

山西证券股份有限公司

关于以通讯开会方式召开山西证券裕盛一年定期开放灵活配置 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

山西证券股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）已于2022年6月20日在《上海证券报》及基金管理人公募基金业务网站（<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>）发布了《山西证券股份有限公司关于以通讯方式召开山西证券裕盛一年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》。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会议的第一次提示性公告。

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》等法律法规和《山西证券裕盛一年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，山西证券裕盛一年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”）的基金管理人山西证券股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金基金托管人中国民生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《关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯开会方式

2、会议投票表决起止时间：自2022年6月23日起至2022年7月24日17：00止
（以基金管理人收到表决票的时间为准）

3、会议纸质表决票的寄达地点：

收件人：山西证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦6楼

邮政编码：200122

联系人：范思岚

联系电话：021-38126050

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封表面注明系用于本基金基金份额持有人大会表决之用（如“山西证券裕盛一年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

本次会议审议事项为《关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“议案”）（见附件一）。

上述议案的内容说明见《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书》（见附件四）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2022年6月22日，即该日下午交易时间结束后，在山西证券股份有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人或其授权的代理人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

四、投票方式

1、本次会议表决票，见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆本基金管理人公募基金业务网站（<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>）下载并打印等方式填制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人持有人自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构持有人自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（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正

反面复印件、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；

(3) 个人持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供持有人身份证件正反面复印件，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) 机构持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供持有人的加盖公章的营业执照复印件（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、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在前述表决票收取时间内（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，提交给本基金管理人（专人送达的以实际递交时间为准；通过邮寄方式

提交的，以基金管理人签收时间为准）。

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（中国民生银行股份有限公司）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、权益登记日登记在册的基金份额持有人所持有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或邮寄送达本基金管理人的，表决时间以收到时间为准。2022年7月24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前述指定地址的，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）如表决票上的表决意见未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断，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：

①送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

②送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃

权表决票；

③送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人签收时间为准。

六、决议生效的条件

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

2、《关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》应当经提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额的三分之二以上（含三分之二）同意，方视为表决通过，形成的大会决议有效；

3、基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理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决议自生效之日起依据相关规定在规定媒介上公告。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次持有人大会需要参加大会的基金份额持有人或其各自代理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），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，基金管理人可在本次公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内就同一议案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，应当由代表本基金在权益登记日基金总份额三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。

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。

八、本次持有人大会相关机构

1、会议召集人（基金管理人）：山西证券股份有限公司

联系地址：上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦6楼

联系人：范思岚

联系电话：021-38126050

电子邮件：fansilan@sxzq.com

网站：www.i618.com.cn

公募基金业务网站：<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>

2、基金托管人、监督人：中国民生银行股份有限公司

联系地址：北京市西城区复兴门内大街2号

客服电话：95568

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、律师事务所：上海源泰律师事务所

联系电话：（021）51150298

九、重要提示

1、关于本次议案（见附件一）的说明详见附件四《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书》。

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《关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》需经参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，故本次基金份额持有人大会存在未能达到开会条件而召集失败或议案无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

3、请持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

4、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人公募基金业务网站 (<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>) 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 (95573) 咨询。

5、本公告的有关内容由山西证券股份有限公司负责解释。

附件一:《关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》

附件二:山西证券裕盛一年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:山西证券裕盛一年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授权委托书

附件四:《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书》

附件五:《〈山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同〉与〈山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同(草案)〉修改前后文对照表》

山西证券股份有限公司

2022年6月21日

附件一：

关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案

山西证券裕盛一年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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规要求和《山西证券裕盛一年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，经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，山西证券股份有限公司（以下简称“本公司”）作为基金管理人决定将“山西证券裕盛一年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”）变更为“山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金”，并对基金合同和托管协议进行相应的修订。本基金的招募说明书及基金产品资料概要也据此相应修改，更新后的法律文件届时可详见基金管理人的官网。

本基金变更注册的具体方案和程序可详见附件四《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书》和附件五《〈山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同〉与〈山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同（草案）〉修改前后文对照表》。

本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将安排不少于20个工作日的选择期供基金份额持有人选择赎回或转换转出，具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准。

为实施本基金基金合同修改方案，提议授权基金管理人办理本次修改基金合

同的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定实施的具体时间、根据《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书》的有关内容对本基金基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要进行修改等。

以上议案，请予审议。

基金管理人：山西证券股份有限公司

2022年6月21日

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2022年7月24日17时的以通讯方式召开的山西证券裕盛一年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，并代为全权行使对所有议案的表决权。

若山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金重新召开审议相同议案的基金份额持有人大会的，除非授权方式发生变化或重新授权，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：

委托人身份证号或统一社会信用代码：

委托人基金账户号：

受托人签字/盖章：

受托人身份证号或统一社会信用代码：

委托日期： 年 月 日

附注：

（1）“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，应当填写多个基金账户号；其他情况可不必填写。“基金账户号”处空白、多填、错填、无法识别等情况的，不影响授权效力，将被默认为代表持有人所持有的本基金所有份额。

（2）本授权委托书可剪报、复印或登录本基金管理人公募基金业务网站（<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>）下载并打印，在填写完整并签字/盖章后均为有效。

附件四：

山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书

一、声明

1、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》等法律法规的规定和《山西证券裕盛一年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，山西证券裕盛一年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”）的基金管理人山西证券股份有限公司经与基金托管人中国民生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《关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并对基金合同和托管协议进行相应的修订。本基金的招募说明书及基金产品资料概要也据此相应修改，更新后的法律文件届时可详见基金管理人的官网。

本次修改基金合同事项属本基金原注册事项的实质性调整，经基金管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。

2、本次基金份额持有人大会需由出席会议的符合要求的基金份额持有人或其代理人所持有有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）方可召开，且《关于修改山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“议案”）需经参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额持有人（或代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过，故本次基金份额持有人大会存在未能达到开会条件而召集失败或议案无法获得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决议自表决通过之日起生效，且基金份额持有人大会表决通过的事项需报中国证监会备案。中国证监会对本次基金份额持有人大会决议的备案，并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

