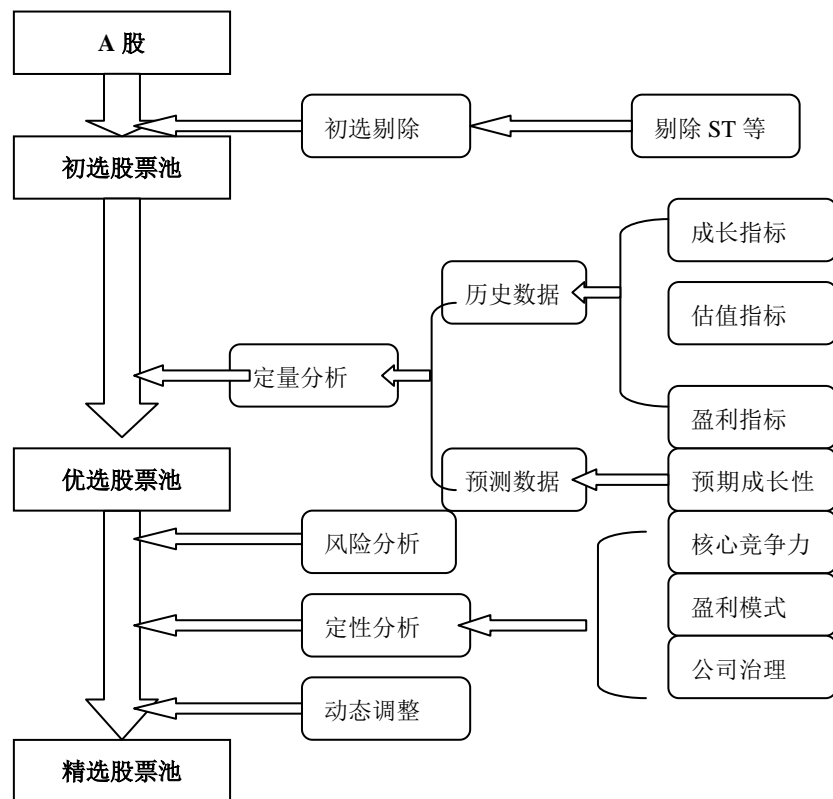
<p>如果指数编制单位停止计算编制指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，基金管理人经与基金托管人协商一致，履行相关程序并报中国证监会备案后，调整业绩比较基准并及时公告。</p> <p>（五）风险收益特征</p> <p>本基金属于混合型基金，为证券投资基金中的风险适中品种。长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>（六）投资策略</p> <p>本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业；结合定量筛选与定性分析，精选个股，以谋求超额收益。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金将从国际化视野审视中国经济发展的内外部环境，并根据宏</p>	<p>业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>五、风险收益特征</p> <p>本基金属于混合型基金，其预期收益及风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。</p> <p>六、投资策略</p> <p>本基金通过对类别资产的灵活配置，调整不同时期内基金的整体风险与收益水平，并结合多种投资策略精选具有较高投资价值的股票和债券，获得基金的长期稳定增值。</p> <p>1. 类别资产配置</p> <p>本基金根据各类资产的市场趋势和收益风险水平进行分析，对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整，采用多因素分析框架，综合考虑宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等进行基金的大类资产配置。</p>
---	---

<p>观经济所处的发展阶段，进行战略资产配置（SAA）；同时结合政策方向和市场情绪等指标，适时调整，进行灵活的战术资产配置（TAA）。</p> <p>具体而言，首先利用经济周期理论，在长期跟踪、研究分析各项宏观经济指标如工业增加值、CPI、PPI、货币供应量及利率等的基础上，对宏观经济的经济周期进行全局性的预测，判断经济周期的不同发展阶段的特点和目前所处阶段，并充分借鉴美林公司的投资时钟理论，在此基础上形成对不同类资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例；同时密切关注政策方向和市场情绪等指标，并结合各类证券风险收益特征的相对变化及时动态调整组合中各类资产的比例，以规避或分散市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置</p> <p>本基金管理人通过对宏观经济在不同阶段运行规律的深入研究发现，国民经济快速增长的背后蕴含了不同行业对 GDP 增长贡献率的巨大差异，也就是说，不同的行业因为受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。因此，通过对不同行业自身运行规律的的深入分析，把握投资节奏，可获得超</p>	<p>2. 股票投资策略</p> <p>本基金灵活运用多种投资策略，多维度分析股票的投资价值，充分挖掘市场中潜在的投资机会，实现基金的投资目标。其中，本基金综合运用行业配置及优化选股等策略，采用自上而下和自下而上相结合的分析框架，对行业成长性和企业成长性进行分析，进而把握个股的投资机会。</p> <p>（1）行业配置</p> <p>本基金采用自上而下和自下而上相结合的方式确定行业配置，在投资管理过程中，根据宏观经济运行形式及各行业自身运行特征对行业配置进行动态调整。</p> <p>自上而下的行业配置策略是指通过深入分析宏观经济运行指标和各行业自身周期性变化特征以及在国民经济发展中的地位等，确定具有投资价值的重点行业。</p> <p>自下而上的行业配置是指通过行业自身的景气分析、成长能力、盈利趋势、市场估值等因素确定重点投资的行业。</p> <p>（2）优化选股</p> <p>本基金管理人结合案头分析与上市公司实地调研，对列入研究范畴</p>
--	--

