

鑫元基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开 鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会的 公告

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《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，鑫元半年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人鑫元基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯开会方式。

2、表决票收取时间：自2017年7月10日起，至2017年8月7日17时止
（以收到表决票的时间为准）

二、会议审议事项

1. 《关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案》（见附件一）；

上述议案的内容说明见附件二及附件三；

2. 《关于调整鑫元半年定期开放债券型证券投资基金赎回费的议案》，（见附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2017年7月10日，即在该日下午交易时间结束后，在鑫元基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次会议的表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票，样本见附件五。基金份额持有人可剪报、复印或登陆本基金管理人网站（www.xyamc.com）下载表决票。

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）个人持有人自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件；

（2）机构持有人自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件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，并提供持有人身份证件复印件，以及填妥的授权委托书原件（参照附件六）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；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）；

（4）机构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，并提供持有人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（参照附件六）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；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）；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、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（参照附件六）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；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）。

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于前述表决票收取时间内（以收到时间为准），通过专人送交或邮寄的方式，提交给本基金管理人（专人送达的以实际递交时间为准；通过邮寄方式提交的，以收件日邮戳时间为准）。

基金份额持有人可将填妥的表决票和所需的相关文件邮寄至基金管理人，具体地址和联系方式为：

地址：上海市静安区中山北路 909 号 12 楼

联系人：鑫元基金管理有限公司客户服务部张晶

联系电话：021-20892078

邮政编码：200070

请在信封表面注明：“鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国光大银行股份有限公司）派出的一名授权代表的监督下在表决截止日期后 2 个工作日内统计全部有效表决票，并由公证机构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的每份基金份额有一票表决权。

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总数。

(2) 如多选或表决意见空白的表决票，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本会议通知的规定，则视为弃权表决，但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，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，邮寄的以收件日邮戳时间为准。

六、决议生效条件

1、如提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一），则本次通讯开会视为有效；

2、本次议案如经提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额的二分之一以上（含二分之一）多数同意，则视为表决通过，形成的大会决议有效；

3、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，本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的二

分之一以上（含二分之一）。若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于上述规定比例的，基金管理人可以在本次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，到会者所持有的有效基金份额应不少于权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、会议召集人（基金管理人）：鑫元基金管理有限公司

联系电话：400-606-6188

电子邮件：service@xyamc.com

网站：www.xyamc.com

2、基金托管人：中国光大银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系方式：021-62154848

4、律师事务所：上海源泰律师事务所

九、重要提示

1、关于本次议案1（见附件一）的说明详见附件二《关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的说明》及附件三《〈鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同〉修改前后文对照表》。

2、本次基金份额持有人大会需由出席会议的符合要求的基金份额持有人或其代理人所持有有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）方可召开，且《关于调整鑫元半年定期开放债券型证券投资基金赎回费的议案》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）

所持表决权的二分之一（含二分之一）以上通过，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、请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。

4、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话咨询。

5、本通知的有关内容由鑫元基金管理有限公司负责解释。

6、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。

鑫元基金管理有限公司

二〇一七年七月六日

附件：

- 一、关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案
- 二、关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的说明
- 三、《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表
- 四、关于调整鑫元半年定期开放债券型证券投资基金赎回费的议案
- 五、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票
- 六、授权委托书

附件一：

关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案

鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，提议调整本基金的投资范围、投资限制、业绩比较基准、合同终止事由等事项，并相应修改本基金《基金合同》的相关内容。同时，本基金的托管协议及招募说明书也据此相应修改，更新后的具体内容届时可详见基金管理人的官网公告。

修改本基金《基金合同》的具体方案和程序可参见附件二《关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的说明》及附件三《〈鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同〉修改前后文对照表》。

修改后的《基金合同》将自表决通过之日起生效。

以上议案，请予审议。

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

二〇一七年七月六日

附件二：

关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的说明

一、声明

1、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）成立于2014年12月2日。根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，鑫元基金管理有限公司（以下简称“本公司”）依据《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》、《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，决定修改本基金的投资范围、投资限制、业绩比较基准、合同终止条件等事项，并相应修改本基金合同的相关内容。

