

# 富国基金管理有限公司关于以通讯会议方式召开富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

## 一、召开会议基本情况

富国基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可【2002】36号文核准募集的富国天源平衡混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2002年8月16日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》。会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式。

2、会议投票表决起止时间：自2015年9月24日起，至2015年10月23日24:00止（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：富国基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期16楼

邮政编码：200120

联系人：黄晟

联系电话：021-20361818

## 二、会议审议事项

《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》（见附件一）。

## 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2015年9月23日，即在2015年9月23日下午交

易时间结束后,在注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

#### 四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登陆本基金管理人网站(<http://www.fullgoal.com.cn>)下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件正反面复印件;

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章(以下合称“公章”),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的身份证件正反面复印件或者护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)个人投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供个人投资者身份证件正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(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企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(4)机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供持有人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、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。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企业法人营业执照复印件

(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件,以及填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。

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 2015 年 9 月 24 日起,至 2015 年 10 月 23 日 24:00 止的期间内通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至基金管理人的办公地址,并在信封表面注明:“富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

送达时间以基金管理人收到表决票时间为准,即:专人送达的以实际递交时间为准;快递送达的,以基金管理人签收时间为准;以邮寄挂号信方式送达的,以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

基金管理人的办公地址及联系办法如下:

基金管理人:富国基金管理有限公司

办公地址:上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 16 楼

邮政编码:200120

联系人:黄晟

联系电话:021-20361818

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国农业银行股份有限公司)授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日(即 2015 年 10 月 23 日)后 2 个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1) 表决票填写完整清晰,所提供文件符合本会议通知规定,且在规定的时

间之内送达基金管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

(2) 如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认或意愿无法判断或相互矛盾，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，或未能在规定时间内送达基金管理人的，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，以最后送达日所填写的有效的表决票为准，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送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

## 六、决议生效条件

1、有效表决票所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）时，表明该有效表决票所代表的基金份额持有人参加了此次通讯会议，会议有效召开；在此基础上，《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》应当由前述参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；

3、本次基金份额持有人大会决议通过的事项，本基金管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《富国天源平衡混合型证券投资

基金基金合同》的规定，本次持有人大会需要出席大会的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（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，根据 2013 年 6 月 1 日施行的《中华人民共和国证券投资基金法》，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、本次大会相关机构

### 1、召集人：富国基金管理有限公司

#### （1）公司总部

联系人：黄晟

联系电话：021-20361818

#### （2）北京分公司

联系人：田野

联系电话：010-59315278

传真：010-82292350

#### （3）广州分公司

联系人：王先招

联系电话：020-22008769

传真：020-22008766

#### （4）成都分公司

联系人：张彤

联系电话：028-86767800

传真：028-867666132、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

### 3、公证机构：上海市东方公证处

联系方式：傅匀

联系人：021-62154848

4、见证律师：上海市通力律师事务所

### 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，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基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话 95105686、400-888-0688（均免长途话费）咨询。

3、本通知的有关内容由富国基金管理有限公司负责解释。

富国基金管理有限公司

二〇一五年九月二十三日

附件一：《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》

附件二：《富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书修改说明书》

**附件一：《关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案》**

**富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人：**

鉴于富国天源平衡混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）市场需求的变化，为提高产品的市场竞争力，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》有关规定，经基金管理人（富国基金管理有限公司）与基金托管人（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，对本基金的投资条款、估值条款、收益分配等进行修改。修改方案说明见附件四《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书修改说明书》。

同时，为实施本基金的变更，提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金变更的有关具体事宜，并根据持有人大会决议以及变更后基金投资运作的特点及现时有效的法律法规，在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下对《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：富国基金管理有限公司

二〇一五年九月二十三日

## 附件二：富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人姓名/名称：

证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

审议事项	同意	反对	弃权
关于修改富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书有关事项的议案			

基金份额持有人/受托人（代理人）（签字或盖章）

日期：2015年 月 日

说明：

- 1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能选择一种表决意见；
- 2、未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认、意愿无法判断或相互矛盾的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。
- 3、本表决票可从富国基金管理有限公司官方网站下载、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                    机构代表本人（或本机构）参加表决截止日为 2015 年 10 月 23 日的以通讯开会方式召开的富国天源平衡混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。若富国天源平衡混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，除非本授权文件另有载明，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）： \_\_\_\_\_