<p>额的收益。</p> <p>本基金行业配置在资产配置的基础上，遵循自上而下方式。具体方法是：基于全球视野下的产业周期的分析和判断本基金着眼于全球视野，遵循从全球到国内的分析思路，从对全球产业周期运行的大环境分析作为行业研究的出发点，再结合对国内宏观经济、产业政策、货币金融政策等经济环境的分析，从而判别国内各行业产业链传导的内在机制，并从中找出处于景气中的行业。在行业把握上，本基金进一步通过从宏观到行业再到行业内部的思路进行深入挖掘。</p> <p>a. 行业生命周期的分析</p> <p>对每一个行业，分析其所处生命周期阶段。本基金将重点投资处于成长期的行业，对这些行业给予相对较高估值；而对处于初始期的行业保持谨慎。某些行业虽然从大类行业看属于衰退性行业，但其中某些细分行业仍然处于成长期，具有较好的发展前景或较强的盈利能力，本基金将对这些细分行业的公司进行投资。对于国家扶持和经济转型中产生的行业成长机会也予以重点关注。</p> <p>b. 行业竞争结构的分析</p> <p>本基金重点通过迈克尔·波特的竞争理论考察各行业的竞争结构：</p>	<p>的股票进行全面系统地分析和评价，建立本基金的备选股票库。主要通过成长能力、盈利能力、估值水平、发展潜力等方面考察股票的投资可行性。</p> <p>①成长能力较强</p> <p>本基金认为，企业以往的成长性能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力，因此，本基金利用主营业务收入增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率指标来考量公司的历史成长性，作为判断公司未来成长性的依据。</p> <p>主营业务收入增长率是考察公司成长性最重要的指标，主营业务收入的增长所隐含的往往是企业市场份额的扩大，体现公司未来盈利潜力的提高，盈利稳定性的加大，公司未来持续成长能力的提升。本基金主要考察上市公司最新报告期的主营业务收入与上年同期的比较，并与同行业相比较。</p> <p>净利润是一个企业经营的最终成果，是衡量企业经营效益的主要指标，净利润的增长反映的是公司的盈利能力和盈利增长情况。本基金主要考察上市公司最新报告期的净利润与上年同期的比较，并与同行业相比较。</p>
---	---



