

长信基金管理有限责任公司

关于以通讯方式召开长信先锐债券型证券投资 基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

长信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）已于 2019 年 12 月 20 日、2019 年 12 月 23 日在指定网站披露了《长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信先锐债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信先锐债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》，为了使本基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布《长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开长信先锐债券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、会议基本情况

长信基金管理有限责任公司（以下简称“我公司”）管理的长信先锐债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]741 号文注册募集，并于 2016 年 6 月 2 日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，基金管理人经与本基金的基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于变更长信先锐债券型证券投资基金有关事项的议案》，并相应修改本基金的《长信先锐债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《长信先锐债券型证券投资基金托管协议》与《长信先锐债券型证券投资基金招募说明书》。

会议的具体安排如下：

（一）会议的召开方式：通讯方式。

（二）会议投票表决起止时间：自 2019 年 12 月 26 日 0:00 起至 2020 年 1 月 20 日 17:00 止（投票表决时间以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间或以基金管理人系统记录时间为准）。

(三) 会议通讯表决票将在公证机关的监督下统计。

二、会议审议事项

本次持有人大会审议的事项为《关于变更长信先锐债券型证券投资基金有关事项的议案》(以下简称“议案”，详见附件一)。

三、权益登记日

本次持有人大会的权益登记日为2019年12月25日，即在2019年12月25日在本基金登记机构登记在册的本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并表决。

四、投票方式

(一) 纸质投票(仅适用于机构投资者)

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载(<http://www.cxfund.com.cn/>)等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或相关经授权的业务专用章(以下合称“公章”)，并提供加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章)，并提供该授权代表的有效身份证件、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证券账户卡复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

3、基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构

代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件（详见附件二）以及本公告“五、授权（三）授权方式”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件等相关文件复印件。

4、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于会议投票表决起止时间内（自 2019 年 12 月 26 日 0:00 起至 2020 年 1 月 20 日 17:00 止，以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：周思萌

地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

联系电话：021-61009913

传真：021-61009917

邮政编码：200120

请在表决票或相关文件表面注明：“长信先锐债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

（二）网络投票（仅适用于个人投资者）

为方便基金份额持有人（个人投资者）参与大会投票，自 2019 年 12 月 26 日 0:00 起至 2020 年 1 月 20 日 17:00 以前（以基金管理人系统记录时间为准），基金管理人在官方网站设立投票专区，通过投票专区进行投票的基金份额持有人，应使用开户证件号码及登录密码进行登录，以核实基金份额持有人的身份，确保基金份额持有人的权益。

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见，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代为行使表决权。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：

（一）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

基金份额持有人大会的表决权。基金份额持有人委托他人投票，需向基金管理人提供授权委托书（授权委托书的格式见附件二）。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，授权委托书自动生效。

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全部基金份额数计算，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基金份额的数额，以登记机构的登记为准。

（二）受托人（代理人）

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个人，代为行使本次基金份额持有人大会的表决权。

为使基金份额持有人的权利得到有效行使，建议基金份额持有人委托本基金的基金管理人为受托人。基金管理人可发布临时公告向基金份额持有人建议增加受托人名单。

（三）授权方式

本基金份额持有人大会仅接受机构投资者以纸面授权的方式授权受托人代为行使表决权。

授权委托书的样本请见本公告附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（<http://www.cxfund.com.cn/>）下载等方式获取授权委托书样本。

1、机构投资者委托他人投票的，应由委托人在填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式见附件二）上加盖该机构公章，并提供该机构加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

2、授权效力确定规则

（1）如果同一委托人多次以有效纸面方式授权的，且能够区分授权次序的，

以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，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纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均为表示具体表决意见的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准，若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

(2) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权；

(3) 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，授权视为无效。

3、对基金管理人授权开始时间及截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的开始及截止时间为 2019 年 12 月 26 日 0:00 至 2020 年 1 月 20 日 17:00 时。将填妥的纸面授权委托书通过专人送交、邮寄或传真送达至基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。具体联系方式如下：

收件人：周思萌

地址：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

联系电话：021-61009913

传真：021-61009917

邮政编码：200120

六、计票

(一) 本次表决票的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(平安银行股份有限公司)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。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，且每份基金份额享有平等的表决权。

(三) 表决票效力的认定如下：

纸质表决票通过专人送交、邮寄或传真送达本公告规定的收件人的，表决时

间以收到时间为准；通过网络表决的，表决时间以系统记录时间为准。

1、纸面表决票的效力认定

(1) 纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在表决截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如纸面表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或互相矛盾，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) 纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或受托人经有效授权的证明文件的，或未能在投票截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(4) 基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

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

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，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准，传真的以本公告规定的收件人传真接收到的时间为准。

2、网络表决票的效力认定

(1) 网络投票的截止时间为 2020 年 1 月 20 日 17:00（以基金管理人系统记录时间为准）。

(2) 网络投票系统仅支持单次投票，基金份额持有人通过网络投票的结果无法修改，请持有人谨慎投票。

七、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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%);

(二)《关于变更长信先锐债券型证券投资基金有关事项的议案》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 50%以上(含 50%)通过;

(三)本次基金份额持有人大会决议通过的事项,将由本基金管理人自表决通过之日起五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表决通过之日起生效。

八、重新召集基金份额持有人大会及重新授权

如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未达到权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%),根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》相关规定,基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就本次大会审议的议案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,应当有代表权益登记日 1/3 以上(含 1/3)基金份额的基金份额持有人或其代理人参加,方可召开。重新召集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做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做出授权,则以最新方式或最新授权为准,详细说明见基金管理人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