委托人证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

受托人（代理人）（签字/盖章）： \_\_\_\_\_

受托人证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：

委托日期：     年     月     日

附注：此授权委托书剪报、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。

## 附件四：富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同、招募说明书修改说明书

### 一、声明

鉴于目前本基金管理人旗下的富国天源平衡混合型证券投资基金（下称“本基金”）对投资的约定已经不能适应目前的市场环境，对基金经理的投资造成了诸多阻碍，为维护基金份额持有人利益，使本基金的风格特征更加鲜明，更加有利于投资者把握配置需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》有关规定，经基金管理人与基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）协商一致，拟对本基金基金合同、招募说明书进行修改。

2、本次合同修改需经参加持有人大会表决的基金份额持有人及代理人所持表决权的二分之一（含）以上通过，存在无法获得持有人大会表决通过的可能。

3、持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

### 二、本基金合同修改方案要点

#### （一）变更基金名称

基金名称由“富国天源平衡混合型证券投资基金”变更为“富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金”。

#### （二）调整基金的投资

对原《基金合同》中投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征等内容进行了调整，新增了股指期货、港股通标的等投资部分，并删除了基金管理人代表基金份额持有人利益行使股东权利的处理原则及方法、投资程序、投资方法等部分表述。

调整前为：

#### “（一）投资目标

本基金的投资目标是尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长。

本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产按比例投资于股票和债券，在股票投资中主要投资于成长型股票和价值型股票，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。

#### （二）投资范围

1、本基金只投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开募集、上市的股票和债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

2、本基金股票投资部分主要投资于成长型股票和价值型股票，成长型股票和价值型股票按以下原则确定：

##### （1）成长型股票，包括三类：

①经典成长型：这类公司提供新产品，创造或满足新的市场需求，新产品通常是新技术、新发明的结果；

②市场份额成长型：这类公司增长迅速的原因在于它们靠更好的产品质量、形象或服务提高市场占有率；

③合并型：这类公司的增长来自于收购大量其他公司，支付合理收购价格并实现融合是其成功的关键因素。

（2）价值型上市公司股票，是指公司经营情况良好，业绩稳定，市盈率较低上市公司发行的股票。

3、本基金债券投资部分将投资于国债、金融债和企业债（包括可转换债）。本基金将在分析宏观经济环境、利率走势、资金供求、债券市场结构的基础上，综合考虑债券的风险收益水平、流动性、期限、发行人资信水平等因素建立债券投资组合。

#### （三）投资组合

本基金的投资组合遵循以下规定：

- (1) 本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%；
- (2) 本基金投资于国债的比例不低于基金资产净值的 30%；
- (3) 本基金股票投资中，投资于成长型上市公司的基准投资比例为 60%，投资于价值型上市公司的基准投资比例为 40%，上下浮动比例为 10%；
- (4) 本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 5%；
- (5) 本基金持有一家上市公司的股票数量不超过该股票流通股的 10%；
- (6) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- (7) 遵守中国证监会等监管部门规定的其他比例限制。

由于基金规模或市场变化导致投资组合不符合上述比例规定，允许基金管理人在合理的期限内进行调整，以使投资组合符合上述规定。

#### (四) 投资策略

##### 1、 投资依据

——国家有关法律、法规和本基金基金合同的有关规定。

——国家宏观经济环境：主要包括国内生产总值、经济增长率、失业率、通货膨胀率、财政收支、国际收支、固定资产投资规模等指标。

——国家货币政策和利率走势：对中长期投资的重要的决策依据。

——国家产业政策：国家产业政策对投资方向具有重要影响。

——各行业发展状况：形成行业投资策略的重要依据。

——上市公司研究：形成投资组合的直接依据。

——证券市场走势：中国属于新兴市场，呈现较大的波动性。针对市场走势的变化调整相应的投资策略是管理好基金极其重要的基本工作。

##### 2、 投资程序

投资决策委员会负责决定基金投资的重大决策。基金经理在授权范围内，制定具体的投资组合方案并执行。集中交易室负责执行投资指令。

(1) 基金经理根据证券市场的趋势、运行的格局和特点，并结合本基金的基金合同、投资风格拟定投资策略报告。

(2) 投资策略报告提交给投资决策委员会。投资决策委员会审批决定基金的资产分布比例、成长型和价值型股票投资比例和重仓投资品种投资方案。基金经理根据批准后的投资策略确定最终的资产分布比例、股票资产中成长型和价值型股票分布比例和个股投资分布方式。

