

大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成月添利理财债券型 证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

大成基金管理有限公司已于 2021 年 6 月 29 日在《中国证券报》、本公司网站（www.dcfund.com.cn）发布了“大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成月添利理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告”。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、会议基本情况

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》的有关规定和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，大成月添利理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）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：2021 年 7 月 1 日起，至 2021 年 7 月 28 日 17:00 止（以本公告列明的公证机关指定的表决票收件人收到纸质表决票的时间为准或以基金管理人系统记录时间为准；纸质表决时间在 2021 年 7 月 28 日 17:00 以后的为无效表决，短信方式表决时间在 2021 年 7 月 23 日 17:00 以后的为无效表决）

3、纸质表决票的寄达地点

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 1601 室

邮政编码：100035

联系人：吕婧

联系电话：400-888-5558，010-88009300

请在信封背面注明：“大成月添利理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、短信投票形式表决票的提交（仅适用于个人持有人）

短信投票形式的表决票按本公告规定的方式回复至基金管理人指定的短信平台。

二、会议审议事项

本次持有人会议审议事项为《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的说明》（附件四）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2021 年 6 月 30 日，即该日在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人享有本次会议的表决权。

四、投票方式

（一）纸质投票

1、本次会议纸质表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站（www.dcfund.com.cn）下载等方式打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

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

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（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）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件（包括使用的身份证、护照或其他能够表明其身份的有效证件或证明）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）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”部分规定的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。受托人（或代理人，下同）接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告

“五、授权”之“(三)授权方式”的“1、纸面方式授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件。

(4) 基金份额持有人通过本公告规定的短信方式授权基金管理人投票的，接受有效委托的基金管理人应在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的营业执照复印件。

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

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2021 年 7 月 1 日起，至 2021 年 7 月 28 日 17: 00 以前（以本公告列明的公证机关指定的表决票收件人收到纸质表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址下述收件人：

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 1601 室

邮政编码：100035

联系人：吕婧

联系电话：400-888-5558，010-88009300

请在信封背面注明：“大成月添利理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

(二) 短信投票（仅适用于个人持有人）

为方便基金份额持有人参与大会投票，基金管理人将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集投票短信，持有人可根据征集投票短信的要求回复短信表明表决意见，回复时间自 2021 年 7 月 1 日起，至 2021 年 7 月 23 日 17: 00 为止（以基金管理人系统记录时间为准）。

基金份额持有人通过短信投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行投票，请投资者采用纸质方式进行投票。

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出具表决意见。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人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登记机构的登记为准。

（二）受托人

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。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面和短信等法律法规和中国证监会认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。

基金份额持有人通过纸面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（www.dcfund.com.cn）下载等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人通过非纸面方式授权的，授权形式及程序应符合本公告的规定。基金份额持有人通过非纸面方式授权仅限授权给基金管理人。

1、纸面方式授权

（1）个人基金份额持有人委托他人投票的，受托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三的样本），并提供基金份额持有人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文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，受托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三的样本）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）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会

团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。

2、短信方式授权

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集授权短信，持有人可根据征集授权短信的要求回复短信表明授权意见。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。短信授权仅支持授权给基金管理人模式。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行授权。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行授权，请投资者采用纸质方式进行授权。

3、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额存在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的，以时间在最后的一次有效纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

(2) 如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在任意一种有效的其他非纸面方式授权的，以该种有效的其他非纸面方式的授权为准；

(3) 如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，以时间在最后的有效授权为准。同时多次以非纸面方式进行授权的，若有效授权表示一致，以一致的授权表示为准；若有效授权表示不一致，视为无效授权；

(4) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权；

(5) 如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

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（中国农业银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

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) 纸质表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准。通过其他非纸面方式表决的，表决时间以系统记录时间为准。表决时间在相应表决方式对应的截止时间以后的，为无效表决。

(2) 如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他非纸面方式有效表决的，以有效的纸质表决为准。

(3) 纸质表决票的效力认定

纸质表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，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。

如纸质表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸质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。

基金份额持有人重复提交纸质表决票的，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，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准；

(4) 如果同一基金份额以非纸质方式进行多次表决的，以时间在最后的表决为准。

七、决议生效条件

本次会议召开的条件为：本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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 50%（含 50%）。

本会议表决的票数要求为：基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权，不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按一般决议处理，须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效。

基金份额持有人大会的决议，自表决通过之日起生效，基金管理人应当自决议通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。

八、重新召集基金份额持有人大会及重新授权

根据《基金法》和《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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 50%（含 50%）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，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。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。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作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

九、本次大会相关机构

1、召集人：大成基金管理有限公司

联系地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

联系人：教姣

联系电话：0755-83183388

客户服务电话：400-888-5558

网址：www.dcfund.com.cn

2、监督人：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

联系人：贺倩

联系电话：010-66060069

3、公证机构：北京市长安公证处

地址：北京市东城区朝阳门北大街6号首创大厦7层

联系人：陆晓冬

电话：010-65543888-8066

邮政编码：100027

4、见证律师：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

联系电话：021-51150298

联系人：张雯倩

十、重要提示

1、请基金份额持有人在提交纸质表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-888-5558咨询。

基金管理人将在发布本公告后，在1个工作日内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。

3、本公告的有关内容由大成基金管理有限公司负责解释。

大成基金管理有限公司

二〇二一年六月三十日

附件一：《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》

附件二：《大成月添利理财债券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：《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的说明》

附件一：

关于大成月添利理财债券型证券投资基金 修改基金合同等相关事项的议案

大成月添利理财债券型证券投资基金份额持有人：

根据市场环境变化，考虑到大成月添利理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的长期发展及持有人的利益，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》的有关规定和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，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，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议修改《基金合同》等相关事项，修改内容包括修改基金名称、基金投资范围、投资比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法等条款，并根据上述调整需要及法律法规和证监会要求对基金合同进行修改。具体修改方案请见附件四：《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的说明》。