(一)召集人:长信基金管理有限责任公司

客服专线:4007005566

联系人:周思萌

联系电话:021-61009913

传真：021-61009917

网址：<http://www.cxfund.com.cn>

电子邮件：service@cxfund.com.cn

（二）基金托管人：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

邮编：518048

联系人：高希泉

联系电话：0755-22197701

（三）公证机构：上海市普陀公证处

办公地址：上海市常德路 1211 号宝华大厦 11 层

邮编：200060

联系人：黄彦

联系电话：021-52562233-351

（四）律师事务所：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室

邮编：200120

联系人：姜亚萍

联系电话：021-51150298

十、重要提示

（一）请基金份额持有人在邮寄表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

（二）根据《中华人民共和国证券投资基金法》及本基金《基金合同》的规定，本次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，经出席基金份额持有人大会的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50%以上（含 50%）通过才能做出有效决议。

（三）上述基金份额持有人大会有关公告可通过长信基金管理有限责任公司

网站（<http://www.cxfund.com.cn>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电4007005566（免长话费）咨询。

（四）本公告的有关内容由长信基金管理有限责任公司解释。

附件一：《关于变更长信先锐债券型证券投资基金有关事项的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：长信先锐债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

特此公告。

长信基金管理有限责任公司

2019年12月24日

附件一：《关于变更长信先锐债券型证券投资基金有关事项的议案》**长信先锐债券型证券投资基金基金份额持有人：**

为更好地满足客户需求，保护基金份额持有人利益，我公司根据《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》的有关规定，提议召开基金份额持有人大会审议变更投资范围、投资比例、投资策略、业绩比较基准等相关事项，同时拟相应修改本基金法律文件的相关条款。经基金托管人平安银行股份有限公司及基金管理人长信基金管理有限责任公司协商一致，现拟对本次修改事项说明如下：

一、修改基金合同后产品方案要点

（一）基金名称：长信先锐混合型证券投资基金

（二）基金类型：混合型证券投资基金

（三）运作方式：契约型开放式

（四）基金存续期限：不定期

（五）投资目标：“通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。”

（六）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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、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、货币市场工具、国债期货、股指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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。”

（七）基金的投资组合比例为：“本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 40%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。本基金投资

于同业存单的比例不高于基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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。国债期货、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。”

（八）业绩比较基准：“中债综合指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。”

（九）风险收益特征：“本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。”

（十）基金费率：

1、申购费用

“本基金 A 类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用；C 类基金份额不收取申购费。本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户及除养老金客户之外的其他投资者申购两类基金份额的申购费率如下（场内外申购费率相同）：

| 基金份额 | 申购金额（M，含申购费） | 非养老金客户申购费率 | 养老金客户申购费率 |
|-------|---------------|------------|-----------|
| A 类份额 | M<100 万 | 0.8% | 0.04% |
| | 100 万≤M<500 万 | 0.5% | 0.025% |
| | M≥500 万 | 每笔 1000 元 | 每笔 1000 元 |
| C 类份额 | | 0 | |

注：M 为申购金额

投资本基金的养老金客户，在本公司直销中心办理账户认证手续后，即可享受上述特定费率。未在本公司直销中心办理账户认证手续的养老金客户，不享受上述特定费率。

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。”

2、赎回费用

“本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，场内场外赎回具体费率如下：

| 基金份额 | 持有期限 (Y) | 赎回费率 |
|-------|------------------------------|--------|
| A 类份额 | $Y < 7$ 天 | 1.5% |
| | $7 \text{ 天} \leq Y < 30$ 天 | 0.75% |
| | $30 \text{ 天} \leq Y < 6$ 个月 | 0.5% |
| | $6 \text{ 个月} \leq Y < 1$ 年 | 0.125% |
| | $Y \geq 1$ 年 | 0 |
| C 类份额 | $Y < 7$ 天 | 1.5% |
| | $7 \text{ 天} \leq Y < 30$ 天 | 0.5% |
| | $Y \geq 30$ 天 | 0 |

注：Y 为持有期限

对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。”

3、管理费和托管费

“本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。”

4、基金销售服务费

“本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。”

(十一) 申购和赎回的数量限制：

“1、投资人通过场外办理本基金申购时，首次申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费，下同），追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元；超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资人通过本公司直销柜台及网上直销平台申购本基金遵循上述规则；各代销机构有不同规定的，投资人在该代销机构办理申购业务时，需同时遵循该代销机构的相关规定。

2、投资人通过上海证券交易所场内申购时，每笔申购金额最低为人民币 100 元，同时每笔申购必须是 100 元的整数倍。

3、投资人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

4、基金份额持有人在销售机构赎回本基金单笔赎回申请不得低于 1 份基金份额，且通过场内单笔申请赎回的本基金基金份额必须是整数份；基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）单个交易账户保留的基金份额余额不足 1 份的，余额部分基金份额在赎回时需同时全部赎回。

5、本基金可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限、单笔/单日申购金额上限、本基金总规模上限，具体以基金管理人的届时公告为准。

6、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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

7、基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人利益无实质影响的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。”

（十二）申购份额与赎回金额的计算：

“1、申购份额、余额的处理方式：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，以申请当日基金份额净值为基准计算，场外申购份额按四舍五入保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；场内申购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给基金投资者。

2、赎回金额的处理方式：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。

3、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，本基金的申购份额计算公式为：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值”

(十三) 收益分配: “本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配, 具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。”

(十四) 税收: “本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收, 由基金份额持有人承担, 基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。”