(3) 对已投资品种进行跟踪，对投资组合进行动态调整。

(4) 基金经理须每月提交工作报告及工作计划。

### 3、 投资方法

本基金采用主动投资管理模式，投资方法将主要采用自上而下的方法。

首先，对各类资产（股票、债券、现金及其他金融资产）的分布进行动态配比。

其次，确定成长型公司股票和价值型公司股票的投资比例。

第三，构造候选股票池：(1) 根据分行业股票评价体系，确定行业内的优选股票；(2) 对上述优选股票划分成长型和价值型，确定本基金的候选股票池。

第四，基金经理综合考虑资产配置、成长型和价值型股票的比例、行业状况变化及市场特点等因素，从候选股票池中挑选合适的股票，构造基金资产组合。

#### (五) 投资限制

本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、将基金资产用于抵押、担保；
- 3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 4、从事证券信用交易；
- 5、以基金资产进行房地产投资；
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司募集

的证券；

- 8、进行内幕交易、操纵市场，通过关联交易损害基金份额持有人的利益；
- 9、从事任何形式的证券承销业务；
- 10、中国证监会及有关法律法规规定禁止从事的其他行为；
- 11、基金管理人在公司披露文件中承诺的禁止从事的其他投资。

（六）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

基金管理人按照有关规定代表基金出席上市公司股东大会，行使股东权利，履行股东义务。”

调整后为：

“一、投资目标

本基金的投资目标是尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定增长。

本基金为平衡型证券投资基金，将基金资产均衡投资于股票和债券，并对基金的投资组合进行主动的管理，从而使投资者在承受相对较小风险的情况下，尽可能获得稳定的投资收益。

二、投资范围

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、港股通标的股票、固定收益类资产（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券、中小企业私募债券、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等经中国证监会允许投资的固定收益类资产）、衍生工具（权证、股指期货）、以及经中国证监会批准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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0-75%（其中，投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-75%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-75%）；债券投资占基金资产的比例为 25%-80%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围会做相应调整。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

本基金主要考虑的因素为：

（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、货币供应量、固定资产投资、进出口贸易数据等，以判断当前所处的经济周期阶段；

（2）市场方面指标，包括股票及债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金供求关系及其变化；

（3）政策因素，包括货币政策、财政政策、资本市场相关政策等；

（4）行业因素：包括相关行业所处的周期阶段、行业政策扶持情况等。

通过对以上各种因素的分析，结合全球宏观经济形势，研判国内及香港经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中大类资产的比例。

## 2、股票投资策略

本基金将运用“价值为本，成长为重”的合理价格成长投资策略来确定对境内股票及港股通标的股票的具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。

同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。

本基金将基于“定性定量分析相结合、动态静态指标相结合”的原则，筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。基金管理人将重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来成长性、权益回报率及相对价值等方面；通过运用（定性的）上市公司质量评估模型，重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。

## 3、固定收益类投资策略

（1）本基金将采用久期控制下的主动性债券投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断和信用风险评估等管理手段。在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架；对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

### （2）中小企业私募债券的投资

本基金对中小企业私募债券的投资主要围绕久期、流动性和信用风险三方面展开。久期控制方面，根据宏观经济运行状况的分析和预判，灵活调整组合的久期。信用风险控制方面，对个券信用资质进行详尽的分析，对企业性质、所处行业、增信措施以及经营情况进行综合考量，尽可能地缩小信用风险暴露。流动性控制方面，要根据中小企业私募债券整体的流动性情况来调整持仓规模，在力求



获取较高收益的同时确保整体组合的流动性安全。

### （3）证券公司短期公司债券的投资

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对证券公司短期公司债券的久期、利率风险、信用风险、流动性风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

### （4）资产证券化产品的投资

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

## 4、金融衍生工具投资

本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中，基金管理人主要通过采取有效的组合策略，将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票投资占基金资产的比例为 0-75%，其中，投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-75%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-75%；债券投资占基金资产的比例为 25%-80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，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%；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 **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；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1

年，债券回购到期后不得展期；

(15) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

(16) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

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

3) 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本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%；

(17) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在本基金托管协议或风险控制补充协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险；

(18) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(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。

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，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，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，不需要经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (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；
- (7) 法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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，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进行审查。

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行，不需经基金份额持有人大会审议。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+中债综合全价指数收益率×30%+同业存款利率×5%。

沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数。中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，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。

如果今后法律法规发生变化，或者相关数据编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，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业绩比较基准时，基金管理人可以根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，依据维护投资者合法权益的原则，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。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。”

### （三）调整基金资产估值的内容

调整前为：

#### “（一）估值目的

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。

#### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、股票估值方法：

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### （4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，

将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，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) 交易所以大宗交易方式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，按成本进行后续计量。

(5) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(6) 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) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值办法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (六) 暂停估值的情形

- 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；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、如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；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### (七) 估值错误的处理

(1) 当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等)，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事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。

(八) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项或权证估值方法的第（4）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所及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，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响；

### （九）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和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工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人（封闭式基金为每周五）。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。”