为实施本次会议议案，提议授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于根据《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的说明》的相关内容修改基金合同，并对本基金托管协议和招募说明书等法律文件进行必要的修改和补充，同时授权基金管理人可根据实际情况做相应调整。

以上议案，请予审议。

基金管理人：大成基金管理有限公司

二〇二一年六月二十九日

附件二：

**大成月添利理财债券型证券投资基金
基金份额持有人大会通讯表决票**

基金份额持有人名称：

证件号码(身份证号/统一社会信用代码号等)：

基金账户号：

表决事项：《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》

表决结果：

同意

反对

弃权

机构基金份额持有人或代理人签章栏

个人基金份额持有人或代理人签字栏

单位公章：

签字：

日期：

日期：

说明：

1、请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见，否则表决票无效。

2、如纸质表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸质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。

3、“基金账户号”仅指持有本基金份额的基金账户号，同一基金份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。

4、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：

授权委托书

兹全权委托 先生 / 女士或 单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为2021年7月28日17:00的以通讯方式召开的大成月添利理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为行使表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。若在法定时间内就同一议案重新召开基金份额持有人大会，除本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人签名/盖章：

委托人身份证号或统一社会信用代码号等：

基金账户号：

受托人签章（受托人为自然人则签字/受托人为机构则盖公章）：

受托人证件号码(身份证号或统一社会信用代码号等)：

委托日期： 年 月 日

说明：

- 1、本授权委托书可剪报、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。

附件四：

关于大成月添利理财债券型证券投资基金

修改基金合同等相关事项的说明

一、声明

1、根据市场环境变化，考虑到大成月添利理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的长期发展及持有人的利益，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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定和《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，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，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》。

2、本次修改基金合同事宜属于原注册事项的实质性变更，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。

3、本次基金合同修改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50%以上（含50%）通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

4、基金份额持有人大会的决议，自表决通过之日起生效。

修改后的《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》将于基金份额持有人大会的决议表决通过之日起正式生效，具体以基金管理人的公告为准。

二、方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“大成月添利理财债券型证券投资基金”变更为“大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金”。

（二）修改后的《大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》生效前的基金运作

修改后的《大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》生效前，本基金仍按照《基金合同》约定的运作方式进行运作。

（三）修改后的《大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》生效后的基金运作

1、通过《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》的基金份额持有人大会决议自本次基金份额持有人大会表决通过之日起生效。基金管理人将自决议生效之日起 2 日内按规定在规定媒介上公告。

2、基金管理人应当自修改后的《大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合修改后的基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合修改后的基金合同的约定。

（四）变更后基金的投资范围、投资限制和基金合同的其他修改

A、投资范围

本基金的投资范围主要包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、现金、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、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，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不参与股票等权益类资产的投资，不参与可转换债券（可分离交易可转债中的纯债部分除外）、可交换债券的投资。

如果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。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金资产的 80%；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，本基金应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金所指的中短期债券是指剩余期限不超过 3 年（含）的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、公开发行的次级债券、企业债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

B、投资策略

本基金以利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。

1、久期配置

本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等)进行分析,对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测,决定组合的久期。

2、类属配置

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

3、信用债投资策略

本基金将投资信用评级不低于 AA 的信用债(包括企业债券、公司债券、金融债(不包含政策性金融债)、公开发行的次级债、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券)。

上述信用评级针对企业债券、公司债券、金融债(不包含政策性金融债)、公开发行的次级债、政府支持机构债、中期票据而言,具体指债项信用评级;针对短期融资券、超短期融资券、短期公司债券、短期金融债等短期信用债而言,具体指发行主体的信用评级。

本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级。如出现同一时间多家评级机构所出具信用评级不同的情况或没有对应评级的信用债券,基金管理人需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定,以基金管理人的判断结果为准。

本基金投资信用债应符合以下投资比例要求:

本基金投资于信用评级为 AAA 信用债占信用债资产的比例为 50%-100%;

本基金投资于信用评级为 AA+及 AA 信用债占信用债资产的比例为 0-50%;

本基金投资于信用评级为 AA 信用债占信用债资产的比例为 0-20%。

因信用评级变动、证券市场波动、基金规模变动等非基金管理人因素导致信用债投资比例不符合上述投资比例的,基金管理人不得主动进一步突破相应投资比例。

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价。本基金主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响,相应地采用以下两种投资策略:

1) 信用利差曲线变化策略:首先分析经济周期和相关市场变化情况,其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势,最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定本基金信用债分行业投资比例。

2) 信用变化策略：信用债信用等级发生变化后，本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。

本基金将根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

4、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

5、国债期货投资策略

本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险，故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

C、投资限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金资产的 80%；

(2) 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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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%；

(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) 本基金投资于国债期货，还应遵循以下投资比例限制：

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%；

4) 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；

(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) 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%，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；

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

(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(15) 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（2）、（5）、（11）、（13）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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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，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。

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

D、业绩比较基准

中债-新综合全价(1年以下)指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%。

E、调整 E 类基金份额的销售服务费率

E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%。

F、增加了摆动定价条款

大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金增加了摆动定价条款,发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以对基金采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

G、根据上述调整需要同步对基金合同等进行修改的相关内容,以及按照最新的法律法规及证监会要求修改的内容。

基金合同具体修改情况详见“附表:《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同修订对照表》”。

三、基金修改基金合同的主要风险及预备措施

(一) 持有人大会不能成功召开的风险

根据《基金法》及基金合同的规定,本次份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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 50% (含 50%) 方可召开。为防范本次基金份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召开,基金管理人将在会前与基金份额持有人进行预沟通,争取更多的持有人参加基金份额持有人大会。

(二) 修改基金合同的方案被持有人大会否决的风险

在方案公告之前,基金管理人将面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,对本基金修改基金合同的方案等进行适当的修订。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,或更改其他会务安排。