本次基金合同的具体修改内容详见下文《基金合同修改前后文对照表》。

二、本基金招募说明书及托管协议等文件将根据上述修改同步进行相应调整。

为实现基金变更的平稳过渡, 本基金管理人已就基金变更有关的会计处理、注册登记、系统准备方面进行了深入研究, 做好了基金运作的相关准备。

此外, 若本议案能够审议通过, 本基金转型后最终披露的法律文件将同时根据最新发布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》进行相应更新, 更新所涉及的内容对基金份额持有人的利益不会产生实质性不利影响, 具体内容届时请参见生效后的法律文件。

本议案审议通过的上述事项, 将于本公司发布基金份额持有人大会决议生效公告之日起实施。变更后的《长信先锐混合型证券投资基金基金合同》自同日起生效。

以上议案, 请予审议。

基金管理人: 长信基金管理有限责任公司

2019 年 12 月 24 日

《基金合同修改前后文对照表》

| 章节 | 原《长信先锐债券型证券投资基金基金合同》 版本 | 修订后《长信先锐混合型证券投资基金基金合同（草案）》版本 |
|--------|---|--|
| | 内容 | 内容 |
| 基金名称 | 长信先锐 债券型 证券投资基金 | 长信先锐 混合型 证券投资基金 |
| 第一部分前言 | <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》”)、《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》”)和其他有关法律、法规。</p> | <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《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》”)、<u>《证券投资基金经营机构参与内地与香港股票市场交易互联互通指引》(以下简称“《港股通指引》”)</u>、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律、法规。</p> |
| | <p>三、长信先锐债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>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。中国证监会对本基金募集申请的注册，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。</p> <p>.....</p> | <p>三、<u>长信先锐混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长信先锐债券型证券投资基金变更注册而来</u>，长信先锐债券型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、<u>《长信先锐债券型证券投资基金基金合同》</u>及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>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。中国证监会对长信先锐债券型证券投资基金变更为本基金的注册，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。</p> <p>.....</p> <p>投资者应当认真阅读基金招募说</p> |

| | | |
|---------------------------|---|---|
| | | <p><u>说明书、基金合同等信息披露文件，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。</u></p> |
| | <p>无</p> | <p><u>六、基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。</u> <u>基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。</u></p> |
| <p>第二部分 释义</p> | <p>7、基金份额发售公告：指《长信先锐债券型证券投资基金基金份额发售公告》</p> | <p>7、基金份额发售公告：指<u>原</u>《长信先锐债券型证券投资基金基金份额发售公告》</p> |
| | <p>9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》<u>修改</u>的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> | <p>9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，<u>经</u>2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》<u>修正</u>的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> |
| | <p>13、《流动性风险规定》：指中国证监会 2017</p> | <p>13、《流动性风险<u>管理</u>规定》：指中</p> |

| | | |
|----------|--|--|
| | <p>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》及颁布机关对其不时做出的修订</p> | <p>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》及颁布机关对其不时做出的修订</p> |
| | <p>15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会</p> | <p>15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业<u>保险</u>监督管理委员会</p> |
| | <p>19、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称</p> | <p>19、合格境外机构投资者：指符合<u>《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》</u>及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者 20、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人 21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称</p> |
| | <p>30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> | <p>31、基金合同生效日：指<u>《长信先锐混合型证券投资基金基金合同》生效起始日，《长信先锐债券型证券投资基金基金合同》自同一起失效</u></p> |
| | <p>32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月</p> | <p>删除</p> |
| | <p>34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日</p> | <p>34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所、<u>相关期货交易所</u>的正常交易日（若本基金参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日，则本基金有权不开放申购、赎回，并按规定进行公告）</p> |
| <p>无</p> | | <p>56、A 类基金份额：指在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，而不计提销售服务费的基金份额</p> |

| | | |
|--------------|--|--|
| | | <p>57、C类基金份额：指在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>58、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用</p> |
| | 无 | <p>60、内地与香港股票市场交易互联互通机制：是指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称香港联合交易所）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票，包括沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称沪港通）和深港股票市场交易互联互通机制（以下简称深港通），以下简称港股通机制</p> <p>61、港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票</p> |
| | 无 | <p>62、摆动定价机制：指当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</p> |
| 第三部分 基金的基本情况 | <p>四、基金的投资目标</p> <p>通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。</p> | <p>四、基金的投资目标</p> <p>通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。</p> |
| | <p>五、基金的最低募集份额总额</p> <p>本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。</p> <p>六、基金份额面值和认购费用</p> <p>本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金的认购费率按招募说明书的规定执</p> | 删除 |

| | | |
|----------------------------|---|---|
| | <p>行。 无</p> | <p>六、基金份额类别设置 <u>本基金根据认购、申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。</u> <u>在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，而不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。</u> <u>本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。</u> <u>投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。</u> <u>本基金有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中列示。</u> <u>在对基金份额持有人权益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人经与基金托管人协商一致后，增加新的基金份额类别、调低现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但须报证监会备案并提前公告。</u></p> |
| <p>第四部分 基金的历史沿革</p> | <p>第四部分 基金份额的发售 一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。场外将通过基金管理人的直销机构和代</p> | <p>第四部分 基金的历史沿革 长信先锐混合型证券投资基金由长信先锐债券型证券投资基金变更注册而来。长信先锐债券型证券投资基金经中国证监会 2016 年 4 月 11 日证监许可【2016】741 号文注册募集。基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。</p> |

销机构（具体名单详见发售公告）。场内将通过上海证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售（具体名单详见上海证券交易所相关业务公告）。—

销售机构对认购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认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。—