调整后为：

#### “一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

#### 二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### 三、估值方法

##### 1、证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日

的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

## 2、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（含证券公司发行的短期公司债券，另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券（含中小企业私募债券），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。

3、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

## 5、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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；

(5) 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债券，按成本估值。

6、本基金投资股指期货合约，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。

7、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定

的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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。

#### 五、估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责, 不对间接损失负责, 并且仅对估值错误的有关直接当事人负责, 不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”), 则估值错误责任方应赔偿受损方的损失, 并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利; 如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方, 则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

(1) 查明估值错误发生的原因, 列明所有的当事人, 并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据估值错误处理的方法, 需要修改基金登记机构交易数据的, 由基金登记机构进行更正, 并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(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;

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时, 基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告;

(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。

## 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的主要证券交易市场、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和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。

## 八、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。”

## (四) 调整基金的收益与分配

调整前为：

“（一）收益的构成

基金收益包括：

1、 基金投资所得红利、股息、债券利息；

2、 买卖证券价差；

3、 银行存款利息；

#### 4、 其他收入。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### (二) 收益分配原则

- 1、 每一基金份额享有同等分配权；
- 2、 如基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 3、 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行收益分配；
- 4、 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

5、 本基金收益分配采用现金形式。基金管理人为持有人提供红利再投资服务。投资者选择红利再投资服务的，其分红资金按除息日的基金份额净值转换成相应的基金份额；

#### 6、 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### (三) 收益分配方案

基金收益方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### (四) 收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

#### (五) 收益分配中发生的费用

- 1、 投资者选择红利再投资服务的，免收再投资的费用；
- 2、 本基金管理人可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在公开说明书中规定。”

调整后为：

#### “一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除



相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

## 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

## 三、基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式默认为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金。

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

3、每一基金份额享有同等分配权。如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可按监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

## 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

## 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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，在 2 个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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。

## 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方

法，依照《业务规则》执行。”

#### **（五）其他相关事项的修改**

自《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》生效以来，《基金法》、《运作办法》等法律法规陆续修改和实施，基金管理人需要根据法律法规要求及与上述几项调整修改所必须修订的基金合同相关内容。

拟请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订《基金合同》等法律文件。修订后的《基金合同》等法律文件已经中国证监会变更注册。

#### **（六）本基金基金合同的生效**

基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自基金份额持有人大会通过之日次日起，变更后的《富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金基金合同》生效，原《富国天源平衡混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

## **二、本基金招募说明书修改方案要点**

修改前：

### **“（六）投资限制**

本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、将基金资产用于抵押、担保；
- 3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 4、从事证券信用交易；
- 5、以基金资产进行房地产投资；
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司募集的证券；
- 8、进行内幕交易、操纵市场，通过关联交易损害基金份额持有人的利益；
- 9、从事任何形式的证券承销业务；
- 10、中国证监会及有关法律法规规定禁止从事的其他行为；
- 11、基金管理人承诺的禁止从事的其他投资，包括：

（1）A股流通股小于1000万股的股票；（2）ST、PT股票，但已在证监会指定报刊公告基本面发生正面重大变动的除外；（3）因涉嫌违规而接受证监会或其

他主管部门调查的公司的股票；（4）截止投资日为止前一年涨幅超过 200%的股票；（5）信用评级低于 AAA 级的企业债券，应禁止纳入组合。”

修改后：

## “2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资；
- （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；
- （7）法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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，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进行审查。

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行，不需经基金份额持有人大会审议。”

## 三、基金合同修改后的投资可行性

### （一）投资方面

基金管理人已对基金投资范围、投资策略调整后的投资运作进行了充分的分析，修改后本基金将与基金管理人同类产品的投资运作保持一致（如富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金），鉴于基金管理人丰富混合型基金运作经验，投资方面具有较好的可行性。

## **(二) 法律方面**

《基金合同》约定，基金调整投资范围、投资策略需召开基金份额持有人大会，根据《基金合同》，本次基金份额持有人大会决议属于一般决议，经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过即为有效，基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

### **四、基金合同、招募说明书修改的主要风险及预备措施**

在本基金合同、招募说明书修改之前，基金管理人已对部分持有人进行了走访，认真听取了持有人意见，结合《基金法》、《运作办法》等的规定拟定了本次基金份额持有人大会的议案。议案公告后，基金管理人还将再次征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对修改方案进行适当的修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下，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。

如果本方案未获得基金份额持有人大会批准，基金管理人将按照有关规定重新向基金份额持有人大会提交本基金合同、招募说明书修改方案议案，具体见基金管理人届时发布的公告。