<p>(a) 新进入者的威胁；(b) 供应商的议价能力；(c) 行业内部的竞争现状；(d) 替代品的威胁；(e) 购买者的议价能力等。本基金重点投资那些拥有特定垄断资源或具有不可替代性技术或资源优势，具有较高进入壁垒或者具有较强定价能力，具有核心竞争优势的行业。</p> <p>c. 行业轮动规律的分析</p> <p>通过市场及各个行业的相对和绝对估值水平 PE、PB 等数据的横向、纵向分析，进行估值比较，并跟踪各行业的资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力，动态把握行业板块轮换蕴涵的投资机会。</p> <p>(2) 个股选择</p> <p>根据本基金的“通过挖掘具有成长潜力的上市公司股票，充分分享中国经济长期增长的成果”的投资理念，在个股选择上，通过构建三级筛选模型来动态建立和维护精选股票池，通过层层筛选，以公司持续、健康的成长性为关注重点，同时将风险管理意识贯穿于投资全过程，对投资标的进行持续严格的跟踪和评估。具体如下图所示。</p> <p>图 14-2 股票三级筛选模型流程图</p>	<p>经营性现金流量反映的是公司的营运能力，体现了公司的偿债能力和抗风险能力。本基金主要考察上市公司最新报告期的经营性现金流量与上年同期的比较，并与同行业相比较。</p> <p>②盈利质量较高</p> <p>本基金利用总资产报酬率、净资产收益率、盈利现金比率（经营现金净流量/净利润）指标来考量公司的盈利能力和质量。</p> <p>总资产报酬率是反映企业资产综合利用效果的核心指标，也是衡量企业总资产盈利能力的重要指标；净资产收益率反映企业利用股东资本盈利的效率，净资产收益率较高且保持增长的公司，能为股东带来较高回报。本基金考察上市公司过去两年的总资产报酬率和净资产收益率，并与同行业平均水平进行比较。</p> <p>盈利现金比率，即经营现金净流量与净利润的比值，反映公司本期经营活动产生的现金净流量与净利润之间的比率关系。该比率越大，一般说明公司盈利质量就越高。本基金考察上市公司过去两年的盈利现金比率，并与同行业平均水平进行比较。</p> <p>此外，本基金还将关注上市公司盈利的构成、盈利的主要来源等，全面分析其盈利能力和质量。</p>
--	--



第一步、建立初级股票池，剔除明显不具备投资价值的个股

本基金管理人首先对 A 股市场中的所有股票进行初选剔除，以过滤掉明显不具备投资价值的股票，建立初选股票池，从而缩小研究范围，提高工作效率。剔除的股票包括法律法规和本基金管理人制度明确禁止

### ③未来增长潜力强

公司未来盈利增长的预期决定股票价格的变化。因此，在关注上市公司历史成长性的同时，本基金尤其关注其未来盈利的增长潜力。本基金将对上市公司未来一至三年的主营业务收入增长率、净利润增长率进行预测，并对其可能性进行判断。

### ④估值水平合理

本基金将根据上市公司所处的行业，采用市盈率、市净率等估值指标，对上市公司股票价值进行动态评估，分析该公司的股价是否处于合理的估值区间，以规避股票价值被过分高估所隐含的投资风险。

⑤本基金按以上标准建立备选股票库后，综合考察以下几个方面，构建核心股票池：

#### 1) 具有良好的公司治理，规范的内部管理

建立良好公司治理结构是公司高效、持续发展的基本保证，是衡量公司管理风险最重要的因素。管理层是否具备清晰的战略目标和有效的执行能力，以及是否具有专业素质和积极进取的执着精神，对公司的长期增长起到至关重要的作用；治理层对公司的战略方向以及管理层履行经营管理责任负有监督责任，治理层是否拥有足够的独立性，并切实履

<p>投资的股票、ST 和*ST 股票、筹码集中度高且流动性差的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等等。</p> <p>第二步、构建优选股票池，重点关注个股持续的成长能力</p> <p>在初级股票池的基础上，充分利用本基金管理人自主研发的多元量化选股模型，综合选择历史与未来预测两大类数据进入模型筛选程序，力求甄选出具有持续成长能力并相对估值较低，具有一定投资价值的个股，具体包括以下两方面：</p> <p>a. 历史数据的定量分析。主要选择从三方面历史数据进行定量分析，包括成长性指标、盈利指标和估值指标。模型中成长性指标主要有最近三年主营业务收入的增长率、最近三年净利润的增长率和内部增长率。考虑到构建优选股票池的主要目的就是筛选出具有成长潜力的个股，因此赋予成长性指标整体 40%的权重；在考虑公司成长性指标的同时，也充分认识到良好的盈利能力是公司高成长的源泉和动力，只有具备出色盈利能力的公司才具备了持续高成长所需的真实业绩的支撑，因此，选择最近三年净资产收益率、最近三年平均投资资本回报率等指标综合反映出公司盈利能力，并在模型中赋予 20%的权重；第三，估值指标，本基金选取了市盈率、市净率和市盈增长比率三个指标来考察公司的股价是否</p>	<p>行其指导监督的职责对公司的持久健康发展起到引领作用。因此，股东构成是否合理；董事会的构成及其权利义务是否明晰；公司是否建立了对管理层有效的激励和约束机制；公司是否重视中小股东利益的维护；管理层是否具有良好的诚信度；管理层是否稳定等等对于公司治理结构和内部管理的分析是判断上市公司未来可持续发展能力与潜力的关键。</p> <p>2) 高效灵活的经营机制</p> <p>本基金关注公司管理层对企业的长期发展是否有着明确的方向和清晰的经营思路及对未来经营中或将遇到的风险因素是否有足够的认识和完善的应对措施。公司经营管理的效率如何，是否能够根据市场变化及时调整经营策略；公司的营销机制是否灵活，是否具有较强的市场开拓能力；是否能够灵活利用技术创新、营销管理、成本控制、投融资管理、薪酬体系、战略合作等手段建立企业优势等。</p> <p>3) 具备一定竞争壁垒的核心竞争力</p> <p>本基金将重点观察这类企业是否拥有领先的核心技术，该核心技术是否具备一定的竞争壁垒；是否具备较强的自主研发能力和技术创新能力；未来公司主业的产品线是否存在进一步延伸的可能；是否在所属的细分行业已经拥有较高的市场份额、较为强大的品牌和良好的口碑等。</p>
---	---