3、~~发售对象~~

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。—

二、~~基金份额的认购~~

1、~~认购费用~~

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。—

2、~~募集期利息的处理方式~~

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。认购利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。—

3、~~基金认购份额的计算~~

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。—

4、~~认购份额余额的处理方式~~

场外认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。—

场内认购份额保留到整数位，不足一份基金份额部分的认购资金零头由交易所会员单位返还给投资者。—

三、~~基金份额认购金额的限制~~

1、~~投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。~~

2、~~基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。认购一经受理不得撤销。~~

3、~~基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看~~

长信先锐债券型证券投资基金自 2016 年 5 月 3 日至 2016 年 5 月 27 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集长信先锐债券型证券投资基金（含利息结转份额）220,764,276.57 份基金份额，有效认购户数为 1,312 户。经中国证监会书面确认，长信先锐债券型证券投资基金于 2016 年 6 月 2 日正式成立，《长信先锐债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 2 日生效。—

XXXX 年 X 月 X 日长信先锐债券型证券投资基金以 XX 方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于变更长信先锐债券型证券投资基金有关事项的议案》，内容包括长信先锐债券型证券投资基金修改基金名称、基金类型、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准等，将“长信先锐债券型证券投资基金”变更为“长信先锐混合型证券投资基金”。根据基金份额持有人大会决议，变更注册后的《长信先锐混合型证券投资基金基金合同》于 201X 年 X 月 X 日生效。—

| | | |
|-------------------|---|---|
| | <p>招募说明书或相关公告。—</p> <p>4、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。—</p> | |
| <p>第五部分 基金的存续</p> | <p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件—</p> <p>本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。—</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。—</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式—</p> <p>如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：—</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；—</p> <p>2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。—</p> <p>3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。—</p> <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</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</p> | <p>第五部分 基金的存续</p> <p>《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p> |

| | | |
|------------------------|---|---|
| | 开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 | |
| 第六部分 基金份额的申购与赎回 | 二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，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。 基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券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。 | 二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所、 相关期货交易所 的正常交易日的交易时间 (若本基金参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日，则本基金有权不开放申购、赎回，并按规定进行公告) ，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。 基金合同生效后，若出现新的证券 /期货 交易市场、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。 |
| | 三、申购与赎回的原则 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则。 | 三、申购与赎回的原则 5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则， 确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。 |
| | 四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。 基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。 | 四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立； 基金份额 登记机构确认基金份额时，申购生效。 基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立； 基金份额 登记机构确认赎回时，赎回生效。 |
| | 五、申购和赎回的数量限制 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， 具体请参见招募说明书或相关公告； | 五、申购和赎回的数量限制 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 |

| | | |
|--|---|---|
| | | <p><u>益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。</u></p> |
| | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</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。场外申购份额保留到小数点后2位,小数点后2位以后部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购份额保留到整数位,不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位退还给投资者。</p> <p>4、申购费用由投资人承担,不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用应根据相关规定按照比例归入基金财产,未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中,对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。</p> <p>7、基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,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必要手续后,基金管理人可以适当调低基金销售费率。</p> | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金分为A类和C类两类基金份额,两类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值。本基金两类基金份额净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,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A类基金份额的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。本基金C类基金份额不收取申购费。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。上述计算结果均按四舍五入方法,场外申购份额保留到小数点后2位,小数点后2位以后部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购份额保留到整数位,不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位退还给投资者。</p> <p>4、申购费用由申购A类基金份额的投资人承担,不列入基金财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定,具体见招募说明书的规定。其中,对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产。</p> |

| | | |
|--|--|--|
| | | <p>7、基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。<u>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</u>，在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费率。</p> <p><u>8、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。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。</u></p> |
| | <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、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，或其他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利益的情形。</p> <p>7、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基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施。</p> <p>8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停或拒绝基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>5、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，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。</p> <p>7、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。</p> <p>8、法律法规规定、<u>中国证监会认定或基金合同约定</u>的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业</p> |

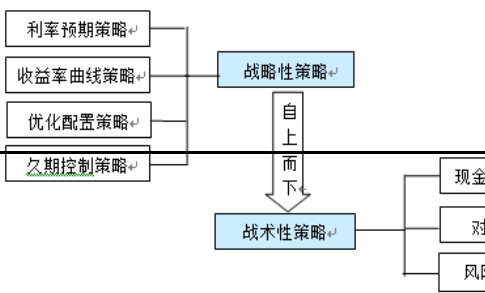
| | | |
|--|--|--|
| | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>6、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人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。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公告。</p> | <p>务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。</p> <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p> <p>7、法律法规规定、中国证监会认定或基金合同约定的其他情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7 项情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人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。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公告。</p> |
| | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。</p> | <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。</p> |
| | <p>十二、基金的非交易过户</p> <p>.....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>十二、基金的非交易过户</p> <p>.....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</p> |

| | | |
|---------------------------------|--|---|
| | <p>十七、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。</p> | <p>金登记机构规定的标准收费，接受划转的主体应为依法可持有本基金份额的合格投资者。</p> <p>十七、在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，且履行适当程序后，无需召开基金份额持有人大会审议。</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>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等的业务规则；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；</p> <p>(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；</p> | <p>一、基金管理人</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>(15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；</p> |
| | <p>二、基金托管人</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的</p> | <p>二、基金托管人</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券/期货账户、资金账户等投资所需账户、为基金办理证券/期货交易资金清算；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》</p> |