如果修改基金合同的方案未获得持有人大会批准,基金管理人将按照有关规定重新召集基金份额持有人大会,重新向持有人大会提交新的议案,或者采取修改方案等其他合适的方式。

(三) 基金修改基金合同前后遭遇大规模赎回的风险

为应对修改基金合同前后可能遭遇的大规模赎回,本基金在修改基金合同期间将保证投资组合的流动性,以应对修改基金合同前后可能出现的较大赎回,降低净值波动率。

(四) 预防及控制在修改基金合同过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益，防范大额申购赎回或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况对可能存在的市场投资风险进行有效的评估，科学有效地控制基金的市场风险。

附表：《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同修订对照表》

| 章节 | 原文条款 | 修改后条款 | 修改理由 |
|------------|---|--|---|
| | 内容 | 内容 | |
| 第一部分 前言 | 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。 | 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》”)、 <u>《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》</u> (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。 | 更新法规名称。 |
| | 三、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”)核准。 中国证监会对本基金 募集的核准 ,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。 …… 本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,不晚于《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。 | 三、 <u>大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由大成月添利理财债券型证券投资基金转型而来。大成月添利理财债券型证券投资基金</u> 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”)核准, <u>其转型为本基金已经中国证监会变更注册。</u> 中国证监会对 <u>大成月添利理财债券型证券投资基金及其转型为本基金的注册</u> ,并不表明其对本基金的投资价值和 市场前景 做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。 …… | 1、根据本基金变更注册后的实际情况完善相关表述,基金合同中关于基金名称的修改不再一一列举; 2、删除不再适用的条款。 |
| | 无 | 六、 <u>对于每份基金份额,基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败,则该基金份额将在该运作期到期后自动进入下一运作期;在下</u> | 根据法律法规修订补充风险提示。 |

| | | | |
|----------------|--|--|----------------------|
| | | <u>一运作期到期日前，基金份额持有人不能赎回该基金份额。请投资者合理安排资金进行投资。</u> | |
| 第二 部分 释义 | 1、基金或本基金：指大成月添利理财债券型证券投资基金 | 1、基金或本基金：指 <u>大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金，本基金由大成月添利理财债券型证券投资基金转型而来</u> | 根据本基金变更注册后的实际情况完善释义。 |
| | 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 | 11、《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>公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法</u> 》及颁布机关对其不时做出的修订 | 根据法律法规更新调整释义。 |
| | 17、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 | 17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国 <u>银行保险</u> 监督管理委员会 | 完善相关表述。 |
| | 21、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》及其他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，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者 | 21、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》</u> 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 | 根据法律法规更新调整释义。 |
| | 22、基金投资者：指个人投资者、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者 | 22、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外投资者，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者 | 完善相关表述。 |
| | 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、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务 | 24、基金销售业务：指 <u>为投资人开立基金交易账户，宣传推介基金，办理基金份额申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资及提供基金交易账户信息查询等活动</u> | 根据法律法规更新调整释义。 |
| | 25、销售机构：指大成基金管理公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构 | 25、销售机构：指大成基金管理 <u>有限</u> 公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构 | 完善相关表述。 |
| | 33、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规 | 33、基金合同生效日：指 <u>《大成月添利一个月滚动持有中短</u> | 根据本基金变更注 |

| | | |
|--|---|----------------------|
| 定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期 | <u>债债券型证券投资基金》生效日，原《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》自同一日终止</u> | 册后的实际情况完善释义。 |
| 35、基金募集期限：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 | 删除 | 删除本基金不再适用的条款。 |
| 36、运作期起始日：对于每份认购份额的第一个运作期起始日，指基金合同生效日；对于每份申购份额的第一个运作期起始日，指该基金份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日后的下一工作日 | 35 、运作期起始日：对于每份申购份额的第一个运作期起始日，指该基金份额申购 <u>申请</u> 确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日后的下一工作日 | 根据本基金变更注册后的实际情况完善释义。 |
| 37、运作期到期日：对于每份基金份额，第一个运作期到期日指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购申请日（对申购份额而言，下同）对应的次一个月的月度对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），第二个运作期到期日为基金合同生效日或基金份额申购申请日对应的次二个月的月度对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），以此类推 | 36 、运作期到期日：对于每份基金份额，第一个运作期到期日指基金份额申购申请日（对申购份额而言，下同）对应的次一个月的月度对日，第二个运作期到期日为基金份额申购申请日对应的次二个月的月度对日，以此类推 | 根据本基金变更注册后的实际情况完善释义。 |
| 38、月度对日：指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购申请日（对申购份额而言，下同）在后续日历月中的对应日期，若该日历月实际不存在对应日期的，则顺延至下一工作日 | 37 、月度对日：指基金份额申购申请日在后续日历月中的对应日期，若该日历月实际不存在对应日期的 <u>或该日为非工作日的</u> ，则顺延至下一工作日 | 根据本基金变更注册后的实际情况完善释义。 |
| 47、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为 | 删除 | 删除本基金不再适用的条款。 |
| 66、《业务规则》：指《大成基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守 | 64 、《业务规则》：指《大成基金管理有限公司开放式基金 <u>注册</u> 登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守 | 更新制度名称。 |

| | | | |
|--------------------|---|---|----------------------|
| | 无 | 65、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待 | 根据本基金变更注册后的实际情况补充释义。 |
| | 无 | 67、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产 | 根据法律法规补充相关释义。 |
| 第三部分基金的基本情况 | <p>三、基金的运作方式</p> <p>（1）每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请</p> <p>对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日次一个月的月度对日（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起，至基金合同生效日或基金份额申购申请日对应的次二个月的月度对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。</p> <p>2、每个运作期 到期日，基金份额持有人可提出赎回申请……</p> <p>基金份额持有人在运作期到期日申请赎回的，基金管理人按照《招募说明书》“十、基金份额的申购、赎回与转换”的约</p> | <p>三、基金的运作方式</p> <p>1、每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请对于每份基金份额，第一个运作期指基金份额申购申请确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作起始日），至基金份额申购申请日次一个月的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起，至基金份额申购申请日对应的次二个月的月度对日止，以此类推。若该日历月实际不存在对应日期的或该日为非工作日的，则顺延至下一工作日。</p> <p>2、每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请……</p> <p>基金份额持有人在运作期到期日申请赎回的，基金管理人按照《招募说明书》的约定为基金份额持有人办理赎回事宜。</p> | 根据本基金变更注册后的实际情况调整。 |

