

华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

根据华润元大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）于2019年7月30日发布的《华润元大基金管理有限公司关于以通讯方式召开华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，基金管理人决定以通讯方式召开华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金份额持有人大会，审议关于修改本基金基金合同等有关事项。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据法律法规及基金合同的相关规定，现将具体事宜提示如下：

一、召开会议基本情况

本基金于2014年8月18日成立，并于2018年9月17日收到中国证券监督管理委员会《关于准予华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2018]1499号），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》等法律法规和《华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人中国农业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，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8月1日起，至2019年9月2日17:00止（送达时间以本公告列明的收件人收到表决票时间为准）。

3、会议计票日：2019年9月3日

4、会议通讯表决票的提交：

收件人：丁青松

地址：深圳市福田区深南大道4013号兴业银行大厦17楼1706（深圳公证处）

邮编：518000

联系电话：0755-83024185

请在信封表面注明：“华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

基金份额持有人或其代理人可通过专人送交、邮寄送达至上述地址的上述收件人。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话4000-1000-89（免长途费）咨询。

二、会议审议事项

《关于修改华润元大医疗保健量化混合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详见附件四《关于修改华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》

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 8 月 1 日，即在 2019 年 8 月 1 日下午交易时间（15:00）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与本次基金份额持有人大会并投票表决（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

四、表决票的填写和寄交方式

本次基金份额持有人大会提供纸质投票方式：

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、复印表决票或登录本基金管理人网站（www.cryuantafund.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正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下简称“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，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）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正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖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（见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖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(见附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖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,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指定联系地址(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指定联系地址,具体地址和联系方式为:

收件人:丁青松

地址:深圳市福田区深南大道 4013 号兴业银行大厦 17 楼 1706 (深圳公证处)

邮编: 518000

联系电话: 0755-83024185

请在信封表面注明:“华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资人如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话 4000-1000-89 (免长途费) 咨询。

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(中国农业银行股份有限公司)授权代表的监督下于本次通讯会议表决截止日期后 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每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1) 表决票填写完整清晰,所提供文件符合本公告规定,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,其他要件均符合本公告的规定,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，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。

六、决议生效条件

1、基金份额持有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），则本次通讯开会视为有效；

2、本次议案应当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；

3、基金份额持有人大会的决议，将由本基金管理人自通过之日起 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》的规定及《基金合同》的约定，基金管理人可另行确定并公告重新开会的时间和地点。

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、召集人：华润元大基金管理有限公司

办公地址：深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 7 层

联系电话：4000-1000-89（免长途费）

传真：0755-88399045

网址：www.cryuantafund.com

2、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

3、公证机关：深圳公证处

4、见证律师：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热线：4000-1000-89（免长途费）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、根据基金合同的约定，本次基金份额持有人大会费用以及公证费、律师费等相关费用自基金资产列支。

5、如本次基金份额持有人大会不能成功召开，根据基金合同的有关约定，本基金可能会在规定时间内重新召开基金份额持有人大会。

6、本公告的有关内容由华润元大基金管理有限公司负责解释。

华润元大基金管理有限公司

2019年8月1日

附件一：关于修改华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同等有关事项的议案

附件二：华润元大医疗保健量化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：关于修改华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明

附件五：华润元大量化优选混合型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表

附件一：

关于修改华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同等有关事项的议案

华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人：

为应对复杂多变的证券市场环境，维护基金份额持有人的利益，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》等法律法规和《华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国农业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，提议修改本基金名称为“华润元大量化优选混合型证券投资基金”并调整本基金以下内容：1.调整投资范围；2.调整投资策略；3.修改业绩比较基准；4.增设C类份额；5.根据前述变更及现行有效

的法律法规相应修订基金合同和其他法律文件。基金合同的具体修改内容详见附件四《关于修改华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》以及附件五《华润元大量化优选混合型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表》。

修改后的《基金合同》生效时间将另行公告。在《基金合同》生效后 3 个交易日内，原华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金份额持有人可提交转换申请，将原份额转换为变更注册后的华润元大量化优选混合型证券投资基金 C 类份额，转换后的持有期自转换申请确认日开始计算，本次转换不收取转换费用；若客户未提交转换申请，则默认将原份额自动划归为变更注册后的华润元大量化优选混合型证券投资基金 A 类份额。在《基金合同》生效后 3 个交易日后，华润元大量化优选混合型证券投资基金 A、C 份额之间不得相互转换。

以上议案，请予审议。

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

2019 年 8 月 1 日

附件二：

华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

■

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.cryuantafund.com）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）附件三：

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 日的以通讯方式召开的华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。若华润元大医疗保健量化混合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。