| | | |
|------------------------------|---|--|
| | <p>约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p> | <p>及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券/期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p> |
| | <p>三、基金份额持有人 每份基金份额具有同等的合法权益。 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策； (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> | <p>三、基金份额持有人 <u>同一类别</u>每份基金份额具有同等的合法权益。 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： (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，<u>自行承担投资风险</u>； (4) <u>交</u>纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> |
| <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组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> | <p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的<u>同一类别的</u>每一基金份额拥有平等的投票权。</p> |
| | <p>一、召开事由 1、除法律法规、中国证监会或基金合同另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会： (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准； 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改，不需召开基金份额持有人大会： (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内，且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，调低本基金的申购费率、调低赎回费率，或调整收费方式，调整基金份额类别的设置； (5) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转</p> | <p>一、召开事由 1、除法律法规、中国证监会或基金合同另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会： (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准<u>或提高销售服务费</u>率； 2、<u>在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下</u>，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： (2) <u>调整</u>本基金的申购费率、调低赎回费率、<u>调低销售服务费</u>率；<u>变更</u>收费方式；<u>调整</u>基金份额类别、<u>停止</u>现有基金份额类别的<u>销售</u></p> |

| | | |
|-------------------------------------|---|--|
| | <p>换、非交易过户、转托管等业务规则； (6) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金在法律法规或中国证监会允许的范围内推出新业务或服务；</p> | <p>或者增设新的基金份额类别； (5) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则； (6) 基金推出新业务或服务；</p> |
| | <p>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规及监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。 2、通讯开会。…… (4) ……《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。</p> | <p>四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。 2、通讯开会。…… (4) ……《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>五、议事内容与程序 1、议事内容及提案权 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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前 35 日提交召集人。</p> | <p>五、议事内容与程序 1、议事内容及提案权 删除</p> |
| | <p>六、表决 2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除本合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p> | <p>六、表决 2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p> |
| <p>第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件</p> | <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序 (一) 基金管理人的更换程序 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上(含 2/3)表决通过，并自表决通过之日起生效；</p> | <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序 (一) 基金管理人的更换程序 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额</p> |

| | | |
|-----------------------------|--|---|
| <p>和程序</p> | <p>(二) 基金托管人的更换程序 2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 $\frac{2}{3}$ 以上（含 $\frac{2}{3}$）表决通过，并自表决通过之日起生效；</p> | <p>持有人所持表决权的 $\frac{2}{3}$ 以上（含 $\frac{2}{3}$）表决通过，决议自表决通过之日起生效； (二) 基金托管人的更换程序 2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 $\frac{2}{3}$ 以上（含 $\frac{2}{3}$）表决通过，决议自表决通过之日起生效；</p> |
| <p>第十二部分 基金的 投资</p> | <p>一、投资目标 通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。</p> <p>二、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，包括国内依法发行上市的股票（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、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，一现金（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的投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> | <p>一、投资目标 通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。</p> <p>二、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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、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、货币市场工具、国债期货、股指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）。 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 40%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%</p> |

| | | |
|--|---|---|
| | | <p>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。<u>国债期货、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</u></p> |
| | <p>三、投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，<u>并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</u></p> <p>2、债券投资策略</p>  <p>图：本基金投资策略体系</p> <p>G、对冲性策略</p> <p>（2）中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。</p> <p>3、股票投资策略：—</p> <p>本基金采用“自下而上”的数量化选股策略，在纪律化模型约束下，紧密跟踪策略，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，从而取得较高的收益。—</p> <p>本基金基于国内外证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验构建的量化模型将超额收益的来源归纳为成长因子、—</p> | <p>三、投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p><u>（7）套利策略</u></p> <p>3、股票投资策略</p> <p><u>（1）行业配置策略</u></p> <p><u>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。</u></p> <p><u>（2）个股投资策略</u></p> <p>本基金对境内股票及港股通标的股票的选择，将采用“自下而上”精选个股策略，对受益于国家/地区产业政策及经济发展方向的相关上市公司进行深入挖掘，在完善的估值体系下严格按照风险收益比最优原则选择标的资产进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。具体从以下几个方面对上市公司的投资价值进行评估：</p> <p><u>① 品质评估分析</u></p> <p>品质评估分析是本基金管理人基于企业的全面评估，对企业价值进行的有效分析和判断。上市公司品质评估分析包括财务品质评估和</p> |

估值因子、基本面因子和流动性因子。—

—(1) 成长因子—

本基金考察的成长因子可以参考以下指标：PEG、营业收入增长率、过去三年的每年净利润增长率、净资产增长率、可持续增长率（留存收益率*净资产收益率）等。—

—(2) 估值因子—

本基金考察的估值因子可以参考以下指标：市盈率（PE）、市净率（PB）、市现率（PCF）、市销率（PS）等。—

—(3) 基本面因子—

本基金考察的基本面因子可以参考以下指标：总资产收益率（ROA）、净资产收益率（ROE）、销售毛利率、主营业务收入、资产负债率、每股收益、每股现金流等。—

—(4) 流动性因子—

本基金考察的流动性因子可以参考以下指标：成交量、换手率、流通市值等。—

本基金将依据经济周期、行业周期、市场状态以及投资者情绪等多个层面，定期检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，采用定量的模式挑选最稳定有效的因子集合作为选股模型的判别因子，并依据投资目标，权衡风险与收益特征，构建定量选股模型。模型的使用以及因子的判定方法同样需要随着市场的变化根据不同的测试环境以及不同的测试结果进行动态的更新。—

本基金利用量化模型选取最具投资价值的个股进入本基金的股票投资组合。—

4、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。

—(1) 权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险，有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。—

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究，并结合期权定价模型，评估权证的合理投资价值，在有效控制风险的前提下进行权证投资。—