<p>被低估，进而来判断具备成长性的个股是否也具有投资的价值，估值指标整体在模型中被赋予 20%的权重。</p> <p>b. 预测数据的定量分析。在该模型中，主要考察了预期公司未来成长性的指标，如预期主营收入增长率、预期净资产收益率、预期市盈率。用以补偿单纯使用以往历史数据无法全面反映公司成长性的不足，例如业绩刚刚开始出现明显提升的公司，在历史数据的筛选中就不会有很好的表现，但可能恰恰是具备未来巨大成长潜力的公司。预测数据整体在模型中被赋予 20%的权重。</p> <p>第三步、确定精选股票池，结合定性分析综合判断投资价值</p> <p>a. 定性分析 本基金管理人将充分利用机构投资者的研究优势，通过基金经理自身的具体分析和持续跟踪，并结合本基金管理人研究员的实地调研结论，定性分析优选股票池中公司的核心竞争力、盈利模式和公司治理情况等。具体包括如下几方面内容：</p> <p>是否拥有成熟、实用的商业模式，所提供的产品或服务具有广阔的市场前景；</p> <p>是否拥有独特的资源，如特许权、专有技术、品牌、网络等；</p> <p>是否主营业务竞争力突出，具备通过内生增长或低成本外延扩</p>	<p>这类企业虽然充分参与市场竞争，但因其具备某一项或某几项核心竞争力的突出优势，能维持业务稳定增长并有能力逐步巩固其行业地位。</p> <p>4) 符合经济转型下产业结构调整方向和国家产业发展政策</p> <p>微观个体经济的发展离不开宏观经济发展环境及发展趋势，在经济结构调整、产业升级的背景下，符合这一潮流的公司将具有更旺盛的生命力和更持久的发展潜力。因此，本基金还将重点关注上市公司的主营业务，是否符合经济结构调整方向；是否受益于国家产业发展政策等。</p> <p>经过上述筛选确定的股票池，将成为最终可投资的股票池，据此进行实际的股票投资。本基金管理人的指数与量化投资部风险绩效评估小组将定期对投资组合的行业偏离度等各项指标进行评估，作为基金经理调整投资组合的依据之一。</p> <p>3. 债券投资策略</p> <p>(1) 久期调整策略</p> <p>本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从</p>
---	---

<p>张实现跨越式发展的素质与综合潜力；</p> <p>是否注重创新，并通过创新引导、创造新的市场需求；</p> <p>是否企业经营稳定、理性，具有完善的公司治理结构，注重股东利益保护；</p> <p>是否财务稳健、现金流充沛。</p> <p>b. 动态调整 对于一类较特殊的股票，虽然没有表现出良好的成长性或盈利能力但由于内外部环境将要或已经发生了较大的变化，但目前阶段还没有得到资本市场的普遍关注，因此，各项预期指标也没有明显改善，但基金经理通过上市公司的实地调研和系统的研究分析判断，该类股票在未来会有较好的表现，可获得超额收益，则可将此类股票动态纳入成长股票池，作为成长股票池的补充部分。</p> <p>具体包括但不限于以下几种情形：</p> <p>由于国内外社会、经济、政治环境出现重大变化，企业业绩出现突发性增长，例如 SARS 和 H1N1 等流行性疾病的爆发可能会导致有关疫苗生产企业业绩突发性增长；</p> <p>由于地区或产业扶持政策的推出，企业业绩将出现突发性增长；</p> <p>由于并购、重组、资产注入等因素，企业业绩出现突发性增长。</p>	<p>而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以避免债券价格下降带来的资本损失，获得较高的再投资收益。</p> <p>(2) 期限结构策略</p> <p>在目标久期确定的基础上，本基金将通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期，调整组合的期限结构策略，适当的采取子弹策略、哑铃策略、梯式策略等，在短期、中期、长期债券间进行配置，以从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。当预期收益率曲线变陡时，采取子弹策略；当预期收益率曲线变平时，采取哑铃策略；当预期收益率曲线不变或平行移动时，采取梯形策略。</p> <p>(3) 类属资产配置策略</p> <p>本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平,通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析，在目标久期控制及期限结构配置基础上，采取积极投资策略，确定类属资产的最优配置比例。</p> <p>4. 权证投资策略</p>
--	---