3、受托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。

4、如基金份额持有人就同一基金份额一次授权多个受托人或多次授权的，能够区分先后次序的，以最后一次授权为准；授权无法区分授权次序，但多次有效的授权意见一致的，以一致的授权表示为准；授权无法区分授权次序，且授权意见不一致的，视为弃权表决票。

5、如基金份额持有人既进行委托授权，又送达了有效表决票的，则以有效的表决票为准，授权视为无效。

6、授权委托书中委托人所持基金的份额以持有人大会权益登记日为准。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，则其授权委托书无效。

附件四：

关于修改华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金
基金合同有关事项的说明

一、声明

1、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）成立于2014年8月18日，基金代码为000646。依据2014年8月8日颁布实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，本基金于2015年8月3日变更基金类型，由股票型基金变更为混合型基金。依据中国证监会2017年8月31日发布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》，本基金于2018年3月30日对基金合同的相关条款进行修订并公告。为应对复杂多变的证券市场环境，更好地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》等法律法规和《华润元大医疗保健量化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农业银行股份有限公司协商一致，提议将本基金变更注册为华润元大量化优选混合型证券投资基金。基金合同修改的主要内容包括调整投资范围、投资策略、业绩比较基准，增设C类份额等内容。

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《关于修改华润元大医疗保健量化混合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以上（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，基金管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案。中国证监会对本次华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金持有人大会决

议的备案，均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、方案要点

(一) 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（含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、短期融资券、超短期融资券、次级债券、中期票据、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换公司债券、可分离交易可转债等）、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券等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）。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：本基金股票投资比例范围为基金资产的 **60%-95%**，投资港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 **50%**。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，现金或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%**，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

在基金实际管理过程中，本基金具体资产配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡，但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下，基金管理人可对上述比例做适度调整。

(二) 修改投资策略

修改后为：

本基金在投资中将以基金的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，采用量化选股模型，并将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。

1、大类资产配置策略

本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素以及证券市场的演化趋势，评估股票、债券等各类资产的预期收益和风险，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。

(1) 宏观经济因素方面，考量因素包括但不限于居民消费价格指数（CPI）、工业品出厂价格指数（PPI）、狭义货币供应量（M1）、广义货币供应量（M2）、固定资产投资增长率、工业企业增加值、采购经理人指数（PMI）、消费品零售增长率、汇率、贸易盈余、大宗商品库存及价格变化等定量因素，评估宏观经济变量变化趋势。

(2) 政策法规因素方面，主要关注政府货币政策和财政政策，考量因素包括但不限于社会总需求、社会总供给、物价和利率水平，影响因素有：税制变化、政府支出及转移支付、国债发行、利率水平、信贷规模以及存款准备金率等。

(3) 证券市场表现因素方面主要关注市场估值和技术指标分析，考量因素包括但不限于市场整体估值水平、各行业及板块相对估值水平、一致预期估值水平、大势型技术指标、超买超卖型技术指标、趋势型技术指标、成交量型技术指标、均线型技术指标等。

而在实际执行上，本基金将依据上述宏观经济因子在基金投资模型中所产生的投资信号，实施即时性的动态资产配置调整，通过持仓比例的实时调整，有效增强基金收益并降低投资风险。

2、股票投资策略

本基金将运用量化选股模型，运用量化多因子选股、事件驱动选股策略，力求寻找基本面良好，并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时，本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。主要包括但不限于以下投资策略：

(1) 多因子选股策略

根据对国内证券市场运行特征的长期研究、投资研究团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了多因子选股模型。多因子选股模型的基本原理是采用一系列的优选因子作为选股标准，从多个因子维度对个股进行打分，据此筛选出满足条件的投资组合。

一般情况下，多因子模型的构建需进行因子筛选，考虑成长、估值、盈利能力等多个维度大类因子及其项下的各细分小类因子，然后确定各因子的权重并根据市场环境变动进行动态调整。具体来说主要可以归结为以下几个步骤：

a. 因子的筛选

基金管理人量化投资团队在多年研究积累的基础上，对市场上存在的有效因子进行深入研究，通过全面的数据分析及多维度的测算，优选出符合逻辑、超额收益相较明显以及相对稳定的因子作为构建多因子组合的备选因子。本基金多因子选股模型因子池的构建主要考虑成长、估值、盈利能力等多个维度大类因子及其项下的各细分小类因子，同时也包括股票价格波动相关的各类因子，例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性，根据市场状况结合因子变化趋势，动态选取最优因子构建股票多头组合，并根据市场变化趋势，对模型进行因子调整，以改进模型的有效性。