1、变更基金名称

“山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金”更名为“山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金”。

2、变更运作方式

“契约型、定期开放式”变更为“契约型开放式”。

设置基金份额持有人最短持有期限。基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该份基金份额不可赎回或转换转出。

3、变更赎回费用

(1) 基金原赎回费率

持有期间 (Y)	费率
$0 \leq Y < 7$ 天	1.50%
$7 \leq Y < 30$ 日	0.10%
$Y \geq 30$ 日	0%

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费 100% 计入基金财产。

(2) 调整后的基金赎回费率

调整后本基金不收取赎回费，每份基金份额持有期满一年后，基金份额持有人方可就基金份额申请赎回。

4、其它情况

配合修改上述内容同步修改投资限制、投资策略等部分条款，对本基金《基金合同》中的相关条款和描述进行修改和完善。

5、《基金合同》的具体修改内容可见附件五《〈山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同〉与〈山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同（草案）〉修改前后文对照表》

三、基金合同修改要点

(一) 在“前言”章节增加基金的历史沿革、基金份额最短持有期限及投资存托凭证的风险揭示，并将“本基金允许单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额比例达到或者超过 50%，且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。”调整为“本基金单一投资者（基金管理人股东以外的发起资金提供方除外）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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”

（二）在“释义”章节修订基金或本基金、基金合同或本基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要、《销售办法》、合格境外机构投资者、投资人、发起资金、发起资金提供方、基金销售业务、基金合同生效日、开放日、申购、赎回、基金转换、巨额赎回、指定媒介等的词语含义，增加最短持有期限、年度对应日、定期定额投资计划等的词语含义，删除基金份额发售公告、基金募集期、定期开放、封闭期、开放期、认购等的词语含义。

（三）在“基金的基本情况”章节修订基金名称、基金的运作方式、发起资金的认购金额下限、持有期限下限，删除基金的封闭期与开放期、基金份额初始面值和认购费用、其他事项。

（四）将原“基金份额的发售”章节调整为“基金的历史沿革”章节。

（五）将原“基金备案”章节调整为“基金的存续”章节。

（六）在“基金份额的申购与赎回”章节修订申购和赎回的开放日及时间、申购与赎回的原则、申购与赎回的程序、申购和赎回的价格、费用及其用途、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的情形及处理方式、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告，增加定期定额投资计划。

（七）在“基金合同当事人及权利义务”章节更新基金管理人简况、基金管理人的权利与义务、基金托管人简况、基金托管人的权利与义务。

（八）在“基金份额持有人大会”章节修订召开事由、出席方式、生效与公告。

（九）在“基金管理人、基金托管人的更换条件和程序”章节修订基金管理人和基金托管人的更换程序，增加“本基金管理人山西证券股份有限公司控股设立新的基金管理人，且经证监会批准同意的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本基金合同的相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议”的相关表述。

(十) 在“基金份额的登记”章节修订基金登记机构的权利。

(十一) 在“基金的投资”章节修订投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准。

(十二) 在“基金资产估值”章节修订估值对象、估值方法、估值程序。

(十三) 在“基金费用与税收”章节修订基金费用的种类、不列入基金费用的项目。

(十四) 在“基金的收益与分配”章节修订基金收益分配原则、收益分配方案的确定、公告与实施。

(十五) 在“基金的会计与审计”章节修订基金的年度审计。

(十六) 在“基金的信息披露”章节修订信息披露义务人、公开披露的基金信息、信息披露事务管理、暂停或延迟披露基金相关信息的相关表述。

(十七) 在“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节修订《基金合同》的变更、基金财产的清算、基金财产清算账册及文件的保存。

(十八) 在“基金合同的效力”章节修订《基金合同》生效的相关表述。

(十九) 根据法律法规、监管要求的变更等相应更新基金合同条款。

(二十) 基于上述修改及本基金的实际情况，根据相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要的相关条款进行修改。

综上所述，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《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书》修改基金合同的内容。

四、基金管理人就方案相关事项的说明

(一) 本基金的历史沿革

山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金经中国证监会《关于准予山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2634号）准予注册，允许公开募集，基金管理人为山西证券股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金自2020年

6月1日至2020年6月5日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金合同生效备案手续。经中国证监会书面确认，《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2020年6月9日生效。

（二）转型方案安排

本次基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人将安排不少于20个工作日的选择期供基金份额持有人选择赎回或转换转出，具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准。

选择期内，基金份额持有人可以将其持有的部分基金份额或全部基金份额赎回或转换转出；在选择期内未申请赎回的投资者所持有的山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额将在选择期结束后全部转为山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金份额。

为应对选择期内的赎回安排，基金份额持有人同意在选择期内豁免《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》中关于的封闭期与开放期、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。

自选择期结束后的下一工作日起，《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》正式生效。

（三）基金合同修改的可行性

1、法律方面

根据本基金基金合同约定，可以通过召开基金份额持有人大会的方式，修改基金名称、运作方式、投资策略以及对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项。按照《基金合同》的要求，上述修订属于特别决议，经出席会议的基金份额持有人（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。

因此，本基金修改基金合同不存在法律方面的障碍。

2、技术运作方面

本基金的登记机构依然为山西证券股份有限公司，山西证券股份有限公司具有较为丰富的运作经验，业务流程和保障机制完善。且基金合同修改后，本基金

在技术运作上与本公司管理的其他同类基金并无明显差异。

因此，本基金修改基金合同不存在技术运作方面的障碍。

3、投资运作方面

本公司已对修改基金合同事项进行了充分的分析和论证，通过严格的风险控制以及流动性管理措施，确保本基金投资的平稳运作。

因此，本基金修改基金合同不存在投资运作方面的障碍。

4、授权基金管理人修改基金合同的可行性

本基金的基金合同、托管协议将按照《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同修改方案说明书》及法律法规的规定进行修改，修改后的基金合同、托管协议需经基金管理人和基金托管人签字盖章。基金管理人已在基金份额持有人大会召开前向中国证监会提交山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更注册申请，并将修订后的基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要等材料一并报送中国证监会审核，本基金已经中国证监会准予变更注册。

