

中欧基金管理有限公司

关于以通讯方式召开中欧量化驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会第一次提示性公告

中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）于2022年6月23日在《证券时报》、本公司网站（www.zofund.com）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）发布了《中欧基金管理有限公司关于以通讯方式召开中欧量化驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、会议基本情况

《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于2018年5月16日正式生效。

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《基金合同》的有关规定，中欧量化驱动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议召开的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2022年7月26日起，至2022年8月9日17:00止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2022年8月10日

4、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：中欧基金管理有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8层

联系人：昂思梦

联系电话：021-68609600-2019

请在信封表面注明：“中欧量化驱动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

《关于修改〈中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同〉有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《<中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同>修改方案说明书》（见附件四）。

三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2022 年 7 月 25 日，即在 2022 年 7 月 25 日下午交易时间结束后，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。

四、表决票的填写和寄交方式

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

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（或基金管理人认可的其他印章，下同），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、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（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件及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，并提供个人投资者身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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，还需提供代理人的身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（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，并提供机构投资者的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(参照附件三)。如代理人为个人, 还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件; 如代理人为机构, 还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的, 应由代理人在表决票上签字或盖章, 并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件, 以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件, 以及填妥的授权委托书原件(参照附件三)。如代理人为个人, 还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)正反面复印件; 如代理人为机构, 还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件(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);

(5) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等, 以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2022 年 7 月 26 日起, 至 2022 年 8 月 9 日 17: 00 以前(送达时间以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人办公地址, 请在信封表面注明: “中欧量化驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

本基金管理人办公地址及联系方式如下:

基金管理人: 中欧基金管理有限公司

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层

联系人: 昂思梦

联系电话: 021-68609600-2019

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(中国工商银行股份有限公司)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书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

2、表决票效力的认定如下:

(1) 表决票填写完整清晰, 所提供文件符合本公告规定, 且在规定时间之内送达基金管理人的, 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选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾, 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, 或未能在规定时间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:

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;

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;

送达时间按如下原则确定: 专人送达的以实际递交时间为准, 邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

3、授权效力确定规则

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

六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面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二分之一以上(含二分之一);

2、《关于修改<中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同>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二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;

3、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持

有基金份额的凭证、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；

4、本次基金份额持有人大会的决议，本基金管理人自决议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的决议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《中华人民共和国证券投资基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不小于权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定，基金管理人可另行确定并公告二次召集大会开会的时间和地点，但权益登记日仍为 2022 年 7 月 25 日。

二次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，详细说明见届时发布的二次召集基金份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：中欧基金管理有限公司

联系人：昂思梦

联系电话：021-68609600-2019

传真：021-33830351

网址：www.zofund.com

2、监督人：中国工商银行股份有限公司

3、公证机关：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，确保表决票于表决截止时间前送达。

2、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 400-700-9700 咨询。

3、基金管理人将在发布本公告后 2 个工作日内连续公布相关提示性公告，就持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

4、本公告的有关内容由中欧基金管理有限公司负责解释。

中欧基金管理有限公司

2022 年 6 月 24 日

附件一：《关于修改<中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同>有关事项的议案》

附件二：《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《<中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同>修改方案说明书》

附件一：

关于修改《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》有关事项的议案

中欧量化驱动混合型证券投资基金基金份额持有人：

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）有关规定，基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议在本基金投资范围中增加港股通标的股票并相应修改基金合同中投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准和风险收益特征、基金资产估值等相关条款，引入侧袋机制并相应在基金合同中补充相关条款，以及根据相关法律法规更新等对基金合同进行相应修改，同时授权基金管理人办理本次基金合同修改的有关具体事宜。

基金合同修改的具体内容详见附件四《<中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同>修改方案说明书》。