b. 因子权重确定

本基金结合各因子历史具体表现对其权重在不同市场环境下进行动态调整，力求准确把握市场环境。

c. 因子的定期调整

在覆盖主流有效选股因子的前提下，本基金将优选历史环境相似的行情因子配置，动态优选表现优异因子，剔除表现不佳的因子，自动适应市场环境变化带来因子失效问题。

（2）事件驱动策略

事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，分析出重大事件与股价波动间的历史规律，通过充分把握事件机会获取超额投资回报的交易策略。事件驱动策略中的事件是指具有较为明确的时间和内容，能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响，从而决定股价短期波动的因素的事件，如高送转事件、资产重组事件、定向增发事件、业绩预增、股东增持以及股票回购事件等。

本基金将尽力发掘和深入分析可能为个股带来超额收益的事件，对本基金事件驱动模型中所采用的事件进行优选，充分把握事件驱动策略为股票投资带来的超额投资回报。

（3）股票投资组合的风险控制

在风险控制方面，本基金将通过组合优化模型实现对相对风险和相对回撤的有效控制。相关性较低的多策略相结合也可有效降低组合风险，动态优化组合收益，有利于基金资产的长期稳定增值。

（4）港股通标的股票投资策略

对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制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。股票筛选方法上，将运用多因子选股模型，主要的因子包括盈利、估值、成长、动量、现金流、股息率、流动性等，并特别关注与A股相关性较弱效果又好的因子模型。另外，本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票市场投资策略外，还需关注：

- 1) 香港股票市场与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面。
- 2) 港股通每日额度应用情况。
- 3) 人民币与港币间的汇兑比率变化。

3、债券投资策略

本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

4、股指期货投资策略

本基金将以股指期货为主要的金融衍生工具，与资产配置策略进行搭配。因为在基金实际操作上，当量化模型出现买卖讯号时，基金经理在进行一篮子股票的买卖可能会发生时效性的

情况，此时可利用股指期货灵活快速进出的优势，除了达到量化模型的有效性，并可降低交易成本，为实际的投资操作提供多一项选择。

5、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

6、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

7、现金管理

在现金管理上，本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理，及时满足本基金运作中的流动性需求。

（三）修改业绩比较基准

修改后为：

本基金业绩比较基准为：**沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%+中证国债指数收益率*30%**

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数；该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。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。中证国债指数是由中证指数公司编制，于 2008 年推出的覆盖银行间市场和交易所市场的国债指数。中证国债指数通过对银行间市场和交易所市场交易、剩余期限在一年以上的国债，采用发行量派许加权计算的综合价格指数，可以准确反映高信用固定收益债券的价格走势，具有较强的代表性，可以作为本基金债券投资部分的基准。如果今后法律法规发生变化，或本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布，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比较基准的指数时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，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，而无需召开基金份额持有人大会。

（四）增设 C 类份额

修改后为：本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不计提销售服务费的基金份额类别，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，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为C类基金份额。

（五）其他修改

详见附件五

三、基金合同的具体修订

详见附件五

附件五

本次基金合同的修改内容如《华润元大量化优选混合型证券投资基金基金合同旧版与新版修改条文对照表》所示，详见下表：

14-15 第六部分 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 1、本基金份额净值的计算，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。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。 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，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、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。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。 4、申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。 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。对持续持有期少于7日的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期少于30日的投资人收取不低于0.75%的赎回费，赎回费应全额计入基金财产；对持续持有期少于3个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，不低于赎回费总额的75%应计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取不低于0.5%的赎回费，不低于赎回费总额的50%应计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，不低于赎回费总额的25%应计入基金财产。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途 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，分别计算和公布基金份额净值。本基金各类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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。 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。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，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。 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A类和C类基金份额的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类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。 4、A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用；C类基金份额不收取申购费用。 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详见招募说明书，未归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日的投资者收取不少于1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

16 第六部分 基金份额的申购与赎回 七、拒绝或暂停申购的情形 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。……发生上述第1、2、3、5、8、9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体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。 七、拒绝或暂停申购的情形 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，或发生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。发生上述第1、2、3、5、9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全部或部分被拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

18 第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （3）如果基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过基金总份额20%以上的赎回申请的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过20%以上的部分延期办理赎回申请。对于当日非延期的赎回申请，应当按单个账户非延期赎回申请量占非延期赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

