

嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

嘉合基金管理有限公司已于2019年1月5日在《证券时报》和嘉合基金管理有限公司网站(www.haoamc.com)发布了《嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。并于2019年1月7日在上述报纸和网站发布了《嘉合基金管理有限公司关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布关于召开本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关约定,嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金管理人嘉合基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)经与基金托管人渤海银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)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,审议关于本基金转型相关事宜。会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2019年1月9日起,至2019年2月11日17:00止(送达时间以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准)。

3、会议表决票送达至以下地址的收件人:

收件人:嘉合基金管理有限公司

地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼1层

邮政编码:200082

联系人:商林华

联系电话:400-0603-299

请在信封表面注明:“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式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

《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》(见附件一)。

上述议案的说明详见《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》(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2019年1月9日,即2019年1月9日下午交易时间结束后,在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人(包括A类基金份额和C类基金份额)均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印附件二或登录基金管理人网站(www.haoamc.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与开户时一致的业务专用章（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、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等）；

(3) 合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件（包括使用的身份证、护照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、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；

(4) 以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等文件，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于会议投票表决规定时间内（自 2019 年 1 月 9 日起，至 2019 年 2 月 11 日 17:00 止，送达时间以表决票收件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公告第一条第 3 项所述的地址（上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 A 楼 1 层），并请信封表面注明：“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

五、授权

为便于基金份额持有人参与本次大会，除直接投票外，基金份额持有人还可以委托代理人代其行使表决权。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金份额持有人大会的表决权。基金份额持有人授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数量以登记机构的登记为准。

（二）代理人

基金份额持有人可以委托符合法律规定的机构和個人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人仅可通过纸面授权方式授权代理人代为行使表决权。

授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印附件三或登录基金管理人网站（www.haoamc.com）下载并打印授权委托书样本。

1、基金份额持有人进行授权所需提供的文件

(1) 个人基金份额持有人委托他人投票的，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（参照附件三），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。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，还需提供该代理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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

(2) 机构基金份额持有人委托他人投票的，代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（参照附件三），并在授权委托书上加盖该机构持有人的公章，并提供该机构持有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、开户证明或其他登记证书复印件等）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件（包括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，还需提供该代理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、开户证明或其他登记证书复印件等）。

(3) 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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或其他登记证书复印件等)。

(4) 以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等文件, 以基金管理人的认可为准。

2、授权效力确定规则

(1) 基金份额持有人以非纸面方式进行授权的, 为无效授权。

(2) 如果同一基金份额持有人存在多次有效授权的, 以最后一次有效授权为准。若不能确定最后一次有效授权的, 则按如下原则处理:

①多次有效授权中, 代理人相同的, 视为委托人授权该代理人行使表决权;

②多次有效授权中, 代理人不同的, 视为无效授权。

(3) 如委托人在授权委托表示中未明确其表决意见的, 视为委托人授权代理人按照代理人的意志行使表决权。

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

(5) 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、计票

1、本次通讯会议的计票方式为: 由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(渤海银行股份有限公司)授权代表的监督下在本公告载明的表决日期截止后 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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定规则如下:

(1) 表决票通过专人送交、邮寄送达本公告指定的收件人的, 表决票送达时间以收到时间为准。2019 年 1 月 9 日之前以及 2019 年 2 月 11 日 17: 00 以后送达收件人的表决票, 均为无效表决票。

(2) 表决票的效力认定

①表决票填写完整清晰, 所提供文件符合本公告规定, 且在截止时间之前送达本公告指定的收件人的, 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如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或无法辨认, 但其他各项符合本公告规定的, 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未填写或填写不完整、不清晰的, 或未能提供有效证明基金份额持有人身份, 或代理人经有效授权的证明文件的, 或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的, 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送达表决票的, 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:

i. 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;

ii. 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, 该表决意见视为弃权, 计入有效表决票;

iii. 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, 邮寄的以指定联系地址收到的时间为准。

七、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的, 基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权

益登记日本基金总份额的二分之一（含二分之一）；

- 2、《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》应当由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）通过方为有效；
- 3、基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，基金管理人应当自决议通过之日起5日内报中国证监会备案。

八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》的规定及《基金合同》的约定，本次持有人大会需要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代表的本基金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。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《基金法》的规定和《基金合同》的约定，基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。

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

九、本次大会相关机构

1、召集人：嘉合基金管理有限公司

联系地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼1-2层

邮政编码：200082

联系人：商林华

联系电话：400-0603-299

网址：www.haoamc.com

2、基金托管人：渤海银行股份有限公司

联系地址：天津市河东区海河东路218号

邮政编码：300012

联系人：秦彦

联系电话：022-58555941

3、公证机构：上海市东方公证处

联系地址：上海市静安区凤阳路598号

邮政编码：200041

联系人：林奇

联系电话：021-62154848

4、见证律师：上海市通力律师事务所

联系地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：021-31358666

十、重要提示

- 1、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，确保表决票于表决截止时间前送达。
- 2、上述基金份额持有人大会有关公告可通过嘉合基金管理有限公司网站（www.haoamc.com）查阅，投资者如有任何疑问，可致电400-0603-299咨询。
- 3、基金管理人将在发布本公告后，在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嘉合基金管理有限公司解释。