<p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期管理策略</p> <p>通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，包括对央行的货币政策、国家财政政策的研究，以及对全球宏观经济的经济增长、通胀、利率的变动分析，预测未来国内市场利率走势可能的变化。结合基金的未来现金流，确定投资组合的目标久期。原则上，预期未来利率上升，可以通过缩短目标久期规避利率风险；相反，预期未来利率下降，则延长目标久期来获取债券价格上涨的超额收益。</p> <p>(2) 收益率曲线策略</p> <p>在目标久期确定的基础上，通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期，调整组合的期限结构策略（主要包括子弹式策略、哑铃式策略和梯式策略），在短期、中期、长期债券间进行配置，从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。其中，子弹式策略是使投资组合中债券的到期期限集中于收益率曲线的一点；哑铃式策略是将组合中债券的到期期限集中于两端；而梯式策略则是将债券到期期限进行均匀分布。</p> <p>(3) 相对价值策略</p> <p>相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银</p>	<p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型，深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化，寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎投资，追求较稳定的当期收益。</p> <p>5. 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>6. 股指期货投资策略</p> <p>本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>7. 国债期货的投资策略</p> <p>本基金对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为目的。结合</p>
---	--

<p>行间市场利差等。如果预计利差将缩小，可以卖出收益率较低的债券或通过买断式回购卖空收益率较低的债券，买入收益率较高的债券；反之亦然。</p> <p>(4) 骑乘策略</p> <p>通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，持有一定时间后，随着债券剩余期限的缩短，到期收益率将迅速下降，基金可获得较高的资本利得收入。</p> <p>(5) 信用类债券投资策略</p> <p>本基金根据对宏观经济运行周期的研究，综合分析公司债、企业债、短期融资券等发行人所处行业的发展前景和状况、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，对债券进行内部信用评级。内外部评级的差别与经济周期的变化、信用等级的升降都会造成利差的改变。本基金管理人将通过内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。</p> <p>(6) 可转换债券投资策略</p> <p>可转换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性，结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益固定的优势，并有利于从资产整</p>	<p>国债市场交易情况和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值操作，获取超额收益。</p> <p>七、投资限制</p> <p>(一) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>1. 本基金股票投资占基金资产的比例为 <b>0%—95%</b>；</p> <p>2. 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金 <b>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</b> 或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>3. 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>4. 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p><b>5. 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的可流通股</b> <b>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</b> <b>投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可</b> <b>流通股票的 30%；</b></p>
---	--

体配置上分散利率风险并提高收益水平。本基金将重点从可转换债券的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方面进行研究，充分发掘投资价值，以获取较高的投资收益。

#### 4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型，深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化，寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎投资，追求较稳定的当期收益。

#### （七）投资管理流程

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理流程。严格的投资管理流程可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

#### 1、研究

本基金的投资研究主要依托于基金管理人整体的研究平台，包括宏观、策略、个股、个券、定量研究等。通过自上而下对全球宏观形势、中国经济发展趋势的分析，以及自下而上对上市公司盈利能力、行业发

**6. 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本基金不符合本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；**

