

中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信保诚嘉鑫定期 开放债券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

中信保诚基金管理有限公司已于2019年11月13日在《证券时报》及本公司网站（www.citicprufunds.com.cn）发布了《中信保诚基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式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

信诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金于2018年1月5日获得中国证监会《关于准予信诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]61号，以下简称“《批复》”），后经2018年1月11日向证监会备案将“信诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金”的基金名称变更为“中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金”。中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于2018年1月29日发售。经中国证监会书面确认，《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年1月30日生效。

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，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《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册有关事项的议案》。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11月19日起，至2019年12月15日17:00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

3、通讯表决票将送达至本基金管理人，具体地址和联系方式如下：

收件人：中信保诚基金管理有限公司客户服务部

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

邮政编码：200120

联系电话：400 666 0066

请在信封表面注明：“中信保诚嘉鑫定期开放债券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

本次持有人大会审议的事项为《关于中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册有关事项的议案》（以下简称“《议案》”），《议案》详见附件一。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2019年11月18日，即在2019年11月18日交易时间结束后，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、投票方式

本次持有人大会的表决方式仅限于纸质表决。纸质表决票的填写和寄交方式如下：

1、本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站

(<http://www.citicprufunds.com.cn/>) 下载等方式获取表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，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（包括基金管理人认可的业务专用章，下同），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事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

(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、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。

(4) 基金份额持有人可根据本公告“五、授权”的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。

(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会议投票表决起止时间内（以本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的办公地址（中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层），请在信封表面注明：“中信保诚嘉鑫定期开放债券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有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。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基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

1、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。投资者在申购本基金的同时也可以签署授权委托书，待申购申请确认后，授权委托书自动有效。

基金份额持有人（含新申购投资者，下同）授权他人行使表决权的票数按该基金份额持有人在权益登记日所持有的全部基金份额数计算，一份基金份额代表一票表决权。基金份额持有人在权益登记日未持有本基金基金份额的，授权无效。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以本基金登记机构的登记为准。

2、受托人（代理人）

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、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二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（<http://www.citicprufunds.com.cn/>）等方式获取授权委托书样本。

（1）基金份额持有人进行纸面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，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），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明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人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）。
- ② 机构基金份额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，代理人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件二的样本），并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人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）。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证明文件复印件；如代理人为机构，还需提供该代理人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 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。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事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。
- ④ 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。

（2）对基金管理人的纸面授权文件的送达

基金份额持有人通过纸面方式对基金管理人进行授权的，可通过邮寄授权文件和所需的相关文件或在基金管理人柜台办理授权事宜。

基金份额持有人也可将其填妥的授权委托书和所需的相关文件专人送交基金管理人办公地点。

4、授权效力确定规则

- （1）如果同一基金份额持有人持有的全部基金份额存在多次有效纸面方式授权的，以最后一次纸面授权为准。不能确定最后一次纸面授权的，如最后时间收到的授权委托有多次，以表示具体表决意见的纸面授权为准；
- （2）如果委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权代理人按照代理人意志行使表决权；
- （3）基金份额以非纸面方式进行授权的，为无效授权；
- （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。

5、对基金管理人的授权截止时间

基金管理人接受基金份额持有人授权的截止时间为2019年12月10日16:30时。将纸面授权委托书和所需的相关文件寄送或专人送达给基金管理人的指定地址的，授权时间以收到时间为准。

六、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（中信银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日后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、表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交的，表决时间以实际递交时间为准；邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收件人收到时间为准。2019年12月15日17：00以后送达基金管理人的，为无效表决。

（2）纸面表决票的效力认定

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

② 如纸面表决票上的表决意见未选、表决意见模糊不清或相互矛盾的，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 如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或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提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

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；

i i. 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；

i i i. 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准。

七、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份额的50%以上（含50%，下同）；

2、《关于中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册有关事项的议案》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二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自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。

八、本次大会相关机构

1、召集人：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400 666 0066

联系人：金芬泉

联系电话：（021）68649788—6228

电子邮件：ds@citicprufunds.com.cn

传真：（021）5012 0886

网址：<http://www.citicprufunds.com.cn>

2、公证机构：上海市东方公证处

地址：上海市凤阳路660号

联系电话：（021）62154848，62178903（直线）

联系人：林奇

3、律师事务所：上海源泰律师事务所

注册及办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

联系电话：（021）51150298

九、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合计占权益登记日基金份额的50%以上（含50%，下同）。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，本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。