以上议案，请予审议。

基金管理人：中欧基金管理有限公司

2022年6月23日

附件二：

中欧量化驱动混合型证券投资基金
基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：			
基金份额持有人证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
基金份额持有人基金账户号：			
代理人姓名/名称：			
代理人证件号码（身份证件号/营业执照号）：			
审议事项	同意	反对	弃权
《关于修改<中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同>有关事项的议案》			
基金份额持有人/代理人签字或盖章			
日期：____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；表决意见代表基金份额持有人本基金账户下全部基金份额的表决意见；2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当分别填写；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额；3、表决意见未选、多选或无法辨认、模糊不清或相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”；4、本表决票可从本基金管理人网站（www.zofund.com）下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托先生 / 女士或单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2022 年 8 月 9 日的以通讯方式召开的中欧量化驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以代理人的表决意见为准。本授权不得转授权。

若中欧量化驱动混合型证券投资基金二次召集审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人姓名或名称（签字/盖章）：

委托人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托人基金账户号：

代理人姓名或名称（签字/盖章）：

代理人证件号码（身份证件号/营业执照号）：

委托日期：____年____月____日

附注：1、此授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。2、“基金账户号”，仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别授权的，应当分别填写；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。3、代理人的表决意见代表委托人本基金账户下全部基金份额的表决意见。

附件四：

《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》

修改方案说明书

一、重要提示

1、为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）有关规定，基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于修改<中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同>有关事项的议案》。

2、本次基金合同修改方案需经本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过，因此方案存在无法获得相关基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案，且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次中欧量化驱动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）持有人大会决议的备案，均不表明其对本次基金合同修改方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、《基金合同》修改方案要点

为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，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《基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议召开基金份额持有人大会对《基金合同》进行修改。本次修改的合同条款要点如下：

章节	变更注册前的《基金合同》条款	变更注册后的《基金合同》条款
全文	指定媒介、指定网站、指定报刊	规定媒介、规定网站、规定报刊
第一部分 前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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》”)	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证

	<p>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》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性管理规定》”）和其他有关法律、法规。</p>	<p>券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律、法规。</p>
<p>第一部分 前言</p>	<p>六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外。</p>	
<p>第一部分 前言</p>	<p>七、本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。</p>	
<p>第一部分 前言</p>		<p>六、基金资产若投资于港股，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。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。</p>
<p>第一部分</p>		<p>七、基金可根据投资策略需要或不同配置地</p>

前言		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，存在不对港股进行投资的可能。
第二部分 释义	<p>10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p>	<p>10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p>
第二部分 释义	<p>13、《流动性管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</p>	<p>13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>14、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所和深圳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>
第二部分 释义	<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>16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会</p>
第二部分 释义	<p>19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法</p>	<p>20、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理暂行办法》（包括其不时修订）</p>

	募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者	及相关法律法规规定，经中国证监会批准，使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者
第二部分 释义	35、开放日： 指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日	36、开放日： 指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务）
第二部分 释义	53、指定媒介： 指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介	54、规定媒介： 指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
第二部分 释义	55、基金产品资料概要： 指《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本基金合同关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）	56、基金产品资料概要： 指《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新 57、侧袋机制： 指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户 58、特定资产： 包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

		以上释义中涉及法律法规的内容，法律法规修订后，如适用本基金，相关内容以修订后法律法规为准。
第三部分 基金的基本情况	<p>八、基金份额的类别</p> <p>在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告，并报中国证监会备案。</p>	<p>八、基金份额的类别</p> <p>在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人需及时公告。</p>
第六部分 基金份额的 申购与赎回	<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>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p>	<p>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>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p>
第六部分 基金份额的 申购与赎回	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；</p> <p>3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人</p>

	<p>规定的时间以内撤销；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。</p>	<p>规定的时间以内撤销；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>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。</p>
<p>第六部分</p> <p>基金份额的</p> <p>申购与赎回</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《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。</p>	<p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>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。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。</p> <p>5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>
<p>第六部分</p> <p>基金份额的</p> <p>申购与赎回</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</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</p>

	<p>的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
第六部分 基金份额的 申购与赎回		<p>十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回</p> <p>本基金实施侧袋机制的，本基金的申购与赎回安排详见招募说明书或相关公告。</p>
第七部分 基金合同当 事人及权利 义务	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 5 层</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（一）基金管理人简况</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层</p>
第七部分 基金合同当 事人及权利 义务	<p>二、基金托管人</p> <p>（二）基金托管人的权利与义务</p> <p>（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>（二）基金托管人的权利与义务</p> <p>（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法定最低期限；</p>