本基金管理人已在基金份额持有人大会表决议案中提议授权基金管理人对基金合同进行修改。

五、基金合同修改的主要风险及预备措施

（一）议案被基金份额持有人大会否决的风险及预备措施

本次修改基金合同的主要风险是议案被基金份额持有人大会否决的风险。

在提议修改基金合同并确定具体方案之前，本公司已与基金份额持有人进行了沟通，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。议案公告后，本公司还将再次征询基金份额持有人意见。如有必要，本公司将根据基金份额持有人意见，对方案进行适当的修订，并重新公告。本公司可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果议案未获得基金份额持有人大会批准，本公司计划在规定时间内，按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交修改基金合同的议案。

（二）运作风险及预备措施

本公司将提前做好充分的内部沟通及外部沟通，避免基金变更注册后基金运

作过程中出现相关操作风险、管理风险等运作风险。

山西证券股份有限公司

2022年6月21日

附件五：

《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》与《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同（草案）》修改前后文对照表

章节	原《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》版本	修订后《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同（草案）》版本
	内容	内容
基金名称	山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金	山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金
封面	【本基金不向个人投资者公开销售】	删除
第一部分前言	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>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》”）、《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“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律、法规。</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《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>三、山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）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</p>	<p>三、山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）由山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更而来，山西证券裕盛一年</p>

	<p>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申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景等做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>	<p>定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、<u>《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》</u>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；<u>山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更为山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金已经中国证监会变更注册。</u> 中国证监会对<u>山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更为本基金的变更注册</u>，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景等做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>
	<p>七、本基金允许单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额比例达到或者超过50%，且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。</p>	<p>七、本基金单一投资者（基金管理人股东以外的发起资金提供方除外）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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>
	<p>八、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，将自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。</p>	<p>删除</p>
	<p>无</p>	<p>八、本基金设置基金份额持有人最短持有期限。基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该份基金份额不可赎回或转换转出。 九、本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。</p>
<p>第二部分 释义</p>	<p>1、基金或本基金：指山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 4、基金合同或本基金合同：指《山西证券裕盛一年定期开放灵</p>	<p>1、基金或本基金：指山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金，本基金由山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更而来</p>

<p>活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新</p>	<p>4、基金合同或本基金合同：指《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新</p>
<p>7、基金份额发售公告：指《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告》</p>	<p>删除</p>
<p>8、基金产品资料概要：指《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行）</p>	<p>7、基金产品资料概要：指《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新</p>
<p>11、《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>10、《销售办法》：指中国证监会 <u>2020年8月28日</u> 颁布、同年 <u>10月1日</u> 实施的《<u>公开募集</u>证券投资基金销售<u>机构</u>监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p>
<p>20、合格境外机构投资者：指符合<u>相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者</u></p> <p>21、投资人：指个人投资者、机构投资者、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</p>	<p>19、合格境外投资者：指符合<u>《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办法》及相关法律法规规定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</u></p> <p>20、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外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的合称</p>
<p>23、发起资金：指用于<u>认购</u>本基金且来源于基金管理人的股东</p>	<p>22、发起资金：指用于<u>持有</u>本基金且来源于基金管理人的股东</p>

<p>资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也包括基金经理之外公司投研人员，下同）等人员的资金，发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于 3 年</p>	<p>资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理（指基金管理人员中依法具有基金经理资格者，包括但不限于本基金的基金经理，同时也包括基金经理之外公司投研人员，下同）等人员的资金，发起资金在<u>《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》生效之日持有</u>本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金持有的基金份额持有期限自<u>《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起</u>不低于 3 年</p>
<p>24、发起资金提供方：指以发起资金认购且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p>	<p>23、发起资金提供方：指以发起资金持有且承诺以发起资金持有的基金份额持有期限不少于 3 年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p>
<p>25、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管等业务</p>	<p>24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p>
<p>33、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p>	<p>32、基金合同生效日：指<u>《山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》生效日</u>，原<u>《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》自同一日终止</u></p>
<p>35、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月</p> <p>36、定期开放：指本基金采取的在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作模式</p> <p>37、封闭期：指自基金合同生效之日（含）起或自每一个开放期结束之日次日（含）起一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日（含）起，至一年后的年度对日的前一日（含）止。首个封闭期结束之后第一个工作日起（含）进入</p>	<p>删除</p>

<p>首个开放期，下一个封闭期为自首个开放期结束之日次日(含)起至一年后的年度对日的前一日(含)止，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易</p> <p>38、开放期：本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(含)进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最短不少于5个工作日、最长不超过20个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期前2日进行公告</p>	
<p>无</p>	<p>38、最短持有期限：指自投资者取得本基金基金份额后最短的持有时间，在最短持有期限内该份基金份额不可赎回或转换转出。对于本基金每份基金份额而言，最短持有期限指基金合同生效日(对当日持有的基金份额而言)、基金份额申购确认日(对申购份额而言)或基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言)起至一年后的年度对应日的前一日止的期间</p> <p>39、年度对应日：指某一个特定日期在后续年度中的对应日期，若该对应日期为非工作日或该公历年不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日</p>
<p>43、开放日：指在开放期内为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日</p>	<p>40、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</p>
<p>46、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为</p>	<p>删除</p>
<p>47、申购：指基金合同生效后的开放期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为</p>	<p>43、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为</p>
<p>48、赎回：指基金合同生效后的开放期内，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为</p>	<p>44、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为</p> <p>45、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理</p>