| | | | |
|--------------|--|---|--------------------|
| | <p>定为基金份额持有人办理赎回事宜。</p> <p>如在开放赎回日内发生不可抗力或其他情形致使基金无法为相应份额按时开放赎回业务的，暂停开放赎回。在不可抗力或其他情形影响因素消除日之下一个工作日，作为相应基金份额的开放赎回日开放赎回。</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过 1 个月开始办理日常申购。</p> | | |
| | <p>五、基金的最低募集份额总额</p> <p>本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。</p> <p>六、基金份额初始面值和认购费用</p> <p>基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金的认购费率为 0。</p> | 删除 | 删除不再适用的条款。 |
| 第四部分 基金的历史沿革 | <p>第四部分 基金份额的发售</p> <p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间</p> <p>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。</p> <p>2、发售方式</p> <p>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基金管理人届时发布的增加销售机构的相关公告。</p> <p>3、发售对象</p> <p>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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者。</p> <p>二、基金份额的认购</p> | <p>第四部分 基金的历史沿革</p> <p><u>大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金由大成月添利理财债券型证券投资基金转型而成。</u></p> <p><u>大成月添利理财债券型证券投资基金经中国证监会 2012 年 8 月 27 日证监许可【2012】1155 号文核准募集，基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。经中国证监会书面确认，《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 20 日正式生效。</u></p> <p><u>根据中国证监会关于规范理财债券基金业务的要求以及中国证监会 2020 年 3 月 20 日颁布的《关于修改部分证券期货规章的决定》的相关规定，经与中国农业银行股份有限公司协商一致，大成基金管理有限公司对大成月添利理财债券型证券投资基金的《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》资产配置比例、投资限制、申购和赎回价格、基金资产</u></p> | 根据本基金变更注册后的实际情况调整。 |

| | | | |
|------------|--|--|---------------------------|
| | <p>1、认购费用 本基金的认购费用为 0。</p> <p>2、募集期利息的处理方式 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，其中利息转份额以注册登记机构的记录为准。</p> <p>3、基金认购份额的计算 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 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、基金份额认购原则及持有上限</p> <p>1、基金投资者认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额。认购一经受理不得撤销。</p> <p>3、基金管理人可以对每个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。</p> <p>4、基金管理人可以对募集期间的单个基金投资者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><u>估值、收益分配、升降级业务、信息披露等内容相关条款进行修改，报监管机构备案，并于 2020 年 5 月 30 日对外公告，于 2020 年 6 月 30 日正式生效。</u></p> <p><u>大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2021]1989 号文准予变更注册。</u></p> <p><u>大成月添利理财债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2021 年 XX 月 XX 日表决通过了《关于大成月添利理财债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》，修改基金合同内容包括大成月添利理财债券型证券投资基金变更投资范围、投资策略、业绩比较基准、投资限制、基金的费用等，并同意将大成月添利理财债券型证券投资基金更名为“大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金”。</u></p> <p><u>根据基金份额持有人大会决议，自 2021 年 XX 月 XX 日起，原《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》失效，《大成月添利一个月滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》生效。</u></p> | |
| 第五部分 基金的存续 | <p>第五部分 基金备案</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，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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</p> | <p>第五部分 基金的存续</p> <p><u>《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，《基金合同》自动终止，无需召开基金份额持有人大会。</u></p> | <p>根据本基金变更注册后的实际情况调整。</p> |

| | | | |
|------------|---|--|--|
| | <p>定验资机构验资，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，未满足募集生效条件，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>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。</p> <p>法律法规另有规定时，从其规定。</p> | <p><u>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</u></p> | |
| 第六部分 基金 | | <p><u>一、投资人范围</u></p> <p><u>本基金仅向符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者（含公募资产管理产品）销售，具体销售对象以相</u></p> | |

| | | | |
|---|--|---|---|
| 份 额 的 申 购 、 赎 回 与 转 换 | <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>……</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、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》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过1个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>基金份额每个运作期到期日，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。基金管理人自基金合同生效之日次一个月的月度对日起开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</p> | <p><u>关公告为准。</u></p> <p>三、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>……</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》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>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中规定。</p> <p>基金份额每个运作期到期日，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。基金管理人自基金份额申购申请确认日次一个月的月度对日起开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</p> | 完善相关表述。 |
| | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>……</p> <p>基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在规定媒介及基金管理人网站上予以公告。</p> | <p>四、申购与赎回的原则</p> <p>……</p> <p>基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在规定媒介上予以公告。</p> | 完善相关表述。 |
| | <p>五、申购和赎回的数量限制</p> <p>5、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告并报中国证监会备案。</p> | <p>六、申购和赎回的数量限制</p> <p>6、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。</p> | <p>1、补充申购和赎回的数量限制；</p> <p>2、完善相关表述。</p> |
| | <p>八、拒绝或暂停申购的情形</p> | <p>九、拒绝或暂停申购的情形</p> | 完善相关表述。 |

| | | |
|--|--|-------------------------------------|
| <p>2、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；</p> | <p>2、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；</p> | |
| <p>九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、证券交易所交易时间依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> | <p>十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 2、证券/期货交易所交易时间依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> | <p>完善相关表述。</p> |
| <p>十一、巨额赎回的情形及处理方式 3、巨额赎回的公告 …… 连续 2 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，并应当在规定媒介和基金管理人网站上进行公告。</p> | <p>十一、巨额赎回的情形及处理方式 3、巨额赎回的公告 …… 连续 2 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。</p> | <p>完善相关表述。</p> |
| <p>十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并依照有关规定在规定媒介刊登暂停公告。 2、如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在规定媒介刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。 3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在规定媒介和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。 4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申</p> | <p>十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 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在规定媒介刊登暂停公告。 2、暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定，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 个工作日的各类基金份额净值。基金管理人亦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>调整暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告规则。</p> |