	<p>(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；</p>	<p>(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</p>	<p>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> <p>(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；</p>	<p>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。</p> <p>(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</p>		<p>九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权</p>

		<p>符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：</p> <ol style="list-style-type: none">1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10% 以上（含 10%）；2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含
--	--	---

		<p>二分之一)通过;</p> <p>7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。</p> <p>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</p>
<p>第九部分</p> <p>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一)基金管理人的更换程序</p> <p>2、决议:基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任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三分之二以上(含三分之二)表决通过;</p>	<p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一)基金管理人的更换程序</p> <p>2、决议:基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任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三分之二以上(含三分之二)表决通过,决议自表决通过之日起生效;</p>
<p>第九部分</p> <p>基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</p>	<p>(二)基金托管人的更换程序</p> <p>2、决议:基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后6个月内对被提名的新任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三分之二以上(含三分之二)表决通过;</p>	<p>(二)基金托管人的更换程序</p> <p>2、决议:基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后6个月内对被提名的新任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三分之二以上(含三分之二)表决通过,决议自表决通过之日起生效;</p>
<p>第十二部分</p> <p>基金的投资</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中</p>	<p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、港股通标的股票、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中</p>

	<p>中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、权证、股指期货、股票期权、国债期货、货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>	<p>中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、股指期货、股票期权、国债期货、货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：</p> <p>本基金股票投资占基金资产的比例为 60% - 95%，投资于港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>		<p>三、投资策略</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（5）港股投资策略</p> <p>本基金可通过港股通机制投资港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联交所上市的股票。对于港股通标的股票，本基金主要采用“自下而上”的量化选股方式，精选出具有投资价值的优质标的。其筛选维度主要包括</p>

		<p>但不限于：治理结构与管理层（例如：良好的公司治理结构，优秀、诚信的公司管理层等）、行业集中度及行业地位（例如：具备独特的核心竞争优势，如产品优势、成本优势、技术优势和定价能力等）、公司业绩表现（例如：业绩稳定并持续、具备中长期持续增长的能力等）。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>三、投资策略</p> <p>7、中小企业私募债投资策略</p> <p>与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：</p> <p>①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；</p> <p>②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；</p> <p>③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；</p> <p>④考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；</p> <p>⑤综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。</p>	

	<p>8、权证投资策略</p> <p>本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。</p>	
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金股票投资占基金资产的比例为60% - 95%；</p> <p>（2）每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（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不低于基金资产净值的5%；</p> <p>（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；</p> <p>（5）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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%；</p> <p>（6）本基金持有的全部权证，其市值不得超</p>	<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%，投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%；</p> <p>（2）每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（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不低于基金资产净值的5%；</p> <p>（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的10%；</p> <p>（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的A+H 股合计计算），不超过该证券的10%；</p> <p>（5）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股</p>

<p>过基金资产净值的 3%;</p> <p>(7) 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>(8) 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%;</p> <p>(9) 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%;</p> <p>(10) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;</p> <p>(11) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;</p> <p>(12) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;</p> <p>(13) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;</p> <p>(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;</p> <p>(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%; 本基金在全国银行间同业市场中的</p>	<p>票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%;</p> <p>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%;</p> <p>(6) 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%;</p> <p>(7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;</p> <p>(8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;</p> <p>(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;</p> <p>(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;</p> <p>(11) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;</p> <p>(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;</p>
--	--

	<p>债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(16) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(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前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；</p> <p>(18) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(19) 本基金参与国债期货、股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2) 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%；</p> <p>3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>4) 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%；</p> <p>5) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)</p>	<p>(13) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；</p> <p>(14) 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前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；</p> <p>(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(16) 本基金参与国债期货、股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2) 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%；</p> <p>3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>4) 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%；</p> <p>5) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；</p>
--	--	---