2、本次基金份额持有人大会需由出席会议的符合要求的基金份额持有人或其代理人所持有有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）方可召开，且《关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案》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）所持表决权的二分之一（含二分之一）以上通过，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、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

4、中国证监会对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价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、方案要点

1、修改投资范围

修改后为：

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）、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可转换债券含分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、银行存款、同业

存单、货币市场工具、权证、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:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期开始前的10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制;本基金在封闭期内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,持有现金应不低于国债期货交易保证金的一倍,但开放期内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,本基金持有现金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%。

2、修改投资组合限制

修改后为:

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但在每次开放期开始前的10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制;本基金在封闭期内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,持有现金应不低于国债期货交易保证金的一倍,但开放期内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,本基金持有现金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%;

(2) 本基金投资于股票、权证的比例合计不高于基金资产的20%;

(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) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6) 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%;

(7) 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%;

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 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%；

(12) 本基金应投资于信用评级为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；

(13) 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%，本基金投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过本基金的当期封闭期的剩余期限；

(14) 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；

(15) 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%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

(16) 在封闭期内，本基金总资产不得超过基金净资产的200%；在开放期内，本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

(17) 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%；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%；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；

(18) 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、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例

的，除上述第（12）条以外，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。

3、修改业绩比较基准

修改后为：

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×10%+中债新综合全价指数收益率×90%

沪深300指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，业内也普遍采用。因此，沪深300指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

中债新综合全价指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的可流通债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一。

根据本基金设定的投资范围，以10%的沪深300指数和90%的中债新综合全价指数构建的复合指数作为本基金的业绩比较基准，符合本基金的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

4、修改合同终止事由

修改后为：

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

5、其他修改

详见附件三

三、基金合同的具体修订

详见附件三

附件三

《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》修改前后文对照表

| 章节 | 原文条款 | 修改后条款 | 修改理由 |
|------------|--|--|----------------|
| | 内容 | 内容 | |
| 第二部分 释义 | 31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日 | 31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所 <u>及其他相关金融期货交易所</u> 的正常交易日 | 根据投资范围的修改完善释义。 |
| 第四部分 | <p>第四部分 基金份额的发售</p> <p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>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。</p> <p>2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。 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，投资者应及时查询。</p> <p>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</p> | <p>第四部分 <u>基金的历史沿革</u></p> <p><u>鑫元半年定期开放债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2014]1172号文准予注册，于2014年12月2日正式成立，成立规模共计349,723,386.13元人民币。基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。</u></p> <p><u>2017年X月X日鑫元半年定期开放债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议通过了《关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案》、《关于调整鑫元半年定期开放债券型证券投资基金赎回费的议案》，审议内容包括了鑫元半年定期开放债券型证券投资基金变更投资范围、投资限制、业绩比较基准、修改合同终止事由及调整赎回费等，变更后的《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自2017年X月X日起正式生效。</u></p> | 变更注册相应修改。 |

| | | |
|---|--|--|
| <p>资人。</p> <p>二、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>本基金A类基金份额在认购时收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额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。</p> <p>2、募集期利息的处理方式</p> <p>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。</p> <p>3、基金认购份额的计算</p> <p>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式</p> <p>认购份额的计算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。</p> <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、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，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、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>4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，A类基金份额的认购费按每笔A类基金份额认购申请单独计算，但已受理的认购申请不得撤销。</p> | | |
| <p>第五部分</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，基金募集期届满或者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> <ol style="list-style-type: none"> 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；- 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，并加计银行同期存款利息；- | <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况的，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>法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p> | <p>变更注册相应修改。</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况的，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>本基金自基金合同生效之日起，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），如发生以下情形之一，则无须召开基金份额持有人大会，《基金合同》将于该日次日终止并根据《基金合同》第二十部分的约定进行基金财产清算：—</p> <p>1、基金份额持有人数量不满 200 人；—</p> <p>2、基金资产净值低于 5000 万元；—</p> <p>3、本基金前十名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 90%。—</p> <p>法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p> | | |
| 第七部分基金 | <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>……</p> | <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>……</p> | 完善相关表述。 |