| | | | |
|----------------------|---|--|------------------------|
| | <p>购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在规定媒介和基金管理人网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日各类基金份额的基金份额净值。</p> | | |
| 第七部分 基金合同当事人及权利义务 | <p>一、基金管理人</p> <p>(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>(16) 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、转换和非交易过户的业务规则；</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>(1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</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>(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日</p> | <p>一、基金管理人</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、证券期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；</p> <p>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；</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>(1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和注册登记手续；</p> <p>(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</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，保存年限不低于法律法规规定的最低期限；</p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |

| | | | |
|-----------|---|---|------------------------|
| | <p>内退还基金认购人；</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：周慕冰</p> <p>注册资本：32,479,411.7 万元人民币</p> <p>（二） 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。</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>（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,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；</p> <p>（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；</p> | <p>二、基金托管人</p> <p>（一） 基金托管人简况</p> <p>法定代表人：谷澍</p> <p>注册资本：34,998,303.4 万元人民币</p> <p>（二） 基金托管人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>（4）根据相关市场规则，为基金开设<u>资金账户、证券账户等投资所需账户</u>、为基金办理证券交易资金清算；</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>（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户<u>等投资所需账户</u>,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；</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>保存年限不低于法律法规规定的最低期限；</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |
| | <p>三、基金份额持有人</p> <p>.....</p> <p>每份基金份额具有同等的合法权益。</p> <p>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：</p> <p>（4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> | <p>三、基金份额持有人</p> <p>.....</p> <p><u>除法律法规另有规定或基金合同另有约定外</u>，每份基金份额具有同等的合法权益。</p> <p>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：</p> <p>（4）缴纳基金申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> | <p>完善相关表述。</p> |
| 第八 | <p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有</p> | <p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有</p> | <p>完善相关表述。</p> |

| | | | |
|---------------------------|---|---|--|
| <p>部分基金份额持有人大会</p> | <p>人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>一、召开事由</p> <p>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：</p> <p>(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>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、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；</p> <p>(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的基金份额类别设置、调低销售服务费率；</p> | <p>人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。<u>除法律法规另有规定或基金合同另有约定外</u>，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p> <p>一、召开事由</p> <p>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：</p> <p>(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率；</p> <p>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) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；</p> <p>(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的基金份额类别设置；</p> | |
| | <p>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> | <p>三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。</p> | <p>完善相关表述，基金合同中关于“书面表决意见”或“书面意见”修改为“表决意见”不再一一列举。</p> |
| | <p>八、生效与公告</p> <p>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</p> | <p>八、生效与公告</p> <p>基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起五日</p> | <p>根据本基金变更注册的实际情 况调</p> |

| | | | |
|-----------------------------|---|--|---|
| | <p>基金份额持有人大会按照《证券投资基金法》第八十七条的规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在规定媒介上公告。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> | <p>内报中国证监会备案。</p> <p>基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。</p> <p>基金份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。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> | 整。 |
| 第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 | <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持有人大会决议生效后2个工作日内在规定媒介公告。</p> <p>7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；</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持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告。</p> <p>7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；</p> | 完善相关表述，基金托管人的更换程序、基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序的同类修改不再一一列举。 |
| 第十一部分 基金份额的注册登记 | <p>四、基金注册登记机构的义务</p> <p>3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回与转换等业务记录15年以上；</p> | <p>四、基金注册登记机构的义务</p> <p>3、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回与转换等业务记录15年以上；</p> | 根据本基金变更注册的实际调整。 |

| | | | |
|-------|--|--|------------------------|
| 记 | | | |
| 第十部分 | 二、投资理念 严格风险控制，追求稳健收益。 | 删除 | 根据本基金变更注册的实际删除不再适用的条款。 |
| 基金的投资 | 三、投资范围 本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限(或回售期限)在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，中国证监会认可的其他具有良好流动性的固定收益类金融工具。 …… 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 | 二、投资范围 <u>本基金的投资范围主要包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、现金、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、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，但需符合中国证监会的相关规定。</u> <u>本基金不参与股票等权益类资产的投资，不参与可转换债券（可分离交易可转债中的纯债部分除外）、可交换债券的投资。</u> …… 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金资产的 80%； <u>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</u> ，本基金应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 本基金所指的中短期债券是指剩余期限不超过 3 年（含）的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、金融债券、公开发行的次级债券、企业债券、短期融资券、超短期 | 根据本基金变更注册的实际调整。 |

| | | | |
|--|--|--|------------------------|
| | | <p>融资券、中期票据、公司债券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。</p> <p><u>如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</u></p> | |
| | <p>四、投资策略</p> <p>1、组合平均剩余期限决策</p> <p>通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析、申购、赎回现金流情况等因素的综合分析，决定债券、逆回购、银行存款等资产的配置比例，保持组合的合理剩余期限。</p> <p>本基金将短期金融工具按剩余期限分为4类，3个月以下、3—6个月、6—9个月、9个月以上品种，而各期限品种内部按投资工具的特征可划分为回购、短期债（含国债、金融债、企业债）、央行票据三类。本基金管理人在评估各品种在流动性、收益率稳定性基础上，结合预先制定的组合平均期限范围确定类属资产配置。</p> <p>3、品种选择</p> <p>本基金管理人通过综合考虑品种流动性、收益率的基础上，选择品种构建组合。具体来说，遵循以下原则：</p> <p>（1）对于短期信用债券和央行票据原则上采取买入并持有的投资策略，但持有过程中会结合短期资金利率走势、信用度和与回购收益率比较分析综合评估其在收益性和流动性方面投资价值。选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的品种。</p> <p>（2）回购以短期品种为主，具体期限的选择可评估品种间利率期限结构的合理性，选择收益率相对高的品种进行投</p> | <p>三、投资策略</p> <p><u>本基金以利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</u></p> <p>1、久期配置</p> <p><u>本基金通过对宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等)和宏观经济政策(包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等)进行分析，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期。</u></p> <p>2、类属配置</p> <p><u>本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</u></p> <p>3、信用债投资策略</p> <p><u>本基金将投资信用评级不低于AA的信用债（包括企业债券、公司债券、金融债（不包含政策性金融债）、公开发行的次级债、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券）。</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |

| | | |
|---|--|--|
| <p>资。</p> <p>(3) 对于含回售条款的债券，本基金将仅买入距回售日不超过 397 天以内的债券，并在回售日前进行回售或者卖出。</p> <p>4、其他衍生工具投资策略</p> <p>本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向，一旦有新的产品推出市场，在履行适当程序后，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规通过利用其他衍生金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，并通过灵活运用趋势投资策略获取收益。</p> | <p><u>上述信用评级针对企业债券、公司债券、金融债（不包含政策性金融债）、公开发行的次级债、政府支持机构债、中期票据而言，具体指债项信用评级；针对短期融资券、超短期融资券、短期公司债券、短期金融债等短期信用债而言，具体指发行主体的信用评级。</u></p> <p><u>本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级。如出现同一时间多家评级机构所出具信用评级不同的情况或没有对应评级的信用债券，基金管理人需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定，以基金管理人的判断结果为准。</u></p> <p><u>本基金投资信用债应符合以下投资比例要求：</u></p> <p><u>本基金投资于信用评级为 AAA 信用债占信用债资产的比例为 50%-100%；</u></p> <p><u>本基金投资于信用评级为 AA+及 AA 信用债占信用债资产的比例为 0-50%；</u></p> <p><u>本基金投资于信用评级为 AA 信用债占信用债资产的比例为 0-20%。</u></p> <p><u>因信用评级变动、证券市场波动、基金规模变动等非基金管理人因素导致信用债投资比例不符合上述投资比例的，基金管理人不得主动进一步突破相应投资比例。</u></p> <p><u>本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价。本基金主要关注信用债收益率受信用利差曲线变动趋势和信用变化两方面影响，相应地采用以下两种投资策略：</u></p> <p><u>1) 信用利差曲线变化策略：首先分析经济周期和相关市场变化情况，其次分析标的债券市场容量、结构、流动性等变化趋势，最后综合分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定</u></p> | |
|---|--|--|

| | | | |
|--|---|--|-------------------------------|
| | | <p><u>本基金信用债分行业投资比例。</u></p> <p><u>2) 信用变化策略: 信用债信用等级发生变化后, 本基金将采用最新信用级别所对应的信用利差曲线对债券进行重新定价。</u></p> <p><u>本基金将根据内、外部信用评级结果, 结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断, 选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。</u></p> <p><u>4、资产支持证券投资策略</u></p> <p><u>本基金将对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究, 预测资产池未来现金流变化, 并通过研究标的证券发行条款, 预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。在严格控制风险的情况下, 结合信用研究和流动性管理, 选择风险调整后收益高的品种进行投资, 以期获得长期稳定收益。</u></p> <p><u>5、国债期货投资策略</u></p> <p><u>本基金投资国债期货将根据风险管理原则, 以套期保值为目的, 以回避市场风险, 故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量, 以萃取相应债券组合的超额收益。</u></p> | |
| | <p>七、 投资决策依据</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 国家有关法律法规和基金合同的有关规定。 2. 国家宏观经济环境及其对证券市场的影响。 3. 利率走势与通货膨胀预期。 4. 地区及行业发展状况, 市场波动和风险特征。 5. 发债主体基本面研究和信用利差分析。 <p>八、 投资决策流程</p> | <p>删除</p> | <p>根据本基金变更注册的实际删除不再适用的条款。</p> |

| | | |
|--|--|--|
| <p>1、基金经理根据利率监测报告制定资产配置方案。 研究部策略分析师在广泛参考和利用公司内、外部的研究成果，了解国家宏观经济政策基础上定期或不定期地撰写宏观策略分析报告；固定收益部根据研究部宏观报告和短期利率预测模型提供利率监测报告。基金经理根据研究部的分析报告和研究报告制定资产配置方案。</p> <p>2、投资决策委员会审议基金资产配置方案 投资决策委员会根据基金经理提供的市场研究报告、资产配置方案决议确定基金总体投资计划。</p> <p>3、基金经理制定具体的投资策略和投资组合方案 基金经理根据投资决策委员会确定的基金总体投资计划，确定整体资产配置、类属资产比例，选择券种构造投资组合。</p> <p>4、交易执行 交易部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易。</p> <p>5、风险控制委员会及风险管理部提出风险控制建议 风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估，提出风险防范措施，风险管理部对计划的执行进行日常监督和实时风险控制。</p> <p>6、基金经理对组合进行调整 根据证券市场变化、基金申购、赎回现金流情况，结合风险控制委员会对各种风险的监控和评估结果，基金经理对组合进行动态调整。</p> <p>7、本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资流程。</p> <p>九、投资组合平均剩余期限的计算方法</p> | | |
|--|--|--|

| | | |
|--|--|--|
| <p>1.平均剩余期限（天）的计算公式如下： 其中： 投资于金融工具产生的资产包括现金类资产（含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金）、银行定期存款、大额存单、债券、中期票据、逆回购、中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。 投资于金融工具产生的负债包括正回购、买断式回购产生的待返售债券等。</p> <p>2.各类资产和负债剩余期限的确定</p> <p>（1）银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为 0 天；证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>（2）银行定期存款、大额存单的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限以存款协议中约定的通知期计算；</p> <p>（3）组合中债券、中期票据的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算，允许投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至回售日的实际剩余天数计算；</p> <p>（4）回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>（5）中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；</p> | | |
|--|--|--|