27 第七部分 基金合同当事人及权利义务 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：（1）认真阅读并遵守基金合同；（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； 三、基金份额持有人 同一类别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：（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；（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，自行承担投资风险； 28 第八部分 基金份额持有人大会 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）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准； 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）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费； 28 第八部分 基金份额持有人大会 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、基金托管费和其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；（3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式； 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：（2）在法律法规和基金合同规定的范围内且在不影响现有基金份额持有人利益的前提下调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式； 29 第八部分 基金份额持有人大会 二、会议召集人及召集方式 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。二、会议召集人及召集方式 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。 29 第八部分 基金份额持有人大会 4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。 4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。 34 第八部分 基金份额持有人大会 八、生效与公告 基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会的决议自完成备案手续之日起生效。八、生效与公告 基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。 36 - 37 第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 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 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；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 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值； 37 第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二、基金管理人和基金托管人的更换程序（二）基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；二、基金管理人和基金托管人的更换程序（二）基金托管人的更换程序 6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。临时基金托管人或新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值； 42 第十二部分 基金的投资 一、投资目标 本基金主要投资于医疗保健行业股票，通过量化与基本面相结合的方法，精选优质上市公司，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，获取基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的长期收益。一、投资目标 本基金在有效控制风险的前提下，充分运用量化投资策略，力求基金资产长期增值。 42 第十二部分 基金的投资 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（含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的其他股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券等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）。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。未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的，本基金可参与同业存单的投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。基金的投资组合比例为：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，本基金投资医疗行业上市公司股票的比例不少于非现金基金资产的 80%，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，现金或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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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其他股票（含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的其他股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、短期融资券、超短期融资券、次级债券、中期票据、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换公司债券、可分离交易可转债等）、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券等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）。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：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，投资港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%。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，现金或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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 42 - 46 第十二部分 基金的投资 三、投资策略 1、大类资产配置策略（1）宏观经济因素方面，考量因素包括但不限于居民消费价格指数（CPI）、工业品出厂价格指数（PPI）、狭义货币供应量（M1）、广义货币供应量（M2）、固定资产投资增长率、工业企业增加值、采购经理人指数（PMI）、消费品零售增长率、汇率、贸易盈余、大宗商品库存及价格变化等定量因素，评估宏观经济变量变化趋势。（2）政策法规因素方面，主要关注政府货币政策和财政政策，考量因素包括但不限于社会总需求、社会总供给、物价和利率水平，影响因素有：税制变化、政府支出及转移支付、国债发行、利率水平、信贷规模以及存款准备金率等。（3）证券市场表现因素方面主要关注市场估值和技术指标分析，考量因素包括但不限于市场整体估值水平、各行业及板块相对估值水平、一致预期估值水平、大趋势型技术指标、超买超卖型技术指标、趋势型技术指标、成交量型技术指标、均线型技术指标等。而在实际执行上，本基金将依据上述宏观经济因子在基金投资模型中所产生的投资信号，实施即时性的动态资产配置调整，通过持仓比例的实时调整，有效增强基金收益并降低投资风险。 2、股票投资策略（1）医疗保健行业相关股票的界定：本基金将沪深两市从事医疗保健行业的上市公司定义为医疗保健行业上市公司，具体包括以下两类公司：1）主营业务从事医药保健行业（涵盖医药原料、化学原料药及制剂、医药中间体、中药材、中药饮片、中成药、抗生素、生物制品、生化药品、放射性药品、医疗器械、卫生材料、制药机械、药用包装材料、医药商业及医疗服务等）的公司；2）当前非主营业务提供的产品或服务隶属于医药保健行业，且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的公司。本基金为主题型基金，投资医疗保健行业上市公司股票的比例不少于非现金基金资产的 80%。（2）股票投资策略是本基金的核心部分，本基金将结合定量与定性分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力，选择具有长期持续增长能力的公司。 1）定量分析是建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型（Multiple Factors Alpha Model）的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理人团队开发的更具针对性和实用性的修正的多因子阿尔法选股模型。本基金采用的因子指标主要分为两大

类：①市场面因子 本基金管理人认为，市场面因子对市场的反应比较直接，比基本分析更能反应实际市场的局部现象；在一个非完全有效的市场中，这些因子对选择股票的表现具有一定的正面贡献。本基金主要采用的市场面因子包括绝对强弱指标和相对强弱指标等。

A、绝对强弱指标 通过比较一段时期内股票的绝对涨幅和股价走势的斜率高低来分析市场看好该股票的程度，从而判断未来市场的走势。

B、相对强弱指标 通过比较一段时期内的平均收盘涨数和平均收盘跌数来分析市场买卖盘的意向和实力，从而判断未来市场的走势。

②成长因子 本基金通过量化统计模型，建立企业成长因子库，根据历史表现，将直接能反映超额收益的成长因子作为本基金的成份因子。本基金入库的成长因子主要包含主营业务增长率、净利润增长率等。