	<p>49、基金转换：指基金份额持有人在开放期内按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为</p>	<p>人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为</p>
	<p>无</p>	<p>47、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式</p>
	<p>51、巨额赎回：指本基金开放期内的单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的 20%</p>	<p>48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的 10%</p>
	<p>58、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</p>	<p>55、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</p>
第三部分基金的基本情况	<p>一、基金名称 山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金</p>	<p>一、基金名称 山西证券裕恒一年持有期混合型发起式证券投资基金</p>
	<p>三、基金的运作方式 契约型、定期开放式</p>	<p>三、基金的运作方式 契约型开放式 <u>本基金设置基金份额持有人最短持有期限。基金份额持有人持有的每份基金份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该份基金份额不可赎回或转换转出。</u> <u>基金份额持有人持有的每份基金份额需在基金合同生效日（对当日持有的基金份额而言）、基金份额申购确认日（对申购份</u></p>

	<p>额而言)或基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言)一年后的年度对应日(含该日,若该对应日期为非工作日或该公历年不存在对应日期的,则顺延至下一个工作日)起方可办理赎回或转换转出业务。</p>
<p>四、基金的封闭期与开放期 本基金以封闭期和开放期滚动的方式运作。 本基金的封闭期为自基金合同生效之日(含)起或自每一个开放期结束之日次日(含)起一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日(含)起,至一年后的年度对日的前一日(含)止。首个封闭期结束之后第一个工作日起(含)进入首个开放期,下一个封闭期为自首个开放期结束之日次日(含)起至一年后的年度对日的前一日(含)止,以此类推。 本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。 本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(含)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最短不少于5个工作日、最长不超过20个工作日,开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准,且基金管理人最迟应于开放期前2日进行公告。 若由于不可抗力或其他情形导致原定开放期起始日不能办理基金的申购与赎回,则开放期起始日顺延至不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期时间中止计算,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日起的下一个工作日继续计算该开放期时间,直至满足开放期的时间要求。在此情形下,开放期以管理人届时公告(如有)为准。</p>	<p>删除</p>

	<p>六、发起资金的认购金额下限、持有期限下限 认购本基金的发起资金金额不少于 1000 万元人民币，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年，法律法规或中国证监会另有规定的除外。</p>	<p>五、发起资金的持有金额下限、持有期限下限 <u>《山西证券裕桓一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》生效之日持有</u>本基金的发起资金金额不少于 1000 万元人民币，且发起资金持有的基金份额持有期限不少于 3 年，法律法规或中国证监会另有规定的除外。</p>
	<p>七、基金份额初始面值和认购费用 本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售。 本基金具体认购费率按招募说明书的规定执行。</p>	删除
	<p>十、其他事项 本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或超过 50%，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。</p>	删除
<p>第四部分基金的历史沿革</p>	<p>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 1、发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。 基金管理人可根据基金销售的实际情况在募集期限内适当缩短发售时间并及时公告。 2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及其他相关公告。 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。</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革 <u>山西证券裕桓一年持有期混合型发起式证券投资基金</u>由山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更而来。 <u>山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金</u>经中国证监会《关于准予山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2634号）准予注册，允许公开募集，基金管理人为山西证券股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。 <u>山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金</u>自 2020 年 6 月 1 日至 2020 年 6 月 5 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金合同生效备案手续。 经中国证监会书面确认，《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 9 日生</p>

	<p>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询。</p> <p>三、基金份额的认购</p> <p>1、认购费用</p> <p>本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产。</p> <p>2、募集期利息的处理方式</p> <p>有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算</p> <p>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4、认购份额余额的处理方式</p> <p>认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>4、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，认购费按照每笔认购申请单独计算。已受理的认购申请不得撤销。</p>	<p>效。</p> <p>山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金经中国证监会证监许可[XXXX]XXXX号准予变更注册。</p> <p>XXXX年XX月XX日，山西证券裕盛一年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以通讯方式召开，审议并通过了山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更注册有关事项的议案，内容包括山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更基金名称、运作方式等事项，同时对基金合同其他条款进行更新。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自XXXX年XX月XX日起，《山西证券裕盛一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》生效，《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》同时失效。山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金正式变更为山西证券裕盛一年持有期混合型发起式证券投资基金。</p>
第五	第五部分-基金备案	第五部分 基金的存续

<p>部分基金的存续</p>	<p>一、基金备案的条件</p> <p>本基金自基金份额发售之日起3个月内，使用发起资金认购本基金的金额不少于1000万元，且发起资金提供方承诺认购的基金份额持有期限不少于3年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金的持有人及其持有份额进行专门说明，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：—</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；— 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，—并加计银行同期存款利息；— 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 	<p>一、基金份额的变更登记</p> <p>基金合同生效后，本基金登记机构将进行本基金份额的更名以及必要信息的变更。</p>
	<p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>……</p> <p>本基金在《基金合同》生效满三年后继续存续的，在任一开放</p>	<p>二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>……</p>

	<p>期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），如基金资产净值低于5000万元，《基金合同》终止，无需召开基金份额持有人大会审议。——</p>	
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、基金的封闭期和开放期</p> <p>本基金的封闭期为自基金合同生效之日（含）起或自每一个开放期结束之日次日（含）起一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日（含）起，至一年后的年度对日的前一日（含）止。首个封闭期结束之后第一个工作日起（含）进入首个开放期，下一个封闭期为自首个开放期结束之日次日（含）起至一年后的年度对日的前一日（含）止，以此类推。—</p> <p>本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。—</p> <p>本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起（含）进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期最短不少于5个工作日、最长不超过20个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准，且基金管理人最迟应于开放期前2-日进行公告。—</p> <p>若由于不可抗力或其他情形导致原定开放期起始日不能办理基金的申购与赎回，则开放期起始日顺延至不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，—</p> <p>开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日起的下一个工作日继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。在此情形下，开放期以管理人届时公告（如有）—</p> <p>为准。—</p> <p>2、开放日及开放时间</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><u>本基金每份基金份额的最短持有期限为一年。</u>投资人在开放日办理基金份额的申购，<u>在最短持有期限到期后的每个开放日可以办理该份基金份额的赎回，</u>前述开放日的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，基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更、其他特殊情况<u>或根据业务需要</u>，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施前依照《信息披露办法》的有关规定<u>在规定媒介上</u>公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p><u>基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告及相关业务公告中规定。</u></p> <p><u>基金管理人自基金合同生效之日起一年后的年度对应日（含该日，若该年度对应日为非工作日或该公历年不存在年度对应日的，则顺延至下一个工作日）起开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告及相关业务公告中规定。本基金每份基金份额在其最短持有期限到期后的第一个工作日（含）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回或转换转出申请。</u></p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎</p>