| | | |
|--|---|------------------------|
| <p>(6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限；</p> <p>(7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；</p> <p>(8) 短期融资券的剩余期限以计算日至短期融资券到期日所剩余的天数计算。</p> <p>(9) 对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限。平均剩余期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限计算方法另有规定的从其规定。</p> | | |
| <p>十、投资限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>1、本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；</p> <p>2、本基金应当保持不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>3、本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 150 天；</p> <p>4、本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>5、本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；</p> <p>6、本基金的存款银行为具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格或合格境外机构投资者托管人资</p> | <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p><u>(1) 本基金对债券的投资</u>比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金资产的 80%；</p> <p><u>(2) 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</u>，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）<u>或者到期日在一年以内的政府债券</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>(5) 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%；</u>因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</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</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |

| | | |
|---|---|--|
| <p>格的商业银行。本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；</p> <p>8、本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例合计不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>9、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% ；</p> <p>11、本基金投资于同一原始受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%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始受益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>12、本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：</p> <p>（1）国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；</p> <p>（2）根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级应具备下列条件之一：</p> <p>①国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；</p> <p>②国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用评级。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。本基金持有的短期融资券信用等级下降，不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 20 个工作日内对其予以全部卖出；</p> <p>13、本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级</p> | <p>例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p><u>(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%；</u></p> <p><u>(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%；</u></p> <p><u>(10) 本基金投资于国债期货，还应遵循以下投资比例限制：</u></p> <p><u>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%；</u></p> <p><u>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%；</u></p> <p><u>3) 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%；</u></p> <p><u>4) 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；</u></p> <p><u>(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；</u></p> <p><u>(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%，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；</u></p> <p><u>(13) 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</u></p> | |
|---|---|--|

| | | |
|---|--|-------------------------|
| <p>机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有的资产支持证券信用等级下降，不再符合投资标准的，基金管理人应在评估报告发布之日起 3 个月内对其予以全部卖出；</p> <p>14、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>15、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致（质押品的剩余期限不受投资范围约定的限制）；</p> <p>16、法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。除上述 2、12、13、14、15 之条款外，因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，已达到上述标准。法律法规另有规定时，从其规定。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。若法律法规或监管部门的相关规定发生修改或变更，基金管理人履行适当程序后，本基金可相应调整投资组合限制规定。法律法规或监管部门取消该等限制的，基金管理人履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。</p> | <p>要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p><u>(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</u></p> <p><u>(15) 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。</u></p> <p><u>除上述第 (2)、(5)、(11)、(13) 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的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</u></p> <p><u>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，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。</u></p> <p><u>法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。</u></p> | |
| <p>十一、 禁止行为</p> <p>1、为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下</p> | <p>2、禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，<u>基金财产不得用于下列</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际情 况调</p> |

| | | |
|---|---|-----------|
| <p>列行为：</p> <p>(2) 向他人贷款或者提供担保；</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；</p> <p>(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；</p> <p>(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。</p> <p>2、本基金不得投资于以下金融工具</p> <p>(1) 股票；</p> <p>(2) 可转换债券；</p> <p>(3) 剩余期限（或回售期限）超过397天的债券；</p> <p>(4) 信用等级在AAA级以下的企业债券；</p> <p>(5) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；</p> <p>(6) 权证；</p> <p>(7) 股指期货；</p> <p>(8) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；</p> <p>(9) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> | <p>投资或者活动：</p> <p>(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p> <p>法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制的，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> | <p>整。</p> |
|---|---|-----------|

| | | |
|--|---|--------------------------|
| <p>法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金履行适当程序后，不受上述限制制约。</p> | | |
| <p>五、业绩比较基准 七天通知存款税后利率。 通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。 如果法律法规或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用，或有其他代表性更强、更科学客观的或者更能为市场普遍接受的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整并及时公告，并在更新的招募说明书中列示。</p> | <p>五、业绩比较基准 <u>中债-新综合全价(1 年以下)指数收益率*80%+银行活期存款利率(税后)*20%。</u> <u>中债-新综合全价(1 年以下)指数由中央国债登记结算有限责任公司于 2012 年 4 月 20 日发布，成分券包括待偿期在一年以下的除资产支持证券、美元债券、可转债以及流通受限证券(如私募债、定向募集债券等)之外，在境内债券市场公开发行的债券，是反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场短期债券指数，对短期债券价格变动趋势有很强的代表性，能较好的反映本基金的投资策略，能较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。</u> <u>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后调整或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。</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际情况调整。</p> |
| <p>六、风险收益特征 本基金为债券型基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。</p> | <p>六、风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。</p> | <p>完善相关表述。</p> |
| <p>十二、 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法 基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使所投</p> | <p>七、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利等相关权利，保护基金份额持有人的利益；</p> | <p>根据本基金变更注册的实际情况调整。</p> |

| | | | |
|-----------------|---|---|-----------------|
| | <p>资证券项下得权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使所投资证券项下权利时应遵守以下原则：</p> <p>1、不参与所投资发债公司的经营管理；</p> <p>2、有利于基金财产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。</p> | <p>2、有利于基金财产的安全与增值；</p> <p>3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。</p> | |
| | <p>十三、 基金的融资、融券</p> <p>本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。</p> | 删除 | 根据本基金变更注册的实际调整。 |
| 第十四部分 基金资产估值 | <p>一、估值目的</p> <p>基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。</p> | 删除 | 根据本基金变更注册的实际调整。 |
| | <p>三、估值对象</p> <p>基金所拥有的各类有价证券以及银行存款的本息、备付金、保证金和其他资产和负债。</p> | <p>二、估值对象</p> <p><u>基金所拥有的债券、银行存款本息、资产支持证券、国债期货合约、应收款项、其它投资等资产及负债。</u></p> | 根据本基金变更注册的实际调整。 |
| | 无 | <p>三、估值原则</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>（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。</u></p> <p><u>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</u></p> | 补充基金的估值原则。 |

| | | | |
|--|---|--|------------------------|
| | | <p>的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。</p> <p><u>（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。</u></p> <p><u>（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。</u></p> | |
| | <p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>（1）交易所上市实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定；</p> <p>（2）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，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>（3）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>2、对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为</p> | <p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>（1）在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定；</p> <p>（2）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。</p> <p>2、对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，</p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |

| | | | |
|---|--|--|---------------------|
| | <p>估值日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则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>4、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。</p> <p>6、银行存款以本金列示，按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。</p> | <p>则采用估值技术确定公允价值。</p> <p>4、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。</p> <p>5、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。</p> <p>6、国债期货合约以估值日的结算价估值。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> <p>8、本基金存入银行或其他金融机构的各种款项以本金列示，按协议或约定利率逐日确认利息收入。</p> <p>9、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。</p> | |
| <p>五、估值程序</p> <p>1、……</p> <p>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的基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。</p> | <p>五、估值程序</p> <p>1、……</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。</p> | | <p>完善相关表述。</p> |
| <p>六、估值错误的处理</p> <p>无</p> | <p>六、估值错误的处理</p> <p>4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：</p> <p><u>(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。</u></p> | | <p>补充估值错误的处理方法。</p> |

| | | |
|---|--|------------------------|
| | <p><u>(2)各类基金份额的基金份额净值计算错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。</u></p> <p><u>(3) 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，基金管理人和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。</u></p> | |
| <p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>2、因不可抗力<u>或其他情形</u>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；</p> <p>3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；</p> <p>4、如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；</p> <p>5、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；</p> | <p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、基金投资所涉及的证券<u>/期货</u>交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>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；</p> <p><u>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |
| 无 | <p><u>八、基金净值的确认</u></p> <p><u>基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |
| 八、特殊情形的处理 | 九、特殊情形的处理 | 完善相关表述。 |

| | | | |
|---------------------------|--|---|-----------------|
| | 1、基金管理人按估值方法第 7 条款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于证券交易所、登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因..... | 1、基金管理人按估值方法第 10 条款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 2、由于证券/期货交易所、登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因..... | |
| 第十五部分 基金的 费用与 税收 | 一、基金费用的种类 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； 6、基金的证券交易费用； | 一、基金费用的种类 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、 <u>仲裁费</u> 和诉讼费； 6、基金的证券/期货交易费用； | 根据本基金变更注册的实际调整。 |
| | 三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用； | 三、不列入基金费用的项目 3、《 <u>大成月添利理财债券型证券投资基金</u> 基金合同》生效前的相关费用； | 完善相关表述。 |
| | 四、基金税收 本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 | 五、基金税收 本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。 <u>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。</u> | 完善相关表述。 |
| 第十六部分 基金的 收益与 分配 | 三、基金收益分配原则 在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介和基金管理人网站公告。 | 三、基金收益分配原则 在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。 | 完善相关表述。 |
| 第十八部分 | 五、公开披露的基金信息 (一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 | 五、公开披露的基金信息 (一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 | 根据本基金变更注册的实际调整。 |

| | | | |
|--------------------------|---|---|------------------------|
| <p>基金的信息披露</p> | <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。……</p> <p>4、……</p> <p>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、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规定网站上，并将基金产品资料概要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网站上。</p> <p>基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在规定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> | <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。……</p> <p>4、……</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规定媒介上。</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规定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p> | <p>删除</p> | <p>删除本基金不再适用的条款。</p> |
| <p>(七) 临时报告</p> <p>无</p> | | <p>(五) 临时报告</p> <p><u>(22) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；</u></p> <p><u>(23) 基金合同生效后，连续 30、40、45 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000</u></p> | <p>根据本基金变更注册的实际调整。</p> |

| | | |
|---|--|---------------------|
| | <u>万元的；</u> | |
| <p>(八) 澄清公告</p> <p>在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> | <p>(六) 澄清公告</p> <p>在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。</p> | 根据监管要求调整。 |
| 无 | <p><u>(八) 基金投资资产支持证券的信息披露</u></p> <p><u>基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其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。基金管理人应在基金季度报告中披露其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。</u></p> <p><u>(九) 基金投资国债期货的信息披露</u></p> <p><u>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）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。</u></p> | 根据本基金变更注册的实际补充披露内容。 |
| 无 | <p><u>八、暂停或延迟信息披露的情形</u></p> <p><u>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信息披露：</u></p> <p><u>1、不可抗力；</u></p> <p><u>2、发生暂停估值的情形时；</u></p> | 补充暂停或延迟信息披露的情形。 |

| | | | |
|-----------------------------|---|---|-----------------|
| | | 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情形。 九、法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。 | |
| 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 经中国证监会核准 生效后方可执行，自决议生效之日起在规定媒介公告。 | 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 自生效 后方可执行，自决议生效 后两日内 在规定媒介公告。 | 完善相关表述。 |
| | 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、 符合《中华人民共和国证券法》规定 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。 | 完善相关表述。 |
| | 六、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。 | 六、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经 符合《中华人民共和国证券法》规定 的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告， 基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。 | 完善相关表述。 |
| | 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 。 | 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， 保存年限不低于法律法规规定的最低期限。 | 完善相关表述。 |
| 第二十部分 违约 | 一、…… | 一、…… 但是发生下列情况的，当事人免责： 1、基金管理人及/或基金托管人按照届时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失； | 补充基金合同当事人的免责事由。 |

| | | | |
|-------------------|--|--|-----------------|
| 责任 | | <p>2、基金管理人由于按照《基金合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失；</p> <p>3、不可抗力。</p> | |
| | 三、……但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。 | 三、……但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除 或减轻 由此造成的影响。 | 完善相关表述。 |
| 第二十一部分争议的处理和适用的法律 | <p>对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。</p> <p>《基金合同》受中国法律管辖。</p> <p>《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> | <p>对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。</p> <p>《基金合同》受中国法律管辖并从其解释。</p> <p>《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> | 完善相关表述。 |
| 第二十二部分基金合同的效力 | <p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</p> <p>2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。</p> <p>4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</p> | <p>1、本基金由大成月添利理财债券型证券投资基金转型而来。</p> <p>《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，自原《大成月添利理财债券型证券投资基金基金合同》失效之日起，本《基金合同》生效。</p> <p>2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p> <p>4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</p> | 根据本基金变更注册的实际调整。 |