**7. 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；**

8. 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%；

9. 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%；

10. 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%；

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



<p>展趋势、市场估值水平等各方面的判断，对债券类属和股票行业的配置提出投资意见。</p> <p>2、资产配置决策</p> <p>投资决策委员会根据研究部对宏观经济指标和政策的分析研究成果，在本基金规定的各类资产风险敞口的限制范围内，制定战略资产配置决议；基金经理在战略资产配置决议的基础上，根据自己对未来一段时期内证券市场基本走势的判断，确定各大类资产的投资比例。</p> <p>投资决策委员会定期或不定期对基金的资产配置情况和相关投资策略进行审核评估，确保本基金投资目标的实现。</p> <p>3、组合构建</p> <p>在确定了大类资产的投资配置比例后，基金经理根据研究员提交的投资报告，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资决策委员会审批。</p> <p>4、交易执行</p> <p>交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产配置、个券投资比例以及个股投资比例等。</p> <p>5、风险与绩效评估</p>	<p>得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>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%；</p> <p>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；</p> <p>16. 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>17. 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；</p> <p><b><u>18. 基金参与股指期货合约或国债期货合约交易，应当遵守下列要求：</u></b></p> <p><b><u>①在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证</u></b></p>
---	---

<p>风险管理部定期对基金进行风险和绩效评估，并提供相关报告。风险报告使得投资决策委员会和基金经理能够随时了解组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略；绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。</p> <p>6、组合监控与调整</p> <p>相关部门将实时监控本基金的投资是否符合监管机构和本基金合同的规定，一旦某风险指标接近或超过风险限额，将对基金经理发出调整警告和责令其调整。基金经理将根据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回的现金流量情况，以及本基金的风险与绩效评估报告，对投资组合进行调整，使之不断得到优化。</p> <p>基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程作出调整。</p> <p>(八) 投资限制</p> <p>1、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：</p> <p>(1) 承销证券；</p>	<p><u>券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</u></p> <p><u>②本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；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 15%；</u></p> <p><u>③本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；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%；</u></p> <p><u>④本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；；</u></p> <p>19. 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例应当符合《基金合同》关于股票投资比例的有关规定；</p> <p>20. 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</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>(2) 向他人贷款或提供担保;</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资;</p> <p>(4) 买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;</p> <p>(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;</p> <p>(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他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;</p> <p>(7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;</p> <p>(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。</p> <p>如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。</p> <p>2、投资组合限制</p> <p>(1) 本基金持有的现金和到期日不超过 1 年的政府债券的比例,不得低于基金资产净值的 5%;</p> <p>(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发</p>	<p>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,除上述第 2、6、7、15 项外,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>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。</p> <p>法律法规或监管部门取消或调整上述限制,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或按调整后的规定执行。</p> <p>(二) 禁止行为</p> <p>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:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 承销证券;</li> <li>2. 违反规定向他人贷款或者提供担保;</li> <li>3. 从事承担无限责任的投资;</li> </ol>
--	---

<p>行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>（3）本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；</p> <p>（4）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；</p> <p>（5）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>（6）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>（7）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>（8）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。本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 个月内全部卖出；</p> <p>（9）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>（10）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基</p>	<p>4. 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>5. 向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>6. 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；</p> <p>7. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>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。</p> <p>法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按调整后的规定执行。</p>
--	--

	<p>金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>（11）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；</p> <p>（12）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p> <p>除上述（8）项另有约定外，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。本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定，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。</p> <p>《基金法》及其他有关法律法规或监管部门修改或取消上述限制的，履行适当程序后，本基金可相应调整投资组合限制的规定，不受上述限制</p>	
第十三部分	（一）基金资产总值	一、基金资产总值



	<p>报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。</p> <p>（四）基金财产的保管和处分</p> <p>本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。</p> <p>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。</p> <p>基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。</p>	<p>其他基金财产账户相独立。</p> <p>四、基金财产的保管和处分</p> <p>本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。</p> <p>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。</p> <p>基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。</p>
第十四部分	（三）估值对象	三、估值对象

<p>基金资产估值</p>	<p>基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项等资产和负债。</p> <p>(四) 估值程序</p> <p>基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人应于每个工作日对基金资产完成估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序复核无误后反馈于基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</p> <p>(五) 估值方法</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，采用第三方估值机构提供的价格确定公允价值。</p>	<p>基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、<u>同业存单、股指期货合约、国债期货合约、其它投资等</u>资产及负债。</p> <p>四、估值程序</p> <p>1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金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。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。</p> <p>五、估值方法</p> <p>3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券、<u>同业存单</u>等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的价格确定公允价值。</p> <p><u>5. 本基金投资股指期货合约、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未发生重</u></p>
---------------	---	---