嘉合基金管理有限公司

2019年1月8日

附件一：《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议

案》

附件二：《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》

附件一：

关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型
并修改基金合同等有关事项的议案

嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人：

为了优化基金的投资运作管理，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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人嘉合基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与基金托管人渤海银行股份有限公司协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议对本基金进行转型，调整基金名称、基金运作方式、基金投资目标、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、基金费用等内容，并修订基金合同等事项。具体说明详见附件四《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过，基金管理人将根据《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明》的有关内容对《基金合同》进行修改。本基金的招募说明书及托管协议也将进行必要的修改或补充。

以上议案，请予审议。

嘉合基金管理有限公司

2019年1月8日

附件二：

嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：

证件号码(身份证件号/营业执照号/其他)：

基金账户号：

代理人姓名或名称（如有）：

代理人证件号码（身份证件号/营业执照号/其他）（如有）：

审议事项 同意 反对 弃权

关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发
起式证券投资基金转型并修改基金合同等
有关事项的议案

基金份额持有人（代理人）签名或盖章：

201 年 月 日

说明：

1、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。“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，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额

持有人所持有的本基金所有份额，不影响表决票的效力。

2、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（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。

3、如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，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。如表决票上的签字或盖章部分未填写或填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份，

或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，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、表决票应附持有人及其代理人的有效身份证明文件复印件。表决票效力认定的其他规则详见本次持有人大会公

告。

5、本表决票可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（www.haoamc.com）下载并打印。

附件三：

授权委托书（样本）

兹全权委托 先生 / 女士或 机构代表本人（或本机构）参加投票截止日为 年 月 日的以通讯开会方式召开的嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会。

本授权不得转授权。若在法定时间内就同一议案重新召开基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：_____

委托人证件号码（身份证件号或营业执照号）：_____

委托人基金账户号：_____

代理人（签字/盖章）：_____

代理人证件号码（身份证件号或营业执照号）：_____

签署日期： 年 月 日

附注：

1、此授权委托书剪报、复印或登录基金管理人网站（www.haoamc.com）下载并打印，填写完整并签字盖章后均为有效。

2、本授权委托书（样本）中“委托人证件号码”，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。“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，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额，不影响授权委托书效力。

3、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

附件四：

关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的说明

一、声明

1、嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同于 2018 年 3 月 21 日生效。为了优化基金的投资运作管理，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《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，本基金管理人嘉合基金管理有限公司经与基金托管人渤海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《关于嘉合

睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》。

2、本次修改合同事项需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)通过方为有效,存在无法获得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,本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案。

4、中国证监会对本次修改基金合同所作的任何决定或意见,均不表明其对本次修改基金合同后基金的价值或投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、转型方案要点

(一) 变更基金名称

基金名称由“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金”变更为“嘉合睿金混合型发起式证券投资基金”。

(二) 变更基金运作方式

基金运作方式由“契约型开放式,以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式”变更为“契约型开放式”。将本基金原规定的3个月封闭期,定期开放申赎的运作方式变更为每日开放申赎运作。

(三) 调整基金的投资目标、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准

1、调整后的投资目标

“本基金在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值。”

2、调整后的投资组合比例

“基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为50%—95%,持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除股指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%的现金或到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。”

3、调整后的投资策略

“本基金将秉持战略和战术资产配置理念,通过稳健管理的多策略投资系统,在控制市场风险、尽量降低净值波动风险并满足流动性的前提下,动态投资于股票、债券、现金及现金等价物等资产品种并运用股指期货等各种金融工具提高收益率。”

(一) 大类资产配置策略

本基金在严格遵守《基金合同》关于投资比例限制的约束下,合理运用基于量化模型、基于市场价量、基于宏观基本面等多指标体系的大类资产配置模型,动态控制风险资产的仓位,获取股票、债券、货币等低相关性、多资产类别的周期性轮动收益,在获得资产上行收益的同时,有效控制下行风险,做到合理的多元化分散投资,实现投资组合整体的收益风险优于单一大类资产。

(二) 股票的投资策略

1、中观大小盘风格轮动策略

本基金通过构建大类资产的中观配置模型,来获取超越该大类资产的市场平均收益。例如,股票投资的中观配置模型中运用市场情绪模型和动量模型来捕获包括大小盘风格轮动等中观资产层面的超额收益;市值风格情绪模型通过监控市场中大盘、中小盘股票的涨跌统计分布,判断市场对于各市值风格的偏好取向的变化,投资于市场最“倾向”的市值风格。

2、微观行业轮动及选股策略

本基金通过对长期、中期、短期的财务指标、技术指标等构建高有效性的行业轮动模型和多因子选股模型,构建能持续稳定超越沪深300指数的超额收益的股票组合。例如,低估值因子通过合理运用PE等估值指标并设计相应的交易规则来捕获此类因子的超额收益;反转因子投资于跌幅居前的特征股票组合,获取不同阶段超跌反弹或者趋势反转带来的超额收益;动量因子投资于动量居前的特征股票组合,获取动量延续或者放大的超额收益。