<p>本基金的开放日为开放期内的每个工作日。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>基金合同生效后，若出现新的证券交易市场，一证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。</p> <p>3、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>本基金的封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回、转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为该开放期内下一开放日基金份额申购、赎回的价格；一但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换申请的，视为无效申请。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见招募说明书及基金管理人届时发布的相关公告。</p>	<p>回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。对于尚在最短持有期内还未开始办理赎回业务的基金份额，投资人提出的赎回或者转换转出申请不成立。</p>
<p>三、申购与赎回的原则</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p>

<p>.....</p> <p>基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>.....</p> <p>6、基金管理人有权决定基金份额持有人持有本基金的最高限额和本基金的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p>
<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放期的开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>.....</p> <p>基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p>	<p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>.....</p> <p>基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</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，并按基金合同的约定公告。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>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。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，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日的投资者收取不低手1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财</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，并按基金合同的约定公告。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>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。赎回费用应根据法律法规规定的比例归入基金财产，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。</p>

<p>产。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形 在开放期内发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 7、个人投资者申购。 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购申请时，基金管理人应当根据有关规定进行公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，且开放期按暂停申购的期间相应顺延。</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 3、证券/<u>期货</u>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。 7、<u>基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</u> 9、<u>申请超过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限的。</u> 10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、8、<u>10</u>项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购申请时，基金管理人应当根据有关规定进行公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>
<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 在开放期内发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 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暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中</p>	<p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项： 3、证券/<u>期货</u>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。 4、<u>连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</u> …… 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</p>

<p>国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，且且开放期按暂停赎回的期间相应顺延。</p>	<p>的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p>
<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金开放期内单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付赎回款项或延期办理赎回申请。</p> <p>(2) 延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资人的全部赎回申请有困难或认为因支付投资人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，在当日按比例办理支付的赎回份额不低于前一工作日基金总份额的 20%的前提下，可延缓支付其余赎回申请的款项，但延缓支付的期限不得超过 20 个工作日，延缓支付的赎回申请以赎回申请确认当日的基金份额净值为基础计算赎回金额，并应当在指定媒介上进行公告。</p>	<p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。</p> <p>(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占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</p>

(3) 延期办理赎回申请：在开放期内，若本基金发生巨额赎回，且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一工作日基金总份额**20%**的，基金管理人可以延期办理赎回申请。若基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动，在当日接受该基金份额持有人的全部赎回比例不低于前一工作日基金总份额**20%**的前提下，其余赎回申请可以延期办理，对于延期办理的部分，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，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，直到本开放期结束为止。

如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，直到全部赎回为止，延长的开放期不超过二十个工作日，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额**20%**以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并**延缓支付赎回款项**时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在**3**个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在**2**日内在指定媒介上刊登公告。

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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

但若赎回申请人中存在当日申请赎回的份额超过前一开放日基金总份额**20%**的单个赎回申请人（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人有权按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，优先确认小额赎回申请人的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的**10%**的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对该等大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理。如小额赎回申请人的赎回申请在当日无法全部确认，则对可以确认部分按比例确认赎回的基金份额，对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。基金管理人应当对延期办理事宜在规定媒介上刊登公告。

(3) 暂停赎回：连续**2**个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过**20**个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并**延期办理**时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在**3**个工作日内通知基金

	<p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。</p> <p>3、如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。</p> <p>4、以上暂停及恢复基金申购与赎回的公告规定，不适用于基金合同约定的开放期与封闭期基金运作方式转换引起的暂停或恢复申购与赎回的情形。</p>	<p>份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在规定媒介上刊登公告。</p> <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内规定媒介上刊登暂停公告。</p> <p>2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。</p> <p>3、如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。</p>
	<p>无</p>	<p>十五、定期定额投资计划</p> <p><u>基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额，每期申购金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。</u></p>
<p>第七部分 基金合同</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：侯巍</p> <p>注册资本：人民币 28.2873 亿元</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>法定代表人：王怡里</p> <p>注册资本：人民币 35.8977 亿元</p>

<p>当事人及权利义务</p>	<p>传真：(0351) 8686918</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(15) 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；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15年以上；</p>	<p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、<u>证券/期货</u>经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 <u>20</u>年以上，<u>法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外</u>；</p>
	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：洪崎</p> <p>注册资本：28,365,585,227元人民币</p> <p>存续期间：持续经营</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：高迎欣</p> <p>注册资本：43,782,418,502元人民币</p> <p>存续期间：1996年02月07日至长期</p>
	<p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</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) 基金托管人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</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 <u>20</u>年以上，<u>法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外</u>；</p>
<p>第八部分 基金份额</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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：</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定外，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：</p>

持有人大会	<p>(2) 更换基金管理人；</p> <p>(4) 转换基金运作方式（不包括本基金封闭期与开放期运作方式的转换）；</p>	<p>(2) 更换基金管理人（基金管理人更换为本基金管理人控股设立的基金管理人除外）；</p> <p>(4) 转换基金运作方式；</p>
	<p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p>	<p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>3、在不违反法律法规和监管机关规定的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p>
	<p>八、生效与公告</p> <p>.....</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起依据相关规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。</p>	<p>八、生效与公告</p> <p>.....</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起依据相关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。</p>
第九部分 基金管理人、基金托管	<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>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后依据相关规定在指定媒介公告；</p> <p>（二） 基金托管人的更换程序</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人</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>5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后依据相关规定在规定媒介公告；</p> <p>（二） 基金托管人的更换程序</p> <p>5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人</p>