本基金将通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性

经营品质评估。—

② 风险因素分析

风险因素分析是对个股的风险暴露程度进行多因素分析，该分析主要从两个角度进行，一个是利用个股本身特有的信息进行分析，包括竞争引致的主营业务衰退风险、管理风险、关联交易、投资项目风险、股权变动、收购兼并等。另一个是利用统计模型对风险因素进行敏感性分析。—

③ 估值分析

个股的估值是利用绝对估值和相对估值的方法，寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里我们主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折现模型、P/E模型、EV/EBIT模型、Franchise P/E模型等估值模型针对不同类型的产业和个股进行估值分析，另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响，排除通胀的影响因素。—

4、港股通投资策略

本基金将仅通过港股通投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。—

本基金将通过港股通机制投资香港联合交易所上市的股票，在上述行业配置和个股投资策略下，比较个股与A股市场同类公司的质地及估值水平等要素，优选具备质地优良、行业景气的公司进行重点配置。—

5、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与资产支持证券、股指期货、国债期货等金融工具的投资。

—(2) 股指期货投资策略

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

| | |
|--|---|
| <p>的认沽权证策略，杠杆交易策略等，利用权证进行对冲和套利等。</p> | <p><u>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。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</u></p> <p><u>(3) 国债期货的投资策略</u> 本基金通过对基本面和资金面的分析，对国债市场走势做出判断，以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长，通货膨胀压力浮现，央行政策趋于紧缩时，本基金建立国债期货空单进行套期保值，以规避利率风险，减少利率上升带来的亏损；反之，在经济增长趋于回落，通货膨胀率下降，甚至通货紧缩出现时，本基金通过建立国债期货多单，以获取更高的收益。</p> |
| <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%；</p> <p>(2) 本基金应当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；</p> <p>(7)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>(3) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；</p> <p>(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的</p> | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金投资于股票资产的比例不高于基金资产的 40%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%；本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%；</p> <p>(2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；</p> <p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同</p> |

0.5%;—

~~(17)~~ 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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**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；

~~(12)~~ **本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；—**

(14) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

~~(16)~~ 基金投资流通受限证券时，~~遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字【2006】141号）及相关规定执行；~~

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，~~除上述第(2)、(11)、(17)、(18)项以外，~~基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

(7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 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；

(15) **本基金的**总资产不得超过基金净资产的 140%；

(17) 基金投资流通受限证券，基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(18) **本基金参与股指期货、国债期货的交易，除中国证监会另有规定外，应当遵守下列要求：**

1) 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%；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%；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%；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）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

2) 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%；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%；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%；在任何交易日日终，持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买

| | | |
|--|---|---|
| | | <p><u>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规定；</u></p> <p><u>3) 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）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</u></p> <p><u>除上述第（2）、（7）、（12）、（14）项外，</u>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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p> |
| | <p>2、禁止行为</p> <p>……</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>2、禁止行为</p> <p><u>（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</u></p> <p>……</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……</p> |
| | <p>五、业绩比较基准</p> <p>中证综合债指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%</p> <p>本基金为债券型投资基金，债券资产的投资比例不低於基金资产的 80%，同时投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%。</p> <p>中证综合债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。</p> <p>中证 500 指数是从上海和深圳证券市场中选</p> | <p>五、业绩比较基准</p> <p><u>中债综合指数</u>收益率*<u>70%</u>+<u>沪深 300 指数</u>收益率*<u>20%</u>+<u>恒生指数</u>收益率*<u>10%</u></p> <p><u>中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数，是目前市场上专业、权威和稳定的，且能够较好地反映债券市场整体状况的债券指数。</u></p> <p><u>沪深 300 指数是沪深证券交易所编制发布的用于反映沪深 300 指数编制目标和运行状况，并能够作为投资业绩的评价标准，为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。</u></p> |

| | | |
|-------------------------------|--|--|
| | <p>取 500 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况，具有良好的投资价值。该指数由中证指数公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护，编制方法的透明度高，具有独立性。</p> | <p><u>恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。</u> <u>本基金为混合型基金，选用中债综合指数收益率、沪深 300 指数收益率和恒生指数收益率加权作为本基金的投资业绩评价标准，与本基金投资范围相匹配。</u></p> |
| | <p>六、风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。</p> | <p>六、风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> |
| | <p>七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；</p> | <p>七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；</p> |
| <p>第十三部分 基金的财产</p> | <p>三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。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>三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货结算账户以及投资所需的其他专用账户。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 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。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销；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销。</p> | <p>四、基金财产的保管和处分 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。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销；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销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。</p> |
| <p>第十四</p> | <p>一、估值日</p> | <p>一、估值日</p> |

| | | |
|------------------------|---|--|
| <p>部分基金资产估值</p> | <p>本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。</p> | <p>本基金的估值日为本基金相关的证券、<u>期货</u>交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。</p> |
| | <p>二、估值对象 基金所拥有的股票、<u>权证</u>、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> | <p>二、估值对象 基金所拥有的股票、债券、<u>国债期货</u>、<u>股指期货</u>和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> |
| | <p>无</p> | <p>三、估值原则 <u>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。</u> <u>(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。</u> <u>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。</u> <u>(二)对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。</u></p> |