<p>(六) 基金份额净值的确认和估值错误的处理</p> <p>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。由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通知基金托管人并报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通知基金托管人、公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。</p> <p>关于差错处理，本基金合同的当事人按照以下约定处理：</p> <p>1. 差错类型</p> <p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当</p>	<p><u>大变化的，采用最近交易日结算价估值。</u></p> <p><u>7. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，本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。</u></p> <p>六、基金份额净值的确认和估值错误的处理</p> <p>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。由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。<b><u>基金管理人</u></b><b><u>和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</u></b>当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通知基金托管人并报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通知基金托管人、公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。</p> <p>关于差错处理，本基金合同的当事人按照以下约定处理：</p> <p>1. 差错类型</p>
--	---

<p>事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。</p> <p>.....</p> <p>2. 差错处理原则</p> <p>（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。</p> <p>（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），</p>	<p>本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。</p> <p>.....</p> <p>2. 差错处理原则</p> <p>（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。</p> <p>（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。</p> <p>（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务，但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利</p>
--	---

则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

	<p>(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。</p> <p>3. 差错处理程序</p> <p>差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；</p> <p>(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；</p> <p>(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；</p> <p>(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应通知基金托管人并报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应通知基金托管人、公告，并报中国证监会备案。</p> <p>(七) 暂停估值的情形</p>	<p>3. 差错处理程序</p> <p>估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；</p> <p>(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；</p> <p>(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>七、暂停估值的情形</p>
--	---	--

	<p>1. 与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p>3. 中国证监会认定的其他情形。</p> <p>（八）特殊情形的处理</p> <p>1. 基金管理人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；</p> <p>2. 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>	<p>1. 与本基金投资有关的证券/期货交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2. 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；</p> <p><b><u>3. 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定时，经与基金托管人协商一致的；</u></b></p> <p>4. 中国证监会认定的其他情形。</p> <p>八、特殊情形的处理</p> <p>1. 基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理；</p> <p>2. 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。</p>
第十五部分	（一）基金费用的种类	一、基金费用的种类

<p>基金费用与 税收</p>	<p>4. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费；</p> <p>6. 基金的证券交易费用；</p> <p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1. 基金管理人的管理费</p> <p>在通常情况下，基金管理费每日按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>2. 基金托管人的托管费</p> <p>在通常情况下，基金托管费每日按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：</p>	<p>4. 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、<u>诉讼费</u>和<u>仲裁费</u>；</p> <p>6. 基金的证券、<u>期货</u>交易费用；</p> <p><u>8. 基金相关账户的开户费用、账户维护费用；</u></p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1. 基金管理人的管理费</p> <p>在通常情况下，基金管理费每日按前一日基金资产净值的 <u>1.30%</u> 年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times \underline{1.30\%} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费</p> <p>E 为前一日基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提，<u>逐日累计至每月月末</u>，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>2. 基金托管人的托管费</p> <p>在通常情况下，基金托管费每日按前一日基金资产净值的 <u>0.20%</u> 年费率计提。计算方法如下：</p>
---------------------	--	--

	<p><math>H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}</math>，本基金年托管费率为 <del>0.25%</del></p> <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p>E 为前一日基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</p>	<p><math>H = E \times \underline{0.20\%} \div \text{当年天数}</math></p> <p>H 为每日应计提的基金托管费</p> <p>E 为前一日基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提，<u>逐日累计至每月月末</u>，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。</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>2. 基金收益分配方式分为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按除权日的基金份额净值自动转为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；</p> <p>5. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>2. 基金收益分配方式分为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按除权日的基金份额净值自动转为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；<u>选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；</u></p> <p>5. <u>分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益</u></p>

	<p>日)的时间不得超过 15 个工作日;</p> <p>(五) 收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>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,在 2 日内在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。</p>	<p><u>登记日申请赎回的基金份额享受当次分红:</u></p> <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>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,在 2 日内在至少一家<u>指定媒介</u>公告并报中国证监会备案。</p> <p><u>基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日。</u></p>
第十七部分 基金的会计 与审计	<p>(二) 基金的年度审计</p> <p>1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p> <p>2. 会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意,并报中国证监会备案。</p> <p>3. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。</p>	<p>二、基金的年度审计</p> <p>1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p> <p>2. 会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。</p> <p>3. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在<u>指定媒介</u>公告并报中国证监会备案。</p>
第十八部分 基金的信息	<p>(二) 信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份</p>



<p>披露</p>	<p>额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。</p> <p>本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</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>1. 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议</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，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；基金管理人在公告</p>	<p>额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。</p> <p>本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</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>1. 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议</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，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在<u>指定媒介</u>上；基金管理人在公告</p>
-----------	--	---