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。
- 2、如本次基金份额持有人大会不能成功召开或未能通过本次大会审议的议案，根据《基金法》及《基金合同》的有关规定，本基金可能会再次召开基金份额持有人大会。
- 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，就本次会议相关情况做必要说明，请予以留意。
- 4、上述基金份额持有人大会有关公告可通过中信保诚基金管理有限公司网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电400 666 0066咨询。
- 5、本公告的有关内容由中信保诚基金管理有限公司解释。

附件一：《关于中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册有关事项的议案》

附件二：授权委托书（样本）

附件三：中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决票

附件四：中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册方案说明书

中信保诚基金管理有限公司

2019年11月14日

附件一：

关于中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金
变更注册有关事项的议案

中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人：

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》有关约定，经基金管理人与基金托管人中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）协商一致，决定召开本基金的基金份额持有人大会，对本基金实施变更注册。变更注册方案说明见附件四《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册方案说明书》。

同时，为实施本基金变更注册方案，提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金变更注册的有关具体事宜，并根据持有人大会决议以及变更注册后基金运作的特点及现时有效的法律法规，对《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上提案，请予审议。

中信保诚基金管理有限公司

二〇一九年十一月十三日

附件二：

授权委托书

本人（或本机构）特此授权 代表本人（或本机构）参加投票截止日为2019年12月15日的以通讯方式召开的中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式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。表决意见以受托人（代理人）的表决意见为准。本人（或本机构）同意代理人转授权，转授权仅限一次。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金在法定时间内重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字 / 盖章）：

委托人证件号码（填写）：

受托人（代理人）（签字 / 盖章）：

受托人（代理人）证件号码（填写）：

签署日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1. 本授权书仅为样本供基金份额持有人参考使用。基金份额持有人也可以自行制作符合法律规定及《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》要求的授权委托书。
2. 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。
3. 以上授权是基金份额持有人就其持有的本基金全部份额（含截至权益登记日的未付累计收益）向代理人所做授权。
4. 本授权委托书（样本）中“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。
5. 如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。

■

附件四：

中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册方案 说明书

一、声明

综合市场需求分析，为维护基金份额持有人利益，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《中信保诚嘉鑫定期开放债券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，经基金管理人与基金托管人中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）协商一致，拟对中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金实施变更注册。

本次中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）变更注册方案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二分之一以上（含二分之一）通过方可做出，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金的变更注册已经中国证监会变更注册，基金份额持有人大会表决通过的决议需依法报中国证监会备案。中国证监会对本次中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金变更注册方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次变更注册方案或本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、变更注册方案要点

（一）基金名称的变更

（二）修改基金的投资范围及投资策略等投资相关条款

对中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金原《基金合同》中投资范围、投资策略、投资限制等内容进行了调整。

投资范围中增加国债期货。

投资策略中增加国债期货投资策略。

投资限制中增加参与国债期货交易的相关比例限制的要求。

（三）变更基金资产估值

（四）其他相关事项的修改

《基金合同》涉及上述修改的其他相应条款一并修改。此次，因《证券投资基金基金合同填报指引第3号一债券型证券投资基金基金合同填报指引（试行）》更新，《基金合同》相关条款进行了同步更新。

基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及变更注册后的中信保诚嘉鑫3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的产品特征、根据基金份额持有人大会决议修订基金合同的其他内容。具体修改内容见本说明之附件《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同修订对照表》。

三、变更注册后《中信保诚嘉鑫3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的生效

自本次基金份额持有人大会决议表决通过的下一工作日起，修订后的《中信保诚嘉鑫3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》自同日起失效。

四、基金变更注册的主要风险及预备措施

为防范变更注册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，对变更注册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。

如果《议案》未获得持有人大会的批准，基金管理人将按照有关规定重新向持有人大会提交变更注册方案议案。

五、基金管理人联系方式

基金份额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：中信保诚基金管理有限公司

客服电话：400-666-0066

公司网站：www.citicprufunds.com.cn

中信保诚基金管理有限公司

2019年11月13日

附件：《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同修订对照表》

章节 原文条款 修订后条款

内容 内容

基金

名称

中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金

中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

第一

部分

前言

三、中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

三、中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册，并因投资范围的变更经中国证监会变更注册。本基金名称后续调整为中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

中国证监会对本基金的募集注册及后续的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

第二

部分

释义

7、基金份额发售公告：指《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

7、基金份额发售公告：指原《中信保诚嘉鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

1 5、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

1 5、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

1 9、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得中国国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