| | | | |
|-----------------|---|---|----------------------------|
| <p>份额的申购与赎回</p> | <p>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。</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>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金两类基金份额净值的计算,均保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。……</p> | <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、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。……</p> | <p>调整基金份额净值计算的保留位数。</p> |
| | <p>七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请: 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。 …… 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时,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,且开放期间按暂停申购的期间相应延长。</p> | <p>七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请: 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。 …… 6、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的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时。 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、7项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时,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,且开放期间按暂停申购的期间相应延长。</p> | <p>根据最新要求补充拒绝或暂停申购的条件。</p> |
| | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> | <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> | <p>完善相关表述。</p> |

| | | | |
|----------------------|--|--|-------------------|
| | <p>在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</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>4、接受某笔或某些申购、赎回申请会损害现有基金份额持有人利益时。</p> | <p>在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</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>4、接受某笔或某些赎回申请会损害现有基金份额持有人利益时。</p> | |
| 第八部分 基金合同当事人及权利义务 | <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>(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；</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>无</p> | 调整基金管理人的权利。 |
| | <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>住所：北京市西城区太平桥大街 25 号光大中心</p> <p>成立时间：1992 年 8 月 18 日</p> <p>注册资本：404.3479 亿元</p> | <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>住所：北京市西城区太平桥大街 25 号、<u>甲 25 号中国光大中心</u></p> <p>成立时间：1992 年 6 月 18 日</p> <p>注册资本：人民币 <u>466.79095</u> 亿元</p> | 更新基金托管人基本情况。 |
| | <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、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，</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、<u>资金账户、期货账户等投资所需账户</u>，为基金办理证券交易资金清算；</p> | 调整、完善基金托管人的权利、义务。 |

| | | | |
|-------------------|---|--|------------------------|
| | <p>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、证券账户及投资所需的其他账户，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>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： (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、<u>期货账户等</u>投资所需的其他账户，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> | |
| 第九部分 基金份额持有人大会 | <p>一、召开事由 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会： (5) <u>提高</u>基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率，但法律法规要求<u>提高</u>该等报酬标准或销售服务费率的除外； 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： (1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用；</p> | <p>一、召开事由 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会： (5) <u>调整</u>基金管理人、基金托管人的报酬标准或<u>提高</u>销售服务费率，但法律法规要求<u>调整</u>该等报酬标准或<u>提高</u>销售服务费率的除外； 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： (1) 调低销售服务费和其他应由基金承担的费用；</p> | 完善相关表述。 |
| 第十三部分 基金的投资 | <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<u>固定收益类金融工具（包括国内依法发行和上市交易的</u>国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、可转换债券含分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、银行存款<u>等）</u>和<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）</u>、权证等<u>权益类金融工具</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</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<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）</u>、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、<u>证券公司短期公司债</u>、可转换债券含分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、<u>超级短期融资券</u>、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、银行存款、<u>同业存单、货币市场工具</u>、权证、<u>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> | 补充本基金的投资范围，并完善相应的投资要求。 |

| | | |
|---|---|---|
| <p>定)。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期的前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但开放期内本基金持有现金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净值的 5%。</p> | <p>.....</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期开始前的 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；本基金在封闭期内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，持有现金应不低于国债期货交易保证金的一倍，但开放期内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，本基金持有现金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>三、投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>（2）可转换债券投资策略</p> <p>2）个券选择策略</p> <p>本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略，在严格控制风险的前提下，精选具有投资价值的可转换债券，力争实现较高的投资收益。</p> <p>.....</p> <p>（3）资产支持证券投资策略</p> <p>当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处手创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总</p> | <p>三、投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>（2）可转换债券投资策略</p> <p>2）个券选择策略</p> <p>本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略，在严格控制风险的前提下，精选具有投资价值的可转换债券，力争实现较高的投资收益。</p> <p>.....</p> <p><u>（3）中小企业私募债券的投资策略</u></p> <p>由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并</p> | <p>根据本基金实际情况，增加证券公司短期公司债券的投资策略、国债期货投资策略，调整资产支持证券投资策略在文中的顺序。</p> |

