汇添富基金管理股份有限公司
关于以通讯方式召开汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

就汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金召开基金份额持有人大会事宜,汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)已分别于 2022 年 7 月 25 日和 7 月 26 日发布了《汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》和《汇添富基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开汇添富年年益定期开放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》,为使本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布关于召开汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

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》和《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)决定以通讯方式召开汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金份额持有人大会,会议的具体安排如下:

(一)会议召开方式:通讯方式

(二)会议投票表决起止时间:自 2022 年 8 月 12 日起,至 2022 年 8 月 31 日 17:00 止(投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准)。

(三)会议通讯表决票的送达地点:

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司

地址:上海市黄浦区外马路 728 号

邮政编码:200010

联系电话:(021)28932893

联系人:郭鑫

请在信封表面注明:“汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

二、会议审议事项

《关于汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型的议案》(见附件一)。

上述议案的内容说明见《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书》(见附件四)。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2022 年 8 月 11 日,即在该日交易所交易时间结束后,在本基金登记机构登记在册的汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

(一)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、复印表决票或登录基金管理人网站(http://www.99fund.com)下载并打印。

(二)基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

1、个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人有效身份证件正反面复印件;

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基金管理人认可的业务预留印鉴(以下合称“单位印章”),并提供加盖单位印章的营业执照复印件或其他基金管理人认可的相关证明文件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖单位印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单位印章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无单位印章),并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

3、个人投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供个人投资者有效身份证件正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(参照附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的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单位印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单位印章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

4、机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供机构投资者加盖单位印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单位印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,以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的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单位印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单位印章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

5、以上各项中的单位印章、批文、开户证明及登记证书等,以基金管理人的认可为准。

(三)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在自 2022 年 8 月 12 日起至 2022 年 8 月 31 日 17:00 止的期间内(以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至基金管理人的办公地址,并请在信封表面注明:“汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准,即:专人送达的以实际递交时间为准;快递送达的,以基金管理人签收时间为准;以邮寄挂号信方式送达的,以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

汇添富基金管理股份有限公司的办公地址及联系办法如下:

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司

地址:上海市黄浦区外马路 728 号

邮政编码:200010

联系电话:(021)28932893

联系人:郭鑫

(四)授权的确定原则

1、直接表决优先规则

如果基金份额持有人进行了授权委托,又自行出具了有效表决意见的,则以直接表决为有效表决,授权委托无效。

2、最后授权优先规则

如果同一基金份额持有人在不同时间多次进行有效授权,无论表决意见是否相同,均以最后一次授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次,不能确定最后一次授权的,按以下原则处理:若多次授权的表决意见一致的,按照该表决意见计票;若多次授权但授权意见不一致的或没有具体表决意见的,视为弃权票。

五、计票

(一)本次通讯会议的计票方式为:由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国建设银行股份有限公司)授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日(即 2022 年 8 月 31 日)后 2 个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金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。

(二)基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。基金份额持有人或其代理人应在表决票(见附件二)表决结果栏内勾选“同意”、“反对”或者“弃权”,同一议案只能表示一项意见。

(三)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,且在规定截止时间之内送达基金管理人的,为有效表决票;有效表决票按表决意见计入相应的表决结果,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾,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、如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在规定截止时间之内送达基金管理人的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4、基金份额持有人重复提交表决票的,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,以最后送达日所填写的有效的表决票为准,先送达的表决票视为被撤回;

(2)送达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计入弃权表决票;

(3)送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

六、决议生效条件

(一)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%);

(二)《关于汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型的议案》应当由提交有效表决票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;

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

(四)基金份额持有人大会表决通过的事项,将由本基金管理人在自通过之日起 5 日内报中国证监会备案,基金份额持有人大会决定的事项自持有人大会表决通过之日起生效。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定,本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%)方可举行。根据《基金法》及《基金合同》,如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,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,除非授权议件另有载明,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。

八、本次持有人大会相关机构

1、召集人(基金管理人):汇添富基金管理股份有限公司

2、基金托管人:中国建设银行股份有限公司

3、公证机关:上海市东方公证处

联系人:方慧静

联系电话:021-62154848

联系地址:上海市静安区凤阳路 598 号

4、见证律师:上海市通力律师事务所

九、重要提示

(一)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。

(二)基金管理人将在基金份额持有人大会召开前发布提示性公告,就基金份额持有人大会相关情况做必要说明,请予以留意。

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

(四)若本次基金份额持有人大会表决通过本基金的转型事宜,则基金管理人将在转型实施前预留不少于二十个交易日供基金份额持有人选择申购赎回。选择赎结束后,投资者未赎回的本基金 A 类基金份额/C 类基金份额将相应变更为汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金 A 类基金份额/C 类基金份额。无意继续持有转型后汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金基金份额的投资者请提前做好退出的相关安排。

(五)本公告的有关内容由汇添富基金管理股份有限公司解释。

汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 7 月 27 日

附件一:《关于汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型的议案》

附件二:《汇添富年年益定期开放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:《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书》