<p>人的 更换 条件 和程 序</p>	<p>的基金份额持有人大会决议生效后依据相关规定在指定媒介公告； （三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序 3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后依据相关规定在指定媒介上联合公告。</p> <p>无</p>	<p>的基金份额持有人大会决议生效后依据相关规定在规定媒介公告； （三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序 3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后依据相关规定在规定媒介上联合公告。</p> <p>四、本基金管理人山西证券股份有限公司控股设立新的基金管理人，且经证监会批准同意的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本基金合同的相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。</p>
<p>第十 一部 分基 金份 额的 登记</p>	<p>三、基金登记机构的权利 基金登记机构享有以下权利： 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；</p>	<p>三、基金登记机构的权利 基金登记机构享有以下权利： 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在规定媒介上公告；</p>
<p>第十 二部 分基 金的 投资</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、资产支持证券、短期融资券、超短期融资券、债券回购、定期存款、协议存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货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相关规定。 ……</p>	<p>二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括国债期货、</p>

基金的投资组合比例为：~~开放期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%，封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%-100%。本基金投资于同业存单、银行存款不高于基金资产的 20%。开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，封闭期可不受上述 5%的比例限制。在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货、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。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。~~
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

三、投资策略

~~（一）封闭期投资策略~~

~~本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略和资产支持证券投资策略组成。~~

2、股票投资策略

~~（1）股票资产的配置策略~~

~~本基金的股票仓位主要由智能选股模型的波动率类因子信号决定，包括历史的、内部测算的、不同期限的宽基指数波动率。一般波动率越高，出现降仓信号的概率越大；波动率越低，出~~

股指期货、股票期权等）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相关规定）。本基金可以根据法律法规参与融资。

……

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约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%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

三、投资策略

本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、存托凭证投资策略、金融衍生品投资策略、资产支持证券投资策略和参与融资业务投资策略组成。

2、股票投资策略

本基金以中证 800 指数、中证 1000 指数标的作为基础股票池，采用定量与定性相结合的方式确定股票初选库，最终选出约 200 只股票作为核心股票池，并定期调整。

（1）定量分析

现加仓信号的概率越大。基金的股票投资组合比例将参照近 30 天沪深 300 指数波动率水平进行调整，具体股票类资产比例如下：

近 30 天沪深 300 指数波动率	股票类资产比例
0-10%	95%
10%-25%	70%-95%
25%-30%	40%-70%
30%以上	0-40%

此外，机器学习的因子亦包含交易量、换手率等常见流动性、情绪因子，使得智能选股模型信号更有效。

（2）智能选股策略：

首先以 800 指数标的作为基础股票池，透过个股数据筛选，最终选出约 350 只股票作为核心股票池，并季度调整；再透过机器学习的方法（Machine Learning）并且结合滤波的信号，决定最终持股。以过去 60 天为基础时间段，然后从其周围开始寻找最符合优化函数的参数。最优化的函数并非仅是简单的夏普比率等，而是包含同区间的胜率、回撤率、波动率和夏普比率等因素的一个集合函数，因此通过这样的过滤能使投资结果更加稳定。

（3）Alpha 选股策略：

分为多因子 Alpha 模型和期货基差套利。多因子 Alpha 模型主要对各个组成因子的历史数据，进行归因分析找到长期稳定、短期出色的因子，然后这些表现优异的因子便成为下一个月份选股的筛选标准。其组成因子包括个股的价值、规模、盈利状况、成长性等，并融入部分衍生品概念的新信息因子，如波动率等。

本基金采用智能选股模型对基础股票池中的标的进行分析和筛选，以过去 60 天为基础时间段，从其周围寻找最符合优化函数的参数。最优化的函数并非仅是夏普比率等，而是包含同区间的胜率、回撤率、波动率和夏普比率等因素的一个集合函数，因此通过这样的过滤能使投资结果更加稳定。本基金还结合了 Alpha 选股策略对个股进一步筛选。Alpha 模型主要对各个组成因子的历史数据进行归因分析找到长期稳定、短期出色的因子，这些表现优异的因子便成为下一次选股的筛选标准。其组成因子包括个股的估值、规模、盈利状况、成长性等，并融入部分衍生品概念的新信息因子，如波动率等。同时，本基金根据指数波动率进行股票仓位控制，一般波动率越高，相应的股票仓位越低。

（2）定性分析

本基金在定量分析选取出的股票基础上，通过进一步定性分析。基金管理人根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适当调整各因子类别的具体组成及权重，并自上而下地分析宏观经济环境、市场情绪、行业增长前景等分析把握其投资机会。

3、存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

4、债券投资策略

在进行债券投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券及可交换债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

期货基差套利策略方面,实时关注沪深300指数现货和沪深300股指期货不同合约的基差,然后模型会实时计算基差所对应的隐含年化收益率,如果达到了预期标准则开仓,买入沪深300指数现货或者ETF,然后卖空所对应的期货合约,当基差收窄后则平仓,最坏打算即为持有到期。

3、债券投资策略

在进行债券投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管理,获得超额收益。

(4) 可转换债券投资策略

着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究,同时兼顾其债券价值和转换期权价值,对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。

基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析,包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等,并参考同类公司的估值水平,研判发行公司的投资价值;基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析,判断其债券投资价值;采用期权定价模型,估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,制定可转换债券的投资策略。

4、金融衍生品投资策略

……

(2) 股指期货投资策略

本基金进行股指期货投资以套期保值为目的,投资方法是择时对冲,即根据策略目标仓位,综合考虑股指期货的基差情况、现货的超额收益情况及市场其他因素,决定股指期货所占的仓