A、主营业务增长率 主营业务增长率=(本期主营业务收入-上期主营业务收入总额)/上期主营业务收入 该指标通常是公司利润增长的前导指标，是分析公司投资价值的重要指标。主营收入快速增长往往意味着市场占有率的上升，这是公司竞争力提高的重要标志，体现了公司的持续成长能力。

B、净利润增长率 净利润增长率=(本期净利润额-上期净利润额)/上期净利润额 该指标反映的是企业实现价值最大化的扩张速度，是反映公司成长状况和发展能力的重要指标。本基金利用“多因子阿尔法模型”计算每只股票的因子加权得分，并挑选总分最高的若干个股构建投资组合。每隔一段时期，将重新计算个股加权因子得分，并以新得分为依据对股票投资组合进行调整，始终保证组合中个股具有相对较高的分值。在挑选多因子模型的过程中，量化研究团队并不以模型的复杂性为目的，而是以达到模型的有效性为最大考量。

2) 定性分析主要依赖基本面的研究，医疗保健行业的上市公司包含多个子行业，其发展阶段和分析方法也有所不同。在个股的精选上，本基金将着重选择那些独家产品或研发优势的具有护城河类定价权制药公司、拥有成熟医疗服务管理能力且有可复制性的医疗服务公司，或产品有较高准入门槛且市场空间广阔的医疗器械类公司等。因此，本基金将从上市公司的成长性、药品研发能力、公司管理能力、估值水平等方面对医疗保健行业的上市公司进行综合评价：

①成长性 本基金对医疗行业上市公司的成长性分析将包括定量及定性两方面。在定量的分析方法上，主要参考主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、净资产收益率(ROE)、毛利率等成长性指标。在实际投资操作中，本基金并不拘泥于单一成长性指标，而是将综合考虑上市公司的基本面后，最大程度地筛选出具有持续成长潜力的医疗主题上市公司。因此，在对上市公司成长性的定性分析上，本基金强调企业成长能力的可持续性，重点从行业成长空间、公司研发能力、管理能力、产品前景、费用控制能力、盈利能力、财务结构等方面进行研判。

②医药研发能力 本基金将选择那些产品具有较高技术含量优势或公司具有较强技术开发能力的上市公司，考虑的因素包括：药品的技术含量、药品的市场发展前景、技术成熟程度、研究经费投入规模、配套政策支持、研究成果转化的经济效果等。

③公司治理结构 公司治理结构的评估是指对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察，包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度，管理决策的执行和传达的有效性，股东会、董事会和监事会的实际执行情况，企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。因此，公司治理结构是决定公司评估价值的重要因素，也是决定上市公司盈利能力能否持续的重要因素。

④估值水平分析 基金管理人将对医疗主题的上市公司给予估值分析，并结合行业地位分析，优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估且在各自行业中具有领先地位的优质上市公司股票进行投资。本基金采用的估值方法包括市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)等。

三、投资策略 本基金在投资中将以基金的权益类资产和固定收益类资产配置为基础，采用量化选股模型，并将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。

1、大类资产配置策略 本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素以及证券市场的演化趋势，评估股票、债券等各类资产的预期收益和风险，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。

(1) 宏观经济因素方面，考量因素包括但不限于居民消费价格指数(CPI)、工业品出厂价格指数(PPI)、狭义货币供应量(M1)、广义货币供应量(M2)、固定资产投资增长率、工业企业增加值、采购经理人指数(PMI)、消费品零售增长率、汇率、贸易盈余、大宗商品库存及价格变化等定量因素，评估宏观经济变量变化趋势。

(2) 政策法规因素方面，主要关注政府货币政策和财政政策，考量因素包括但不限于社会总需求、社会总供给、物价和利率水平，影响因素有：税制变化、政府支出及转移支付、国债发行、利率水平、信贷规模以及存款准备金率等。

(3) 证券市场表现因素方面主要关注市场估值和技术指标分析，考量因素包括但不限于市场整体估值水平、各行业及板块相对估值水平、一致预期估值水平、大势型技术指标、超买超卖型技术指标、趋势型技术指标、成交量型技术指标、均线型技术指标等。而在实际执行上，本基金将依据上述宏观经济因子在基金投资模型中所产生的投资信号，实施即时性的动态资产配置调整，通过持仓比例的实时调整，有效增强基金收益并降低投资风险。

2、股票投资策略 本基金将运用量化选股模型，运用量化多因子选股、事件驱动选股策略，力求寻找基本面良好，并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时，本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。主要包括但不限于以下投资策略：