附件五:《汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金基金合同》

附件一:

关于汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型的议案

汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人:

为更好地满足广大投资者的投资需求,保护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,提议汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型为汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金。具体说明见附件四《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书》。

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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金管理人将在修订后的《汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金基金合同》正式生效前预留不少于二十个交易日供基金份额持有人做出选择,选择期间,本基金开放申购、赎回及转换等业务,具体时间安排详见基金管理人届时发布的相关公告。为避免歧义,提示投资者特别关注,本基金在选择期内不适用《基金合同》约定的“若在开放期最后一日本基金的份额持有人数量不满 200 人,或者在开放期最后一日基金资产净值加上当日申购的基金份额对应的资产净值减去当日赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元,基金合同将于次日进入终止清算程序,不需召开基金份额持有人大会”的自动终止安排。

选择期结束后,投资者未赎回的本基金 A 类基金份额/C 类基金份额将相应变更为汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金 A 类基金份额/C 类基金份额。

以上议案,请予审议。

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司

2022 年 7 月 27 日

附件二:

汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名/名称:

证件号码(身份证件/营业执照):

基金账户号:

审议事项	同意	反对	弃权
关于汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型的议案			

基金份额持有人/受托人签名或盖章

2022 年 月 日

说明:

1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应栏内画“√”,同一议案只能表示一项意见。

2、同一基金份额持有人拥有多个基金账户号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。此处出现空白、多填、错填、无法识别等情况的,将默认为代表此基金份额持有人持有的本基金所有份额。

3、如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾,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。

4、表决票中“证件号码(身份证件/营业执照)”仅指基金份额持有人持有本基金基金份额所使用的证件号码或该证件号码的更新。

5、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印。

附件三:

授权委托书

兹全权委托 先生/女士/公司单位代表本人或本机构参加投票截止日为 2022 年 8 月 31 日以通讯方式召开的汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并按照以下表决意见(同意/反对/弃权)代为行使所有议案的表决权。

若在规定时间内就同一议案重新召开汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会,除本人(或本机构)重新作出授权外,本授权继续有效。

委托人姓名或名称:

委托人证件号码(身份证件/营业执照):

委托人基金账户号:

受托人姓名或名称:

受托人证件号码(身份证件/营业执照):

委托人签字/盖章:

受托人签字/盖章:

签署日期:2022 年 月 日

说明:

1、页末签字栏中委托人为机构的应当于名称后加盖单位印章,个人则为本人签字。

2、同一基金份额持有人拥有多个基金账户号且需要按照不同账户持有基金份额分别进行授权的,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,将被默认为是持有人就其持有的本基金全部份额向受托人所做授权。

3、其他签字栏中请视情形选择填写,凡适合的栏目均请准确完整填写。

4、持有人多次有效授权,且能够区分先后次序的,以最后一次授权为准;持有人多次有效授权,无法区分授权次序的,按以下原则处理:若多次授权的表决意见一致的,按照该表决意见计票;若多次授权但授权意见不一致的或没有具体表决意见的,视为弃权票。

5、本授权委托书中“委托人证件号码(身份证件/营业执照)”仅指基金份额持有人持有本基金基金份额所使用的证件号码或该证件号码的更新。

6、授权委托书可剪报、复印或从相关网站下载,在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四:

汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型方案说明书

一、声明

1、为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(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》”)和《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定召开基金份额持有人大会,讨论并审议《关于汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型的议案》。

2、本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额达到权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%)方可举行,且《关于汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金转型的议案》需经参加本次持有人大会表决的基金份额持有人(或代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过,存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

3、持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的变更注册以及对本次持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见,均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、修改《基金合同》后产品方案要点

为更好地满足广大投资者的投资需求,提升产品生命力,我司经过认真细致全面的研究,拟对《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》中基金类型、运作方式、基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、投资限制、业绩比较基准、估值方法、基金费率等条款进行修改。主要修改内容如下:

(一)变更基金名称:由“汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金”变更为“汇添富双盈回报一年持有期债券型证券投资基金”。

(二)变更基金类型:由混合型证券投资基金变更为债券型证券投资基金。

(三)变更运作方式:由定期开放式变更为契约型开放式。本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期限,即基金份额注册登记之日(对基金合同生效前已经持有的份额而言)或基金份额申购确认日(对基金合同生效后申购的份额而言)至该日一年后的年度对日的期间内,投资者不能提出赎回申请;该日一年后的年度对日(含当日)之后,投资者可以提出赎回申请。若该日历年度实际不存在对应日期的,则顺延至该日历年度对应月份最后一日的下一工作日,若该对应日期为非工作日,则顺延至下一工作日。以红利再投资方式取得的基金份额的持有期则时间与投资者原持有的基金份额最短持有期到期时间一致,因多笔认购/申购导致原持有基金份额最短持有期到期时间不一致的,分别计算。