| | | |
|---|--|--|
| <p>体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>(4) 中小企业私募债券的投资策略</p> <p>由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。对于中小企业私募债券，本基金的投资策略以持有到期为主。</p> <p>.....</p> | <p>综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。对于中小企业私募债券，本基金的投资策略以持有到期为主。</p> <p><u>(4) 证券公司短期公司债券的投资策略</u></p> <p><u>本基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，指定严格的投资决策流程和风险控制制度，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。</u></p> <p><u>投资证券公司短期公司债券的关键在于系统分析和跟踪证券公司的基本面情况，本基金主要通过定量与定性相结合的研究及分析方法进行投资证券公司短期公司债券的选择和投资。定量分析方面，基金管理人将着重关注债券发行人的财务状况，包括发行主体的偿债能力、盈利能力、现金流获取能力以及发行主体的长期资本结构等。定性分析则重点关注所发行债券的具体条款以及发行主体情况。</u></p> <p><u>4、资产支持证券投资策略</u></p> <p><u>当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</u></p> <p>.....</p> <p><u>7、国债期货投资策略</u></p> | |
|---|--|--|

| | | | |
|--|---|--|--|
| | | <p>为有效控制债券投资的系统性风险，本基金将结合对宏观经济形势和证券趋势的判断，通过对债券市场进行定性和定量的分析，以套期保值为目的，适度运用国债期货来提高投资组合的运作效率。在国债期货投资过程中，本基金将首先对国债期货和现货基差、国债期货的流动性水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。</p> | |
| <p>四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但在每次开放期的前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但开放期内本基金持有现金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净值的5%；</p> | <p>四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，但在每次开放期开始前的10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；本基金在封闭期内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，持有现金应不低于国债期货交易保证金的一倍，但开放期内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，本基金持有现金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>与上文的修改保持一致。</p> | |
| <p>（2）本基金投资于权益类资产（包括股票、权证等）的比例不高于基金资产的20%；</p> | <p>（2）本基金投资于股票、权证的比例合计不高于基金资产的20%；</p> | <p>完善相关表述。</p> | |
| <p>无</p> | <p>（17）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%；本基金在任何交易日内交易（不</p> | <p>根据本基金投资范围的修改，补充国债期货的投资限制。</p> | |

| | | | |
|--|---|---|--|
| | | <p><u>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%;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;</u></p> | |
| | <p>因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。</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,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>2、禁止行为</p> <p>.....</p> <p>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其他重大利害关系的公</p> | <p>因证券、<u>期货</u>市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,<u>除上述第(12)条以外</u>,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>.....</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>1、调整完善相关表述;</p> <p>2、调整关联交易相关表述的位置,并删除重复内容。</p> |

| | | |
|---|---|--------------|
| <p>司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。</p> | | |
| <p>八、基金的融资融券 本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。</p> | 无 | 删除本基金不适用条款。 |
| <p>五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：6个月定期存款利率（税后） 本基金的业绩比较基准将在每个封闭期首日，根据当日中国人民银行公布并执行的6个月定期存款利率水平进行调整。 本基金作为6个月定期开放债券型基金，自基金合同生效之日起每6个月开放一次。因此，将本基金业绩比较基准设置为6个月定期存款利率（税后）完全符合本基金的运作特征。 如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。</p> | <p>五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：<u>沪深 300 指数收益率×10%+中债新综合全价指数收益率×90%</u> <u>沪深 300 指数是中证指数公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，具有一定的权威性和市场代表性，业内也普遍采用。因此，沪深 300 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。</u> <u>中债新综合全价指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，隶属于中债总指数族分类，该指数成份券包含除资产支持证券、美元债券、可转债以外剩余的所有公开发行的可流通债券，是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一。</u> <u>根据本基金设定的投资范围，以 10%的沪深 300 指数和 90%的中债新综合全价指数构建的复合指数作为本基金的业绩比较基准，符合本基金的风险收益特征。</u> <u>如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍</u></p> | 修改本基金业绩比较基准。 |