(1) 多因子选股策略 根据对国内证券市场运行特征的长期研究、投资研究团队的长期投资实践和大量历史数据的实证检验，基金管理人量化投资团队开发了多因子选股模型。多因子选股模型的基本原理是采用一系列的优选因子作为选股标准，从多个因子维度对个股进行打分，据此筛选出满足条件的投资组合。一般情况下，多因子模型的构建需进行因子筛选，考虑成长、估值、盈利能力等多个维度大类因子及其项下的各细分小类因子，然后确定各因子的权重并根据市场环境变动进行动态调整。具体来说主要可以归结为以下几个步骤：a. 因子的筛选 基金管理人量化投资团队在多年研究积累的基础上，对市场上存在的有效因子进行深入研究，通过全面的数据分析及多维度的测算，优选出符合逻辑、超额收益相较明显以及相对稳定的因子作为构建多因子组合的备选因子。本基金多因子选股模型因子池的构建主要考虑成长、估值、盈利能力等多个维度大类因子及其项下的各细分小类因子，同时也包括股票价格波动相关的各类因子，例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性，根据市场状况结合因子变化趋势，动态选取最优因子构建股票多头组合，并根据市场变化趋势，对模型进行因子调整，以改进模型的有效性。b. 因子权重确定 本基金结合各因子历史具体表现对其权重在不同市场环境下进行动态调整，力求准确把握市场环境。c. 因子的定期调整 在覆盖主流有效选股因子的前提下，本基金将优选历史环境相似的行情因子配置，动态优选表现优异因子，剔除表现不佳的因子，自动适应市场环境变化带来因子失效问题。

(2) 事件驱动策略 事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，分析出重大事件与股价波动间的历史规律，通过充分把握事件机会获取超额投资回报的交易策略。事件驱动策略中的事件是指具有较为明确的时间和内容，能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响，从而决定股价短期波动的因素的事件，如高送转事件、资产重组事件、定向增发事件、业绩预增、股东增持以及股票回购事件等。本基金将尽力发掘和深入分析可能为个股带来超额收益的事件，对本基金事件驱动模型中所采用的事件进行优选，充分把握事件驱动策略为股票投资带来的超额投资回报。

(3) 股票投资组合的风险控制 在风险控制方面，本基金将通过组合优化模型实现对相对风险和相对回撤的有效控制。相关性较低的多策略相结合也可有效降低组合风险，动态优化组合收益，有利于基金资产的长期稳定增值。

(4) 港股通标的股票投资策略 对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制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。股票筛选方法上，将运用多因子选股模型，主要的因子包括盈利、估值、成长、动量、现金流、股息率、流动性等，并特别关注与A股相关性较弱效果又好的因子模型。另外，本基金所投资香港市场股票标的除适用上述股票市场投资策略外，还需关注：1) 香港股票市场与大陆股票市场存在的差异对股票投资价值的影响，比如行业分布、交易制度、市场流动性、投资者结构、市场波动性、涨跌停限制、估值与盈利回报等方面。2) 港股通每日额度应用情况。3) 人民币与港币间的汇兑比率变化。

46 第十二部分基金的投资 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) 本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%，本基金投资医疗保健行业上市公司股票的比例不少于非现金基金资产的80%；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) 本基金股票投资比例范围为基金资产的60%-95%，投资港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的50%；46 第十二部分基金的投资 四、投资限制 1、组合限制 (3) 本基金持有一家上市公司的股票，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%；四、投资限制 1、组合限制 (3) 本基金持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算)，其市值不超过基金资产净值的10%；(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 在内地和香港同时上市的 A+H 股合计 计算），不超过该证券的 10%； 46