(三) 债券的投资策略

本基金的债券投资主要为获取稳定性的固定收益,因此主要投资于国债、评级较高的地方政府债券以及安

全性较高的公司债和企业债等品种。

本基金通过动态调整债券的投资比例,在一定程度上规避股票市场的投资风险,获得相对稳定的投资收益。结合市场利率趋势及信用环境变化情况等,综合判断各类券种的风险收益水平,构造债券的投资组合。

(四) 可转换债券的投资策略

本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,以合理价格买入并持有。

(五) 资产支持证券的投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征,估算违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。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。

(六) 中小企业私募债券的投资策略

在控制信用风险和流动性风险的基础上,本基金对中小企业私募债券投资取更为谨慎的投资策略。本基金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。

(七) 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。本基金进行权证投资时,将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合隐含波动率、剩余期限、标的证券价格走势等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合,力求取得最优的风险调整收益。

(八) 股指期货投资策略

本基金进行股指期货的投资以套期保值为主要目的,本基金投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过对股票市场和股指期货市场短期和中长期趋势的研究,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。多头套期保值指当基金需要买入现货时,为避免市场冲击,提前建立股指期货多头头寸,然后逐步买入现货并解除股指期货多头,当完成现货建仓后将股指期货平仓;空头套期保值指当基金需要卖出现货时,先建立股指期货空头头寸,然后逐步卖出现货并解除股指期货空头,当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中,将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性,精细化确定投资方案比例。若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。”

4、调整后的投资限制

“1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

- (1) 股票资产占基金资产的比例为 50%—95%;
- (2) 每个交易日日终在扣除股指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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
- (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) 本基金应投资于主体信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用级别评级下降、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) 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；

(14) 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；

(15) 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%；

(16) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(17) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的 15%；

(18) 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，不超过该上市公司可流通股票的 30%；

(19) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

(21) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列限制：

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%；

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

3) 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%；

4) 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个交易日基金资产净值的 20%；

5) 在任何交易日日终，持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(22) 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。

除上述投资限制（2）、（12）、（19）、（20）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。

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。在此期间，基金的投资范围和投资策略应该符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定执行。”

5、调整后的业绩比较基准

“沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。

中债综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合全价指数各项指标值的

时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。

本基金是混合型基金，在综合考虑了上述指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，选用上述业绩比较基准能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金的业绩表现。

如果法律法规发生变化、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人与基金托管人协商一致后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。”

（四）变更基金费用

1、基金管理人的管理费由“本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6 %年费率计提”变更为“本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2 %年费率计提”。

2、基金的销售服务费由“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年费率为 0.1%”变更为“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年费率为 0.8%”。

3、本基金 C 类基金份额的赎回费率变更如下：

持有期限（N 为日历日） 赎回费率 计入基金财产比例

1 日 ≤ N < 7 日 1.50% 100%

7 日 ≤ N < 30 日 0.50% 100%

N ≥ 30 日 0% -

（五）其他修改内容

在根据上述转型方案的要点修改《基金合同》的同时，对《基金合同》其他部分条款一并进行了修改，具体请见“附表：基金合同修订对照表”。

（六）转型选择期的相关安排

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本次基金份额持有人大会决议生效后，将在转型正式实施前安排不少于 20 个开放日的选择期，以供基金份额持有人做出赎回、转出等选择，具体时间安排详见管理人届时发布的相关公告。

对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，将继续持有转型后的嘉合睿金混合型发起式证券投资基金。在选择期期间，由于本基金需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免《基金合同》中约定的投资组合比例限制等条款。基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人据此落实相关事项，并授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。

（七）授权基金管理人办理本次基金转型和基金合同等法律文件修改的有关具体事宜

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据上述转型方案对《基金合同》等法律文件进行修改和补充，同时基金管理人在转型实施前，将根据基金份额持有人大会的授权，制订相关转型安排规则并提前公告。

三、基金转型的主要风险及预备措施

（一）转型方案被基金份额持有人大会否决的风险

在设计转型方案之前，基金管理人已对部分基金份额持有人进行了走访，认真听取了基金份额持有人意见，拟定议案综合考虑了基金份额持有人的要求。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对基金转型方案进行适当的修订，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。若本次基金份额持有人大会表决事项未获通过，基金管理人计划按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交本基金转型并修改基金合同等方案议案。

（二）基金转型后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，避免基金转型后的基金运作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

（三）基金转型公告后遭遇大规模赎回的风险

为降低部分基金份额持有人在基金转型后赎回对基金平稳运作的影响，在基金转型之后，基金管理人将择

机进行持续营销，可在很大程度上降低转型对本基金规模的影响。

四、基金管理人的联系方式

持有人若对本方案的内容有任何意见和建议，请通过以下方式联系基金管理人：

嘉合基金管理有限公司

联系电话：400-0603-299

网站：www.haoamc.com

附表：基金合同修订对照表