| | | | |
|-----------------|--|---|-------------------------|
| | | 接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告， <u>而无须召开基金份额持有人大会。</u> | |
| 第十四部分 基金的财产 | 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。 | 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、 <u>期货账户</u> 以及投资所需的其他专用账户。 | 根据本基金投资范围的修改补充。 |
| 第十五部分 基金资产估值 | 一、估值日 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。 | 一、估值日 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。 | 完善相关表述。 |
| | 二、估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 | 二、估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券、 <u>期货合约</u> 和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 | 根据本基金投资范围，补充估值对象。 |
| | 三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 ……估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化 <u>或</u> 证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； | 三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 ……估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化 <u>以及</u> 证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； | 根据本基金投资范围的修改，补充相应的估值方法。 |

| | | |
|---|--|--|
| <p> (2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； (3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； (4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 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，<u>采用估值技术确定公允价值。</u> 4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。 5、中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 </p> | <p> <u>(2) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外)，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；</u> <u>(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；</u> <u>(4) 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。</u> 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，<u>以第三方估值机构提供的价格数据估值。</u> 4、<u>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。</u> 5、<u>因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</u> 6、<u>同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</u> 7、<u>中小企业私募债券，采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价或估值技术确定公允价值，在第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价或估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</u> 8、<u>证券公司短期公司债券，采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价或估值技术确定公允价值，在第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价或估值</u> </p> | |
|---|--|--|

| | | | |
|------|--|---|------------------|
| | | <p><u>技术难以可靠计量公允价值</u>的情况下，按成本估值。</p> <p><u>9、本基金投资国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</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该类基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第<u>4</u>位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</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。当任一类基金份额净值小数点后<u>3</u>位以内(含第<u>3</u>位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。</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该类基金份额的余额数量计算，精确到<u>0.0001</u>元，小数点后第<u>5</u>位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</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。当任一类基金份额净值小数点后<u>4</u>位以内(含第<u>4</u>位)发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。</p> | 调整基金份额净值计算的保留位数。 |
| | <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>六、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、<u>期货</u>交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> | 完善相关表述。 |
| | <p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本部分第三条有关估值方法规定的第<u>6</u>项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等……</p> | <p>八、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按本部分第三条有关估值方法规定的第<u>10</u>项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券、<u>期货</u>交易所及登记机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等……</p> | 完善相关表述。 |
| 第十六部 | <p>一、基金费用的种类</p> <p>7、基金的证券交易或结算费用；</p> | <p>一、基金费用的种类</p> <p>7、基金的证券、<u>期货</u>交易或结算费用；</p> | 补充相应的基金费用的种类。 |

| | | | |
|--------------|--|--|---------------|
| 分基金费用与税收 | <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>上述“一、基金费用的种类中第4—10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>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第4—10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> | 调整表述。 |
| | <p>四、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整</p> <p>在法律法规规定的范围内，基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。</p> | <p>四、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整</p> <p>在法律法规规定的范围内，基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致，<u>在履行适当程序后，调整</u>基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。</p> | 调整基金费用的调整规则。 |
| 第十九部分基金的信息披露 | <p>五、公开披露的基金信息</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</p> | <p>五、公开披露的基金信息</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</p> <p><u>报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过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产品的特有风险。</u></p> | 补充公开披露的事项及规则。 |
| | <p>(七) 临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，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</p> | <p>(七) 临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当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</p> | 完善相关表述。 |

| | | | |
|------------------|--|--|--|
| | <p>的中国证监会派出机构备案。</p> <p>无</p> | <p>会派出机构备案。</p> <p><u>(十) 基金投资国债期货相关信息</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)等文件中披露国债期货交易情况,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><u>(十三) 基金投资证券公司短期公司债券相关信息</u> 基金管理人应当在本基金投资证券公司短期公司债券后2个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资证券公司短期公司债券的名称、数量、期限、收益率等信息。基金管理人应当在基金季度报告、基金半年度报告和基金年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露证券公司短期公司债券的投资情况。</p> | <p>根据本基金的投资范围,补充公开披露的事项及规则。</p> |
| | <p>八、当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息:</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易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、出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况;</p> <p>4、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。</p> | <p>八、当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息:</p> <p>1、基金投资所涉及的证券、<u>期货</u>交易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><u>3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。</u></p> | <p>1、根据最新要求调整延迟披露的条件;</p> <p>2、完善相关表述。</p> |
| <p>第二 十部</p> | <p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>3、在任一开放期最后一日日终(登记机构完成最后</p> | <p>二、《基金合同》的终止事由</p> <p>无</p> | <p>根据实际运作需要,调整基金合</p> |