<p>的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>.....</p> <p>2. 基金资产净值、基金份额净值</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公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在至少一家指定媒体上。</p> <p>4. 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度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90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。</p>	<p>的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。</p> <p>.....</p> <p>2. 基金资产净值、基金份额净值</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公告一次基金资产净值和基金份额净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在至少一家<u>指定媒介</u>上。</p> <p>4. 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度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90日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在<u>指定媒介</u>上。</p>
--	--

<p>基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有基金份额数比例超过基金份额总数 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险。</p>	<p>基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在<u>指定媒介</u>上。</p> <p>基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在<u>指定媒介</u>上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。</p> <p>基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。</p> <p><b><u>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></b></p> <p><b><u>本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露</u></b></p>
---	--

<p>5. 临时报告</p> <p>(19) 更换基金注册登记机构;</p> <p>(22) 本基金发生巨额赎回并延期支付;</p> <p>6. 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>7. 基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案,并予以公告。召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前 40 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。</p>	<p><u>基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u></p> <p>5. 临时报告</p> <p>(19) 更换基金登记机构;</p> <p>(22) 本基金发生巨额赎回并延期<u>办理</u>;</p> <p><u>(25) 发生涉及本基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;</u></p> <p><u>(26) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值时;</u></p> <p>6. 澄清公告</p> <p>在《基金合同》存续期限内,任何<u>公共媒介</u>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>7. 基金份额持有人大会决议</p> <p>基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报<u>中国证监会</u>备案,并予以公告。</p> <p>基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务</p>
---	---

	<p>基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。</p> <p>8. 中国证监会规定的其他信息。</p> <p>(六) 信息披露事务管理</p>	<p>的，召集人应当履行相关信息披露义务。</p> <p><b>8. 基金投资资产支持证券信息披露</b></p> <p><u>基金管理人应在基金年报及半年报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。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><b>9. 基金投资国债期货、股指期货的信息披露</b></p> <p><u>在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货、股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货、股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</u></p> <p>10. 中国证监会规定的其他信息。</p> <p>六、信息披露事务管理</p>
--	---	--

	<p>.....</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</p>	<p>.....</p> <p>基金管理人、基金托管人除依法在<u>指定媒介</u>披露信息外，还可以根据需要在其他<u>公共媒介</u>披露信息，但是其他<u>公共媒介</u>不得早于<u>指定媒介</u>披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。</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>2. 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效之日起2日内在至少一家指定媒体公告。</p> <p>(三) 基金财产的清算</p> <p>4. 基金财产清算程序：</p> <p>(1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；</p> <p>(7) 对基金财产进行分配。</p> <p>(六) 基金财产清算的公告</p> <p>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会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并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。</p>	<p>一、《基金合同》的变更</p> <p>2. 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效之日起2日内在<u>指定媒介</u>公告。</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>4. 基金财产清算程序：</p> <p>(1) 《基金合同》终止<u>情形出现时</u>，由基金财产清算小组统一接管基金；</p> <p>(7) 对基金<u>剩余</u>财产进行分配。</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>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会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于<u>基金财产清算报告</u>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。</p>

<p>第二十一部分 违约责任</p>	<p>(二) 基金管理人、基金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《基金合同》约定, 给基金财产或者基金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; 因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的, 应当承担连带赔偿责任。</p>	<p>二、基金管理人、基金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《基金合同》约定, 给基金财产或者基金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; 因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的, 应当承担连带赔偿责任。<u>对损失的赔偿, 仅限于直接损失。</u></p> <p><u>四、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现错误的, 由此造成基金财产或投资人损失, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</u></p>
<p>第二十二部分 争议的处理和适用的法律</p>	<p>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, 应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为北京, 仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力, 仲裁费由败诉方承担。</p> <p>《基金合同》受中国法律管辖。</p>	<p>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, 应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为北京, 仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力, 仲裁费由败诉方承担。</p> <p><u>争议处理期间, 基金合同当事人应恪守各自的职责, 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。</u></p> <p>《基金合同》受中国法律管辖。</p>

<p>第二十三部分 基金合同的效力</p>	<p>《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>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，并经中国证监会备案。</p>	<p>《基金合同》是约定基金<u>合同</u>当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>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<u>或盖章</u>。</p>
<p>第二十五部分 基金合同内容摘要</p>	<p>根据上述修订内容更新。</p>	