<p>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%；</p> <p>6) 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%；</p> <p>7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>8) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>（20）本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；</p> <p>3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；</p> <p>（21）本基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的全部中小企业私募债总市值不得超过基金资产净值的 20%；</p>	<p>6) 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%；</p> <p>7) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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；</p> <p>8) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>（17）本基金参与股票期权交易，需遵守下列投资比例限制：</p> <p>1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>2) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；</p> <p>3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；</p> <p>（18）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；</p> <p>（19）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第（2）、（10）、（14）、（15）项外，因</p>
---	---

	<p>(22) 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；</p> <p>(23) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第(2)、(13)、(17)、(18)项外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。</p> <p>法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。</p>	<p>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。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。</p> <p>创业板指数从创业板股票中选取100只组成样本股，反映创业板市场层次的运行情况。</p> <p>创业板指数与深证成份指数、中小板指数共同构成反映深交所上市股票运行情况的核心</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>中证全指指数收益率*80%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*15%</p> <p>中证全指指数由剔除ST、*ST股票，以及上市时间不足3个月等股票后的剩余股票构成样本股，该指数编制合理、透明，有一定市场</p>

	<p>指数。创业板指数样本股调整每季度进行一次，以反映创业板市场快速成长的特点。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数，选样债券信用类别覆盖全面，期限构成宽泛。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。</p> <p>如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。</p>	<p>覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力。适合作为本基金 A 股投资部分的业绩比较基准。中证港股通综合指数由中证指数有限公司发布的指数，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的一种股价指数。银行活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。</p> <p>若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，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，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，且无需召开基金份额持有人大会。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担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。</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</p> <p>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</p>

		<p>有人的利益；</p> <p>2、不谋求对上市公司的控股；</p> <p>3、有利于基金财产的安全与增值；</p> <p>4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不正当利益。</p> <p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
<p>第十三部分</p> <p>基金的财产</p>	<p>四、基金财产的保管和处分</p> <p>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。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</p> <p>基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。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>第十四部分</p> <p>基金资产估值</p>	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、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</p> <p>基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、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>三、估值原则</p> <p>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。</p> <p>（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。</p> <p>与上述投资品种形同，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。</p> <p>（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。</p>
--	--	---

		<p>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。</p> <p>（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。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>（1）交易所上市的有价证券（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；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>（4）交易所上市交易的可转换债券（含可交换债券）以每日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；</p>
<p>第十四部分</p>	<p>三、估值方法</p>	<p>四、估值方法</p>

<p>基金资产估值</p>	<p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>（2）首次公开发行未上市的股票和债券，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>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>4、中小企业私募债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>第十四部分 基金资产估值</p>	<p>三、估值方法</p> <p>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</p>	<p>四、估值方法</p> <p>9、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。</p> <p>11、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。</p> <p>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</p>

	一致的意见，按照基金管理人 对基金资产净值的计算结果对外予以公布。	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。
第十四部分 基金资产估值	<p>四、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p>	<p>五、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个估值日闭市后，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。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>五、估值错误的处理</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。</p>	<p>六、估值错误的处理</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，并报中国证监会备案。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；</p>	<p>七、暂停估值的情形</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50% 以上的，基金管理人经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>七、基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露的基金资产净值和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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金</p>	<p>八、基金净值的确认</p> <p>基金资产净值和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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基</p>

	<p>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。</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估值方法的第11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>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。</p> <p>九、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第12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>
第十四部分 基金资产估值		<p>十、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户的基金份额净值。</p>
第十五部分 基金费用与 税收		<p>一、基金费用的种类</p> <p>9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；</p>
第十五部分 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>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3—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>
第十五部分 基金费用与 税收	<p>四、基金税收</p> <p>本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。</p>	<p>四、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p>

		<p>五、基金税收</p> <p>本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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。</p>
<p>第十六部分</p> <p>基金的收益与分配</p>	<p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。</p> <p>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。</p>	<p>五、收益分配方案的确定、公告与实施</p> <p>本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。</p>
<p>第十六部分</p> <p>基金的收益与分配</p>		<p>七、实施侧袋机制期间的收益分配</p> <p>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</p>
<p>第十七部分</p> <p>基金的会计与审计</p>	<p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p>	<p>二、基金的年度审计</p> <p>1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。</p>
<p>第十八部分</p> <p>基金的信息披露</p>	<p>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。</p>	<p>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》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。</p>
<p>第十八部分</p> <p>基金的信息披露</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的</p>