(4) 可转换债券及可交换债券投资策略

可转换债券/可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券/可交换债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上,综合考虑可转换债券/可交换债的债性和股性,利用定价模型进行估值分析,并最终选择合适的投资品种。

5、金融衍生品投资策略

……

(2) 股指期货投资策略

本基金将根据风险管理原则,以套期保值为目的,充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,旨在通过股指期货实现基金的套期保值。在套期保值的现货标的确认之后,根据期货合约的基差水平、现货的超额收益情况、流动性等因素选择合适的期货合约;运用多种量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸。对套期保值的现货标的Beta值进行跟踪,动态调整套期保值的期货头寸。

(3) 股票期权投资策略

本基金按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,在严格控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的股票期权合约。

本基金投资股票期权,基金管理人将根据审慎原则,建立期权交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范股票期权投资的风险。

<p>位。当标的指数期货存在两种及两种以上近月合约时，本基金将利用各类近期合约的择机转换策略从而获取一定的基差收益。</p> <p><u>（二）开放运作期投资策略</u></p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>	<p><u>7、参与融资业务投资策略</u></p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p><u>8、未来，根据市场情况或法律法规、监管部门有新规定的，基金可相应调整和更新相关投资策略或按最新规定执行，并在招募说明书更新中公告。</u></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><u>（1）封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为0-100%；开放期内，投资于股票资产的比例则为0-95%；</u></p> <p><u>（2）本基金投资于同业存单、银行存款不高于基金资产的20%；</u></p> <p><u>（3）在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，封闭期可不受此比例限制；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、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；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p><u>（4）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%；</u></p> <p><u>（5）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%；</u></p> <p><u>（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%；</u></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><u>（1）本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%-95%；</u></p> <p><u>（2）每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约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%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u></p> <p><u>（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%；</u></p> <p><u>（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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；</u></p> <p><u>（5）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；</u></p> <p><u>（6）本基金管理人管理的全部投资组合持有一家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%；完全</u></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%；~~

~~（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%；~~

~~（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%；~~

~~（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；~~

~~（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；~~

~~（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；~~

~~（13）本基金参与股指期货、国债期货交易，应该遵守下列要求：~~

~~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%；~~

~~2）开放期内的每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货、国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；封闭期内的每个交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年~~

按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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；

（12）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；

（13）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%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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);—

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%;—

4) 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规定;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;—

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%;—

6) 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%,持有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%;—

7) 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个交易日基金资产净值的 30%;—

(14) 本基金在封闭期内,基金的总资产不得超过基金净资产的 200%;本基金在开放期内,基金的总资产不得超过基金净资产的 140%;—

(15) 本基金投资流通受限证券应制定相关投资决策流程、风险控制制度等,并根据相关法律法规要求执行;—

(16) 在本基金开放期内,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%;—

(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;—

(16) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%;—

(17) 本基金参与股指期货、国债期货交易按照以下标准构建组合:—

(17.1) 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%;—

(17.2) 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%;—

(17.3) 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%;—

(17.4) 本基金所持有的股票市值、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;—

(17.5) 本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约的价值,不得超过基金资产净值的 15%;—

(17.6) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约的价值,不得超过基金持有的债券总市值的 30%;—

(17.7) 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%;—

(17.8) 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;—

(17.9) 本基金任何交易日日终,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

~~（17）在本基金开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的 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；~~

~~（18）在本基金开放期内，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；~~

~~（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。~~

除上述第（3）、（10）、（17）、（18）项外，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除外。

……

2、禁止行为

……

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述**禁止**行为，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

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；

（18）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%；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；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；

（19）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，法律法规或监管机构另有规定的从其规定；

（20）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（21）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（2）、（11）、（14）、（15）项外，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除外。

……

2、禁止行为

……

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述**限制性**行为，如适

		用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。
	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%</p> <p>中证指数有限公司作为专业指数提供商，其提供的中证系列指数体系具有一定的优势和市场影响力。其中，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，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。中证全债指数能够较好的反映债券市场变动的全貌，适合作为本基金债券投资的比较基准。根据本基金的投资范围和比例，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>……</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：<u>中证500指数收益率*80%</u>+中证全债指数收益率*20%</p> <p>中证指数有限公司作为专业指数提供商，其提供的中证系列指数体系具有一定的优势和市场影响力。<u>中证500指数在全部A股中剔除沪深300指数成份股及总市值排名前300名的股票后，由总市值排名靠前的500股票组成，综合反映中国A股市场中中小市值公司股票的整体表现。</u>中证全债指数能够较好的反映债券市场变动的全貌，适合作为本基金债券投资的比较基准。根据本基金的投资范围和比例，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>……</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、债券、货币市场工具、资产支持证券、银行存款本息、股指期货合约、国债期货合约、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、<u>存托凭证</u>、债券、货币市场工具、资产支持证券、银行存款本息、股指期货合约、国债期货合约、<u>股票期权合约</u>、应收款项、其它投资等资产及负债。</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>(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</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>(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，如果成本代表了公允价值的恰当估计，可以参考成本计量，但应当</p>

3、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，**按成本估值；**

4、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，**按成本估值。**

5、同一**债券**同时在两个或两个以上市场交易的，按**债券**所处的市场分别估值。

7、本基金投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，**按成本估值。**

8、~~本基金投资~~国债期货、股指期货合约，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。

持续评估成本代表公允价值的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

3、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，如果成本代表了公允价值的恰当估计，可以参考成本计量，但应当持续评估成本代表公允价值的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；

4、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(2) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，采用估值技术确定其公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，如果成本代表了公允价值的恰当估计，可以参考成本计量，但应当持续评估成本代表公允价值的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