(四)变更投资目标:投资目标调整为:在保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值。

(五)变更投资范围:删除“中小板、中小企业私募债、权证、股指期货、股票期权”,增加“港股通标的股票、公开募集证券投资基金(不可投资于 QDII 基金、香港互认基金、货币市场基金、基金中基金、其他可投资基金的基金、非同一基金管理人管理的基金(境内股票型 ETF 除外)、同一基金经理管理的其他基金;对于上市基金,本基金仅投资于境内股票型 ETF;对于非上市基金,本基金仅投资于同一基金管理人旗下的股票型基金、偏股混合型基金。本基金所指偏股混合型基金包含以下两类:第一类是在基金合同中约定投资于股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例在 60%以上的混合型证券投资基金;第二类是过去最近 4 个季度定期报告中披露的股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例均在 60%以上的混合型证券投资基金)”。

(六)变更投资组合比例:由于基金类型及投资范围的变更,基金投资组合比例相应变更为:“本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票、股票型基金、偏股混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券的比例不超过基金资产的 20%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%);投资于证券投资基金的比例不超过基金资产净值的 10%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等”。

(七)变更投资策略:根据本基金基金类型和投资范围的变更,变更完善部分可投资标的的投资策略。变更后的投资策略包括:资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、基金投资策略等。

(八)调整投资限制:根据转型后的产品特点及可投资标的,基金投资限制条款相应调整为:

“(1)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票、股票型基金、偏股混合型基金等权益类资产及可交换债券和可转换债券的比例不超过基金资产的 20%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%);投资于证券投资基金的比例不超过基金资产净值的 10%;

(2)每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金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;

(3)本基金持有一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额),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(不含本基金所投资的基金份额),不超过该证券的 10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款限定的比例限制;

(5)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%;

(6)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(7)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(8)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券的规模的 10%;

(9)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;

(10)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(11)本基金参与国债期货交易,应当遵守下列要求:

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%;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%;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%;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(12)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

(13)本基金主动投资于流动性受限资产(含封闭运作基金、定期开放基金等)的市值合计不得超过本基金资产净值的 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;

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

(15)本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;

(16)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;

(17)本基金管理人管理的全部基金(ETF 联接基金除外)持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%,被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准;

(18)本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额;

(19)本基金投资其他基金时,被投资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;

(20)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(17)规定的投资比例的,基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第(2)、(13)、(14)、(17)情形之外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

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变更上述限制,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以变更以后的规定为准。”

(九)变更业绩比较基准:由“沪深 300 指数收益率 *20%+中债综合指数收益率 *80%”变更为“中债新综合财富(总值)指数收益率 *85%+沪深 300 指数收益率 *10%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%”。

(十)估值方法变更

1、变更估值对象,变更后,估值对象为:“基金所拥有的股票、债券、基金份额、国债期货台约、资产支持证券、银行存款本息、应收款项和其它投资等资产及负债。”

2、增加估值原则:

“基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

(一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(二)对不存在活跃市场的投资品种,应采用市场参与者用于估用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。”

3、变更相关估值对象的估值方法、流程和特殊情况处理:

“四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,最近交易日后经济环境未发生重大变化且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,确定公允价值。

(2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(本基金合同另有规定的除外),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;

(3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;

(4)对交易所上市交易的可转换债券,以每日收盘价作为估值全价;

(5)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所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,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

(3)对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计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整,确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则采用估值技术确定公允价值;

(4)在字时明确一定期期限售期的股票,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。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的,按债券或股票所处的市场分别估值。

5、基金投资同业存单,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。

6、国债期货合约以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

7、本基金持有的回购以成本列示,按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

8、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示,按相应利率逐日计提利息。

9、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。

10、当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、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进行。

12、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的,将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准:当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价,或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

13、证券投资基金的估值

(1)上市证券投资基金的估值

本基金投资的 ETF 基金,以其估值日收盘价估值。

(2)非上市证券投资基金的估值

本基金投资的境内非货币市场基金,以其估值日基金份额净值估值。

(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,本基金根据以下原则进行估值:

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,按其最新公布的基金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,以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;

3)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,本基金根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算折分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(4)当本基金管理人认为所投资基金按前述(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。

14、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。

五、估值程序

1、各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后,各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,均精确到 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申购、赎回等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。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值,并按规定公告。

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,将各类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,由基金管理人按约定对外公布。

六、估值错误的处理

基金管理人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。当任一类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,视为该类基金份额净值错误。

……

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(1)任一类基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案,同时进行公告。

(3)前述内容如法律法规或监管机构另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

七、暂停估值的情形

……

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;

……

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

九、特殊情况的处理方法

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因,或由于证券/期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等原因,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,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。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轻由此造成的影响。”

(十一)变更基金费用:

调整基金管理人的管理费、基金托管人的托管费、申购费率和赎回费率,具体如下:

1、管理费与托管费

(1)基金管理人的管理费

本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额(若为负数,则取 0)的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5%÷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扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额,若为负数,则取 0

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 5 个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

(2)基金托管人的托管费

本基金对基金财产