| | | | |
|---|---|--|--------|
| 分 基金 合同 的变 更、 终止 与基 金财 产的 清算 | <p> 一日申购、赎回业务申请的确认以后），如发生以下情形之一的：— (1) 基金份额持有人数量不满 200 人；— (2) 基金资产净值低于 5000 万元；— (3) 本基金前十名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的 90%。— </p> | | 同终止情形。 |
|---|---|--|--------|

附件四：

关于调整鑫元半年定期开放债券型证券投资基金赎回费的议案

鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，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》、《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《鑫元半年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，提议调整本基金赎回费率，并相应修改本基金《招募说明书》的相关内容，修改后的具体内容将在最近一期更新的《招募说明书》中予以公告。

具体调整安排如下：

一、 方案要点：

本基金的赎回费率由0%调整为根据持有时间不同，收取0.1%（持有6个月以内）或0%（持有6个月以上（含6个月））。

注：本基金的6个月指180天。

二、 《招募说明书》的修订：

具体修订内容如下：

第十部分 基金份额的申购与赎回

六、 申购和赎回的价格、费用及其用途

原表述为：

2、 赎回费率

本基金的赎回费率为0%。

修改为：

2、 赎回费率

本基金的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，不低于赎回费总额的25%应归基金资产，未计入基金资产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。本基金A类份额和C类份额的赎回费率相同，具体如下表所示：

| 持有时间 | 赎回费率 |
|----------------|------|
| 6 个月以内 | 0.1% |
| 6 个月以上（含 6 个月） | 0% |

注：本基金的6个月指180天。

调整后的赎回费将自表决通过之日起生效。

以上议案，请予审议。

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

二〇一七年七月六日

附件五：

鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

| | | | |
|---|------|----|----|
| 基金份额持有人名称： | | | |
| 证件号码（身份证件号 / 营业执照） | 基金账号 | | |
| | | | |
| 审议事项（请在表决意见下打钩） | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案 | | | |
| 关于调整鑫元半年定期开放债券型证券投资基金赎回费的议案 | | | |
| <p>基金份额持有人 / 代理人签名或盖章</p> <p style="text-align: right;">年 月 日</p> | | | |
| <p>说明：</p> <p>请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。多选或表决意见空白，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本会议通知的规定，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，将视为无效表决。</p> | | | |

附件六：

授权委托书

兹委托 先生 / 女士 / 公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为 年 月 日17时的以通讯方式召开的鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。

若鑫元半年定期开放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，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证号或营业执照注册号：

委托人基金账户号：

受托人签字/盖章：

受托人身份证号或营业执照注册号：

委托日期： 年月日

附注：

(1) 本授权委托书中“委托人证件号码”，仅指基金份额持有人在开立基金账户时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

(2) “基金账户号”处空白、多填、错填、无法识别等情况的，不影响授权效力，将被默认为代表持有人所持有的本基金所有份额。

(3) 本授权委托书剪报、复印或按以上格式和内容自制在填写完整并签字盖章后均为有效。

| | | | |
|---|----|------|----|
| 基金份额持有人名称： | | | |
| 证件号码（身份证件号 / 营业执照） | | 基金账号 | |
| | | | |
| 审议事项（请在表决意见下打钩） | 同意 | 反对 | 弃权 |
| 关于修改鑫元半年定期开放债券型证券投资基金基金合同等有关事项的议案 | | | |
| 关于调整鑫元半年定期开放债券型证券投资基金赎回费的议案 | | | |
| <p>基金份额持有人 / 代理人签名或盖章</p> <p style="text-align: right;">年 月 日</p> | | | |
| <p>说明：</p> <p>请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。多选或表决意见空白，或表决票上的表决意见模糊不清或相互矛盾的，其他要件均符合本会议通知的规定，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，将视为无效表决。</p> | | | |