无

20、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称，本基金不向个人投资者公开销售，法律法规或监管机构另有规定的除外

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的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得中国国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称，本基金不向个人投资者公开销售，法律法规或监管机构另有规定的除外

第四部分 基金 份额 的发 售

一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

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机构投资者、发起资金提供方和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

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机构投资者、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

第六部分 基金 份额

的申
购与
赎回

三、申购与赎回的原则

……

无

三、申购与赎回的原则

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

四、申购与赎回的程序

2、申购和赎回的款项支付

……

……遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项划付时间相应顺延。

3、申购和赎回申请的确认

……若申购不成功或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购与赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

四、申购与赎回的程序

2、申购和赎回的款项支付

……

……遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项划付时间相应顺延。

3、申购和赎回申请的确认

……若申购不生效或无效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定生效，而仅代表销售机构已经接收到申购、赎回申请。申购与赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、……遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、……遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

七、拒绝或暂停申购的情形

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。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

七、拒绝或暂停申购的情形

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。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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。

……

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时……

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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。

……

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时……

第七

部分

基金

合同

当事人及

权利

义务

一、基金管理人

（二）基金管理人的权利与义务

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：

（14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则;

一、基金管理人

(二) 基金管理人的权利与义务

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:

(14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(15) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则, 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调整托管费率、管理费率及调高赎回费率之外的相关费率结构和收费方式;

二、基金托管人

(二) 基金托管人的权利与义务

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:

(4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、资金账户及投资所需其他账户, 为基金办理证券交易资金清算;

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、证券账户及投资所需其他账户, 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;

二、基金托管人

(二) 基金托管人的权利与义务

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:

(4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、资金账户、期货账户及投资所需其他账户, 为基金办理证券、期货交易资金清算;

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、期货账户及投资所需其他账户, 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;

第八 部分 基金

份额
持有
人大
会

一、召开事由

1、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的，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：

（1 2）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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：

一、召开事由

1、除法律法规、监管机构或基金合同另有规定的，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：

（1 2）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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：

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

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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

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、表决方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

二、投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、证券公司短期公司债券、非金融企业债务融资工具、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金

投资的其他金融工具。

本基金不投资股票、权证、可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券等资产。

.....

开放期内，基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制，前述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

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、证券公司短期公司债券、非金融企业债务融资工具、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场工具、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。

本基金不投资股票、可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券等资产。

.....

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，基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

第十

二部

分

基金

的投

资

三、投资策略

.....

无

三、投资策略

5、国债期货投资策略

本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和

定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。

四、投资限制

1、组合限制

(2) 开放期内，基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

.....

除上述第(2)、(9)、(12)、(13)项之外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，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或本基金合同另有约定的除外。法律法规另有规定的，从其规定。

四、投资限制

1、组合限制

(2) 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，基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在封闭期内，本基金不受前述5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(14) 本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

1) 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%；

2) 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%；

3) 本基金所持有的债券（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；

4) 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%；

.....

除上述第(2)、(9)、(12)、(13)项之外，因证券、期货

市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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、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。

四、基金财产的保管和处分

……

……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。

四、基金财产的保管和处分

……

……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。

第十四 部分 基金资 产估值

二、估值对象

基金所拥有的各类有价证券以及银行存款本息、备付金、保证金、应收款项和其它资产及负债。

二、估值对象

基金所拥有的各类有价证券、国债期货合约以及银行存款本息、备付金、保证金、应收款项和其它资产及负债。

无

三、估值原则

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。

（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。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（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。

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且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；

……

四、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，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以及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；……

5、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。

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0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

五、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0.0001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。

五、估值错误的处理

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。

六、估值错误的处理

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。

六、暂停估值的情形

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；

七、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；

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，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等……

九、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7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。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及

登记结算公司发送的数据错误等……

第十五

部分

基金费

用与税

收

一、基金费用的种类

7、基金的证券交易或结算费用；

一、基金费用的种类

7、基金的证券、期货交易或结算费用；

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。

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。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。

第十八

部分

基金的

信息披

露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

五、公开披露的基金信息

无

五、公开披露的基金信息

（十二）投资国债期货的信息披露

基金在季度报告、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。

八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

2、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；

八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形

2、基金投资所涉及的证券、期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

第十九

部分

基金合

同的变

更、终

止与基

金财产

的清算

二、《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：

二、《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：