	网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。	互联网网站(以下简称“规定网站”)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。
第十八部分 基金的信息 披露	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: (一)基金招募说明书、基金合同、基金托管协议	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: (一)基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要
第十八部分 基金的信息 披露	(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。	(六)基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。
第十八部分 基金的信息 披露	(八)澄清公告 在基金合同存续期限内,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。	(八)澄清公告 在基金合同存续期限内,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。
第十八部分 基金的信息 披露	(十四)中小企业私募债的投资情况 本基金投资中小企业私募债后两个交易日内,基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债的名称、数量、期限、收益率等信息,并在季度报告、中期报	(十四)港股通标的股票的投资情况 基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。

	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。	
第十八部分 基金的信息披露		（十六）实施侧袋机制期间的信息披露 本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。
第十八部分 基金的信息披露	八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。	八、暂停或延迟信息披露的情形 1、不可抗力； 2、发生暂停估值的情形； 3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。
第十九部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	二、基金合同的变更 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。	二、基金合同的变更 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。
第十九部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	三、基金合同的终止事由 有下列情形之一的，基金合同应当终止： ……	三、基金合同的终止事由 有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止： ……
第十九部分 基金的合并	四、基金财产的清算 5、基金财产清算的期限为6个月。	四、基金财产的清算 5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基

<p>并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>		<p>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>
<p>第十九部分 基金的合并、基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>七、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p> <p>八、基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。</p>	<p>七、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>八、基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不少于法定最低期限。</p>
<p>第二十一部分 争议的处理和适用的法律</p>	<p>各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。</p> <p>争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>基金合同受中国法律管辖。</p>	<p>各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。</p> <p>争议处理期间，基金管理人和基金托管人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>基金合同受中国法律管辖。</p>

第二十二部 分 基金合 同的效力	基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在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。	基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。 1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章并在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。
---------------------------------	---	--

除上述调整需要修改基金合同以外，基金管理人需要根据现行有效的法律法规要求及变更后的中欧量化驱动混合型证券投资基金的产品特征修订《中欧量化驱动混合型证券投资基金托管协议》、《中欧量化驱动混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人修订托管协议和招募说明书。

自本次基金份额持有人大会决议生效并公告的下一个工作日起，上述修订后的《基金合同》条款开始执行。

三、基金管理人就方案相关事项的说明

（一）中欧量化驱动混合型证券投资基金基本情况

中欧量化驱动混合型证券投资基金经 2017 年 8 月 15 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的证监许可[2017]1519 号文注册，进行募集。基金合同于 2018 年 5 月 16 日正式生效。基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

（二）基金合同修改的可行性

1、法律可行性

根据《基金合同》约定，当出现或需要决定变更基金投资范围的事项时，应当召集基金份额持有人大会。按照《基金合同》的要求，基金份额持有人大会的一般决议需经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效。

因此，本基金《基金合同》的修改不存在法律方面的障碍。

2、技术运作可行性

本次基金合同修改不涉及基金管理人、基金托管人和登记机构的变更，技术上可以保障基金份额持有人大会顺利召开和基金份额持有人大会决议顺利执行。

为实现基金合同修改的平稳过渡，本基金管理人与登记机构已就基金变更有关的会计处理、登记、系统准备等方面进行了深入研究，已经做好了基金合同修改的相关准备。

四、本基金基金合同修改的主要风险及预备措施

（一）预防基金合同修改方案被基金份额持有人大会否决的风险

为防范基金合同修改方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，在履行相关程序后进行适当修订，并重新公告。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如基金合同修改方案未获得基金份额持有人大会批准，则基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交新的基金合同修改方案议案。

（二）预防基金合同修改后基金运作过程中的相关运作风险

基金管理人将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金合同修改后基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

五、反馈及联系方式

投资者若对本方案的内容有任何意见或建议，欢迎及时反馈给本基金管理人。

联系人：中欧基金管理有限公司客服中心

联系电话：021-68609700

传真：021-33830351

网站：www.zofund.com