5、同一**证券**同时在两个或两个以上市场交易的，按**证券**所处的市场分别估值。

7、本基金投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，采用估值技术确定其公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，如果成本代表了公允价值的恰当估计，可以参考成本计量，但应当持续评估成本代表公允价值的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

8、投资证券衍生品的估值方法

(1) 股指期货、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。

		<p><u>(2) 本基金投资股票期权合约，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。</u></p> <p><u>9、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</u></p> <p><u>10、本基金参与融资业务的，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值。</u></p>
	<p>五、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日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。</p>	<p>五、估值程序</p> <p>1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日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。<u>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。</u>国家另有规定的，从其规定。</p>
	<p>九、特殊情况的处理</p> <p>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，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p>	<p>九、特殊情况的处理</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>
第十五部分 基金费用与 税收	<p>一、基金费用的种类</p> <p>7、基金的证券、期货交易费用；</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>7、基金的证券、期货、<u>期权</u>交易费用；</p>
	<p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用；</p>	<p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、<u>原《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》</u>生效前的相关费用；</p>
第十六部分 基金的 收益	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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（<u>红利再投资不受封闭期限制</u>）；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人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；<u>对于收益分配方式为红利再投资的基金份额，每份基金份额（原</u></p>

与分配		份额) 所获得的红利再投资份额的持有期限, 按原份额的持有期限计算;
	<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, 依据相关规定进行公告。</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, 依据相关规定进行公告。</p>
第十七部分基金的会计与审计	<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、期货相关业务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>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所, 须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的相关规定在指定媒介公告。</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>3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所, 须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的相关规定在规定媒介公告。</p>
第十八部分基金的信息披露	<p>二、信息披露义务人</p> <p>……</p> <p>本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利息为根本出发点, 按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息, 并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。</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”)和指定互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露, 并保证基金投资人能够按照《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。</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>……</p> <p>本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点, 按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息, 并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。</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, 并保证基金投资人能够按照《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。</p>

<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(一) 基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>2、……《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>4、……《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在指定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在指定网站上。</p>	<p>五、公开披露的基金信息</p> <p>(一) 基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议</p> <p>2、……《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>4、……《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。</p>
<p>(二) 基金份额发售公告</p> <p>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媒介上。</p>	<p>删除</p>
<p>(三) 《基金合同》生效公告</p> <p>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媒介</p>	<p><u>(二) 《基金合同》生效公告</u></p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介</p>

<p>上登载《基金合同》生效公告。</p>	<p>上登载《基金合同》生效公告。</p>
<p>（四）基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后，在基金封闭期内，基金管理人应当至少每周在指定网站公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。在本基金的开放期内，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日基金份额净值和基金份额累计净值。</p>	<p>（三）基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日基金份额净值和基金份额累计净值。</p>
<p>（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（含资产组合季度报告）</p> <p>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，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊。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。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。</p>	<p>（五）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（含资产组合季度报告）</p> <p>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，将年度报告登载于规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊。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。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p>
<p>（七）临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。</p>	<p>（六）临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。</p>

<p>3、转换基金运作方式、基金合并（<u>不包括本基金封闭期与开放期运作方式的转换</u>）； 17、<u>本基金进入开放期</u>； 18、本基金发生巨额赎回并延缓支付赎回款项或延期办理；</p>	<p>3、转换基金运作方式、基金合并； 17、<u>本基金开始办理申购、赎回</u>； 18、本基金发生巨额赎回并延期办理； 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</p>
<p>（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的，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。</p>	<p><u>（七）澄清公告</u> 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的，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。</p>
<p>（十）清算报告 《基金合同》出现终止情形的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p>	<p><u>（九）清算报告</u> 《基金合同》出现终止情形的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。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>（十二）投资股指期货、国债期货的相关公告 </p>	<p><u>（十一）投资股指期货、国债期货、股票期权</u>的相关公告 基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等。</p>
<p>（十三）投资非公开发行股票的相关公告 基金管理人在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。</p>	<p><u>（十二）投资非公开发行股票的相关公告</u> 基金管理人在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。</p>

<p>无</p>	<p>(十三) 参与融资业务的相关公告 基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告及招募说明书(更新)等文件中详细披露参与融资业务的情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。</p>
<p>(十四) 发起资金认购份额报告 基金管理人应当按照相关法律的规定和监管机构的要求,在《基金合同》生效公告、基金年报、中期报告、季报中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员(可以包括基金经理之外公司投研人员)以及基金管理人股东认购本基金的份额、期限及期间的变动情况。</p>	<p>(十四) 发起资金认购份额报告 基金管理人应当按照相关法律的规定和监管机构的要求,在<u>原《山西证券裕盛一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》</u>生效公告、基金年报、中期报告、季报中分别披露基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员(可以包括基金经理之外公司投研人员)以及基金管理人股东认购本基金的份额、期限及期间的变动情况。</p>
<p>(十六) 中国证监会规定的其他信息 基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)中充分披露基金的相关情况并揭示相关风险,说明本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%,本基金不向个人投资者公开销售。</p>	<p>(十六) 中国证监会规定的其他信息</p>
<p>六、信息披露事务管理 基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。 基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,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</p>	<p>六、信息披露事务管理 基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。 基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外,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规定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的</p>

	内容应当一致。	内容应当一致。
	八、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： 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、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： 2、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；
第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算	一、《基金合同》的变更 2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后依据相关规定在 指定 媒介公告。	一、《基金合同》的变更 2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后依据相关规定在 规定 媒介公告。
	三、基金财产的清算 2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、 具有从事证券、期货相关业务资格的 注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。	三、基金财产的清算 2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、 <u>符合《中华人民共和国证券法》规定的</u> 注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
	七、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，法律法规另有规定的从其规定。	七、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 <u>20</u> 年以上，法律法规另有规定 <u>或有权机关另有要求</u> 的从其规定。
第二十二部分基金合同的效力	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盖章并在 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。	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盖章， <u>自《基金合同》公告之日</u> 生效。