| | | |
|--|---|--|
| | | <p><u>(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。</u></p> |
| | <p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的权益类证券的估值 交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值……</p> <p>2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3、交易所市场交易的固定收益品种的估值</p> <p>（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，鉴于目前尚不存在活跃市场而采用估值技术确定其公允价值。……</p> <p>（5）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，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以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，采用估值技术确定其公允价值。</p> | <p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的权益类证券的估值 交易所上市的权益类证券（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……</p> <p>2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理</p> <p>（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的<u>市价（收盘价）</u>估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>（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；</p> <p>（3）<u>发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票）</u>，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3、交易所市场交易的固定收益品种的估值</p> <p>（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，鉴于目前尚不存在活跃市场而采用估值技术确定其公允价值。……</p> <p>（5）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值，<u>在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</u></p> <p>6、国债期货合约一般以估值当日</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | | <p><u>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大变化的, 采用最近交易日结算价估值。</u></p> <p><u>7、本基金投资股指期货合约, 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大变化的, 采用最近交易日结算价估值。</u></p> <p><u>8、估值计算中涉及港币对人民币汇率的, 将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准: 当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。</u></p> <p><u>当本基金发生大额申购或赎回情形时, 基金管理人可以对本基金采用摆动定价机制, 以确保基金估值的公平性。</u></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。基金管理人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、估值程序</p> <p>1、<u>各类</u>基金份额净值是按照每个工作日闭市后, <u>该类</u>基金资产净值除以当日<u>该类</u>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, <u>由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。</u>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<u>两类</u>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<u>两类</u>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、估值错误的处理</p> <p>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</p> | <p>六、估值错误的处理</p> <p>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<u>基一类</u>基金份额净值小数点后 4 位</p> |

| | | |
|---------------------------------|---|---|
| | <p>错误。</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下： （2）错误偏差达到基金份额净值的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；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。 （3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。</p> | <p>以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下： （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，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。 （3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。 <u>如果行业另有通行做法，双方当事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。</u></p> |
| | <p>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；</p> <p>5、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。</p> | <p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。</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，或由于不可抗力等原因，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，但是未能发现该错误或即使发现错误但因前述原因无法及时更正的，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减轻或消除由此造成的影响。</p> | <p>九、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人按估值方法的第9项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p> <p>2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等原因，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，但是未能发现该错误或即使发现错误但因前述原因无法及时更正的，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减轻或消除由此造成的影响。</p> |
| <p>第十五部分 基金费用与税收</p> | <p>一、基金费用的种类</p> <p>6、基金的证券交易费用；</p> <p>8、证券账户开户费用、银行账户维护费用；</p> | <p>一、基金费用的种类</p> <p><u>3、基金的销售服务费；</u></p> <p>7、基金的证券、<u>期货</u>交易费用；</p> <p>9、证券、<u>期货</u>账户开户费用、银行账户维护费用；</p> |

| | | |
|--|---|---|
| | <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> | <p>10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$</p> <p>3、C类基金份额的销售服务费</p> <p>本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：</p> <p>$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$</p> <p>H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费</p> <p>E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值</p> <p>销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> |
| | <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用；</p> | <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、原《长信先锐债券型证券投资基金基金合同》生效前的相关费用；</p> |
| | <p>四、费用调整</p> <p>基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。</p> | <p>删除</p> |

| | | |
|---|---|--|
| | <p>调整基金管理费率、基金托管费率等费率，一 须召开基金份额持有人大会审议。 基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费 率实施日前在指定媒介上刊登公告。</p> | |
| | <p>五、基金税收 本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳 税义务按国家税收法律、法规执行。</p> | <p>四、基金税收 本基金运作过程中涉及的各项纳税 主体，其纳税义务按国家税收法 律、法规执行。<u>基金财产投资的相 关税收，由基金份额持有人承担， 基金管理人或者其他扣缴义务人 按照国家有关税收征收的规定代 扣代缴。</u></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 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基 金每年收益分配次数最多为12次，若《基金 合同》生效不满3个月可不进行收益分配； 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与 红利再投资，投资者可选择现金红利或将现 金红利自动转为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； 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面 值；即基金收益分配基准日的基金份额净值 减去每单位基金份额收益分配金额后不能低 于面值； 4、每一基金份额享有同等分配权；</p> | <p>三、基金收益分配原则 <u>1、本基金在符合基金法定分红条 件的前提下可进行收益分配，具体 分红方案见基金管理人根据基金 运作情况届时不定期发布的相关 分红公告，若《基金合同》生效不 满3个月可不进行收益分配； 2、由于本基金A类基金份额不收 取销售服务费，而C类基金份额收 取销售服务费，各类别基金份额对 应的可供分配利润将有所不同。本 基金同一类别的每一基金份额享 有同等分配权；</u> 3、本基金收益分配方式分两种： 现金分红与红利再投资，投资者可 选择现金红利或将现金红利自动 转为相应类别的基金份额进行再 投资；若投资者不选择，本基金默 认的收益分配方式是现金分红； 4、基金收益分配后各类基金份 额净值不能低于面值；即基金收益分 配基准日的各类基金份额净值减 去该类每单位基金份额收益分配 金额后不能低于面值； <u>在符合法律法规及基金合同约定， 并对基金份额持有人利益无实质 不利影响的前提下，基金管理人可 对基金收益分配原则和支付方式 进行调整，不需召开基金份额持有 人大会。</u></p> |
| | <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并</p> | <p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> |