四、投资限制 1、组合限制 （5） 本基金在任何交易日买入权证 的总金额， 不超过上一交易日基金资产 净值的 0.5%， 本基金持有的全部权证 的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管 理人管理的全部基金持有同一权证 的比例不超过该权证的 10%； 四、投资限制 1、组合限制 （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 0.5%， 本基金持有的全部权证 的市值不得超过基金资 产净值的 3%，基 金管理人管理的全部基金持有同一权证 的比例不得超过该权证的 10%； 第十二部分基金 的投资 四、投资限制 1、组合限制 （13） 本基金投资流通受限证券，基 金管理人应事先根据中国证监会相关规 定， 与基金托管人在本基金托管协议中 明确基金投资流通受 限证券的比例，根 据比例进行投资； 四、投资限制 1、组合限制 删除 47 第十二部分基金 的投资 四、投资限制 1、组合限制 四、投资限 制 1、组合限制 （18）本基金的基金资产总值不得超 过基金资产净值的 140%； 48 第十二部分基金 的投资 四、投资限制 1、组合限制 除 上述第（2）、（10）、（20）、（21）项 外，因证券、期货市场波动、上市公司合 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 个工作日内进行 调整，法律法规另有规定的，从其规 定。 基金管理人应当自基金合同生效之 日起 6 个月内使基金的投资组合比例符 合基金合同的有关约定。 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。 四、投资限制 1、组合限制 除上述第（2）、（10）、（20）、（21）项 外，因证券、期货市场波动、 上市公司合 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 个工作日内进行 调整， 但中国证监会规定的特殊情形除 外。 法律法规另有规定的，从其规定。 基金管理人应当自基金合同生 效之 日起 6 个月内使基金的投资组合比例符 合基金合同的有关约定。 在上述期间内， 本基金的投资范围、 投资策略应当符合 基金合同的 约定。 基金托管人对基金 的投资的监督与检查自本基金合同生效之 日起开始。 49 第十二部分基金 的投资 五、业绩比较基准 本基金业绩 比较基准为： 中证医药 卫生指数收益率 \times 80%+中债综合指数收 益率 \times 20% 中证医药卫生指数是中证指数有限 公司编制的中证行业系列指数中 的一 只， 该系列指数旨在反映沪深 A 股中不 同行业公司股票的整体表现，将中证 800 指数 800 只样本股按行业分类标准分为 10 个行业， 再以各行业全部股票作为样 本编制指数，形成 10 个中证行业指数。 如果今后法律法规发生变化， 或本 基金业绩比较基准所参照的指数在 未来 不再发布，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 比较基准的指 数时， 本基金经基金管理 人和基金托管人协商一致， 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， 而无需召开基金份额持有 人大 会。 五、业绩比较基准 本基金业绩比较基准为： 沪深 300 指 数 收 益 率 \times 50%+ 恒 生 指 数 收 益 率 \times 20%+中证国债指数收益率 \times 30% 沪深 300 指数是上海证券交易所和 深圳证券交易 所共同推出的沪深两个市 场第一个统一指数；该指数编制合理、透 明，有一定市场覆 盖率，不易被操纵，并 且有较高的知名度和市场影响力， 适合 作为本基金股票投资的业绩比较基准。 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。 中证国 债指数是由中证指数公司编制， 于 2008 年推出的覆盖银行间市场和交易所市场 的国债指数。 中证国债指数通过对银 行 间市场和交易所市场交易、 剩余期限在 一年以上的国债， 采用发行量派许加权 计算的综合价格指数， 可以准确反映高 信用固定收益债 券的价格走势， 具有较 强的代表性， 可以作为本基金债券投资 部分的基准。 如果今后法律法规发生变 化， 或本基金业绩比较基准所参照的 指 数在未来不再发布，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 基金的业绩比较 基准的指数时， 本基金 经基金管理人和基金托管人协商一致， 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， 而无需召开基金 份 额持有人大会。 49-50 第十二部分基金 的投资 六、风险收益特征 本基金为混合型基金， 属于证券投资 基金中的中高风险品种， 预期风险和 预期收益高于债券型基金和货币市场基 金， 低于股票型基金。 六、风险收益特征 本基金为混合型基金， 属于证券投资 基金中的中等 风险品种， 预期风险和 预期收益高于债券型基金和货币市场基 金。 本基金将通过港股通渠道投资于香 港证券市场， 除了需要承担与内地证 券 投资基金类似的市场波动风险等一般投 资风险之外， 本基金还将面临汇率风险、 香港市场风险等特殊投资风险。 51 第十三部 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、 期货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。 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。 52 第十四部 分 基金资 产估值 三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估 值 （1）交易所上市的有价证券（包括股 票、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；（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； 三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的 估 值 （1）交易所上市的有价证券（包括股 票、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， 且最近交易日后未发生影响公允 价值计量的重大事件， 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；（2） 交易所上市实行净价交易的债 券按估值日第 三方估值机构提供的价格 估值；（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或第 三 方估值机构提供的价格进行估值； 估 值 日没有交易且本基金采用的是按收盘 价 估值的， 且最近交易日后未发生影响公 允 价值计量的重大事件， 按最近交易日 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 交易日后发生了影响公允价值计量的 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； 53 第十四部 分 基金资 产估值 2、处于未上市期间的有价证券应区分如 下情况处理：（1）送股、转增股、配股 和 公开增发 的新股， 按估值日在证券交 易 所挂牌的 同一股票的估值方法估值； 该 日无交易的， 以最近一日的市价（收盘 价）估值。（2）首次公开发行未上市 的 股票、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。（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。 2、处于未上市期间的有价证券应区 分 如下情况处理：（1）送股、转增股、 配 股和公开增发 的新股， 按估值日在 证 券交易所挂牌的 同一股票的估值方法 估 值；该日无交易的， 以最近一日的市 价 （收盘价）估值；（2）首次公开发 行 未上市 的股票、 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；（3）流通受限股 票， 包括非公开发 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， 按监管机构或行业协 会 有关规定确定公 允价值。 53 第十四部 分 基金资 产估值 三、估值方法 5、本基金投资股指期货合约， 以其 估值日在期货交易所公布的结算价估 值； 估值日无结算价的， 且最近交易日后 经 济环境未发生重大变化， 以最近交易 日 的结算价估值。 三、估值方法 5、本 基金投资股指期货合约， 以其估值日在 期 货交易所公布的结算价估 值；估值日 无 结算价的， 且最近交易日后 未发生 影响公允价值计量的重大事件， 以最近 交 易日的结算价 估值。 6、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。 7、对于按照中国法律法规和基金投 资 所在地的法律法规规定应交纳的各项 税 金， 本基金将按权责发生制原则进行 估 值； 对于

因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

8、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。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。

54 第十四部分基金资产估值 四、估值程序 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 0.001 元，小数点后第 4 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。 四、估值程序 1、各类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 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，经基金托管人复核，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

54 第十四部分基金资产估值 五、估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。 五、估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当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，视为基金份额净值错误。

56 第十四部分基金资产估值 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：（5）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。 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：（5）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。如果行业有通行做法，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

57 第十四部分基金资产估值 六、暂停估值的情形 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； 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时； 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； 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

六、暂停估值的情形 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； 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； 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，经与基金托管人协商一致的； 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

57 第十四部分基金资产估值 八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。 八、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

57 第十四部分基金资产估值 2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、期货公司及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人、基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。 2、由于不可抗力，或由于证券、期货交易所、期货公司及登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，基金管理人、基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

58 第十五部分基金费用与税收 一、基金费用的种类 1、基金管理人的管理费； 2、基金托管人的托管费； 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用； 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费； 5、基金份额持有人大会费用； 6、基金的证券、期货交易费用； 7、基金的银行汇划费用； 8、基金的开户费用、账户维护费用； 9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

一、基金费用的种类 1、基金管理人的管理费； 2、基金托管人的托管费； 3、C 类基金份额的销售服务费； 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用； 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费； 6、基金份额持有人大会费用； 7、基金的证券、期货交易费用； 8、基金的银行汇划费用； 9、基金的开户费用、账户维护费用； 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用； 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

58 第十五部分基金费用与税收 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 2、基金托管人的托管费 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 2、基金托管人的托管费 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

59 第十五部分基金费用与税收 新增内容： 3、C 类基金份额的销售服务费 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 0.80% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$ H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值 基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。销售服务费由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

59 第十五部分基金费用与税收 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。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。

第十五部分基金费用与税收 四、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒体上刊登公告。 删除

60 第十五部分基金费用与税收 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。 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。鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人与基金托管人可通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

61 第十六部分基金的收益与分配 三、基金收益分配原则 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； 4、每一基金份额享有同等分配权； 三、基金收益分配原则 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、同一类别每一基金份额享有同等分配权； 62 第十六部分基金的收益与分配 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

投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以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按除权后的基金份额净值自动转为基金份额。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，不足以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按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

63 第十七部分基金的会计和审计 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披露；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；

64 第十八部分基金的信息披露 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”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“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。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。

64 第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （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报刊和网站上。（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报刊和网站上登载基金合同生效公告。

五、公开披露的基金信息 删除 67 第十八部分基金的信息披露 五、公开披露的基金信息 （七）临时报告 7、基金募集期延长； 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更； 五、公开披露的基金信息 （五）临时报告 删除 15、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更； 新增： 25、调整本基金份额类别设置； 27、基金管理人采用摆动定价机制进行估值时； 69 第十八部分基金的信息披露 新增内容： （九）投资资产支持证券的信息 基金管理人应在基金季度报告中披露持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。基金管理人应在基金年报及半年报中披露持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。（十）投资于港股通标的股票的信息 基金管理人应当在基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书等文件中披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金通过内地与香港股票交易互联互通机制投资香港股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

69 第十八部分基金的信息披露 六、信息披露事务管理 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。基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

六、信息披露事务管理 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。基金管理人、基金托管人应当在指定媒介选择披露信息媒介。基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

72 第二十部分违约责任 一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人可以免责： 一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

73 第二十一部分争议的处理和适用的法律 基金合同受中国法律管辖。基金合同受中国法律管辖并从其解释。