| | | |
|-------------------|--|--|
| | 由基金托管人复核， 在 2 个工作日内 在指定媒介公告并报中国证监会备案。 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。 | 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， <u>依照《信息披露办法》</u> 在指定媒介公告并报中国证监会备案。 |
| | 六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足 <u>手</u> 支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。 | 六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足 <u>以</u> 支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为 <u>相应类别</u> 的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。 |
| 第十七部分 基金的会计与审计 | 一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日； 基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度； | 一、基金会计政策 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日； |
| | 二、基金的年度审计 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 <u>在 2 个工作日内</u> 在指定媒介公告并报中国证监会备案。 | 二、基金的年度审计 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 <u>依照《信息披露办法》</u> 在指定媒介公告并报中国证监会备案。 |
| 第十八部分 基金的信息披露 | 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。 | 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、 <u>《流动性风险管理规定》</u> 、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。 |
| | 五、公开披露的基金信息 （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金 <u>认购、申购和赎回</u> 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。..... 3、..... 基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人 <u>在基金份额发售的 3 日前</u> ，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上； | 五、公开披露的基金信息 （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金 <u>申购和赎回</u> 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。..... 3、..... 基金管理人 <u>应及时</u> 将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指 |

| | |
|---|--|
| <p>基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> | <p>定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> |
| <p>（二）基金份额发售公告 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。</p> <p>（三）《基金合同》生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p> | <p>删除</p> |
| <p>（四）基金资产净值、基金份额净值 《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。 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、基金份额发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。 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指定媒介上。</p> | <p>（二）基金资产净值、各类基金份额净值 《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各类基金份额净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。 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各类基金份额净值。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、各类基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。</p> |
| <p>（五）基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。</p> | <p>（三）基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额销售网点查阅或者复制前述信息资料。</p> |
| <p>（六）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。 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</p> | <p>（四）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 <u>如</u>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，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | <p>投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> | <p>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。</p> |
| | <p>(七) 临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</p> <p>7、基金募集期延长；</p> <p>16、基金管理费、基金托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>17、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；</p> <p>23、本基金发生巨额赎回并延期支付；</p> | <p>(五) 临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应按规定编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。</p> <p>15、基金管理费、基金托管费、基金销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>16、某一类基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；</p> <p>22、本基金发生巨额赎回并延期办理；</p> <p>25、调整本基金份额类别设置；</p> <p>28、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</p> |
| | <p>(十一) 中小企业私募债的信息披露 基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金的季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。</p> | <p>(九) 投资国债期货的信息披露 基金管理人应在季度报告、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交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况等，并充分揭示国债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。</p> <p>(十) 基金投资股指期货的信息披露 基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况等，并充分揭示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。</p> <p>(十一) 基金投资流通受限证券的信息披露</p> |

| | | |
|-----------------------------|---|---|
| | | <p><u>基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值,以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。</u></p> <p><u>(十二)基金投资港股通标的股票的信息披露</u></p> <p><u>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和《招募说明书》(更新)等文件中披露参与港股通标的股票交易的相关情况。</u></p> |
| | <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。</p> | <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。</p> |
| | <p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障基金份额持有人的利益,已决定延迟估值;</p> | <p>八、暂停或延迟信息披露的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> |
| 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算 | <p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:</p> | <p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>有下列情形之一的,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:</p> |
| | <p>三、基金财产的清算</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月。</p> | <p>三、基金财产的清算</p> <p>5、基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。</p> |
| 第二十部分 违约责任 | <p>一、.....</p> <p>但是发生下列情况的,当事人可以免责:</p> | <p>一、.....</p> <p>但是发生下列情况的,当事人免责:</p> |
| 第二十一部分 | <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</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</p> |

| | | |
|-------------------------|---|---|
| 争议的 处理和 适用的 法律 | 好协商未能解决的，应提交 <u>中国国际经济贸易仲裁委员会</u> 根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为 <u>北京市</u> ，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费、律师费由败诉方承担。 | 一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交 <u>深圳国际仲裁院（深圳仲裁委员会）</u> 根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为 <u>深圳市</u> ，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费、律师费由败诉方承担。 |
| | 《基金合同》受中国法律管辖。 | 《基金合同》受中国（ <u>为基金合同之目的，不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区</u> ）法律管辖。 |
| 第二十二部分 基金合同 的效力 | 《基金合同》是约定 <u>基金当事人之间、基金与基金当事人之间</u> 权利义务关系的法律文件。 | 《基金合同》是约定 <u>基金合同</u> 当事人之间权利义务关系的法律文件。 |
| | 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章并在 <u>募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</u> 4、《基金合同》正本一式 <u>六</u> 份，除上报有关监管机构一 <u>式二</u> 份外，基金管理人、基金托管人各持有 <u>二</u> 份，每份具有同等的法律效力。 | 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章并 <u>自基金份额持有人大会决议决定之日起生效。</u> 4、《基金合同》正本一式 <u>三</u> 份，除上报有关监管机构一 <u>份</u> 外，基金管理人、基金托管人各持有 <u>一</u> 份，每份具有同等的法律效力。 |

附件二：授权委托书

本机构特此授权_____代表本机构参加投票截止日为2020年1月20日17:00的以通讯方式召开的长信先锐债券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。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会表决结束之日止。若长信先锐债券型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，除非授权文件另有载明或基金份额持有人重新作出有效授权，本授权继续有效。

委托人信息：

机构名称(盖公章)：

法定代表人姓名：

机构证件类型：

机构证件号码（填写）：

基金账户号：

受托人（签字或盖章）：

受托人证件类型：

受托人证件号码（填写）：

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1、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个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

2、如果同一委托人多次以有效纸面方式授权的，且能够区分授权次序的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，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纸面授权为准；最后时间收到的多次纸面授权均为表示具体表决意见的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准，若授权表示不一致，视为委托人授权受托人选择其中一种授权表示行使表决权。

3、以上授权是基金份额持有人就其在权益登记日持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。

4、本授权委托书（样本）中“机构证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

5、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。

