（上接B5版）

为防范出现大会不能成功召集或方案被否决的风险，在提议修改资产管理合同并设计具体方案之前，集合计划管理人拟定议案综合考虑了集合计划份额持有人的要求。如有必要，集合计划管理人将根据集合计划份额持有人意见，对资产管理合同变更方案进行适当修订，并重新公告。集合计划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集合计划份额持有人大会的召开的充分准备。如果本次议案未获得集合计划份额持有人大会通过，集合计划管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向集合计划份额持有人大会提交本次议案。

（二）集合计划持有人集中赎回集合计划份额的流动性风险及预备措施

在会议召开通知公告后，部分集合计划份额持有人可能选择赎回其持有的集合计划份额。集合计划管理人将提前做好流动性安排，保持投资组合流动性，以应对可能发生的规模赎回对基金运作的影响，尽可能降低净值波动率。

附件：《长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表

《长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表

章节	《长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》条款	《长城三个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同(草案)》条款
管理人	长城证券股份有限公司	长城基金管理有限公司
全文	长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划	长城三个月滚动持有债券型证券投资基金
全文	管理人	基金管理人
全文	托管人	基金托管人
全文	集合计划份额持有人	基金份额持有人
全文	份额	基金份额
全文	计划、集合计划、本集合计划、集合资产管理计划	基金、本基金、证券投资基金
全文	本合同、资产管理合同、本资产管理合同、《资产管理合同》、集合资产管理计划资产管理合同	基金合同、《基金合同》、本基金合同
全文	托管协议	基金托管协议
全文	招募说明书	基金招募说明书
全文	产品资料概要	基金产品资料概要
第一部分 前言	一、订立本合同的目的、依据和原则 2、订立本合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公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》”)、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》和其他有关法律法规。 三、集合资产管理计划资产管理合同(以下简称“资产管理合同”或“本合同”)是规定资产管理合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与集合资产管理计划相关的涉及资产管理合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与资产管理合同有冲突，均以资产管理合同为准。资产管理合同当事人按照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定享有权利、承担义务。 资产管理合同的当事人包括集合资产管理计划管理人(以下简称“管理人”)、集合资产管理计划托管人(以下简称“托管人”)和集合资产管理计划份额持有人(以下简称“集合计划份额持有人”)。集合资产管理计划投资人自依本合同取得集合资产管理计划份额，即成为集合计划份额持有人和本合同的当事人，其持有集合资产管理计划份额的行为本身即表明其对资产管理合同的承认和接受。 三、长城证券三个月滚动持有债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)由长城季秋红2号集合资产管理计划变更而来。长城季秋红2号集合资产管理计划自管理人依照《证券公司客户资产管理业务管理办法》(证监会令第87号)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(证监会公告[2012]29号)、《长城季秋红2号集合资产管理合同》及其他有关规定募集设立。 中国证监会对长城季秋红2号集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。	一、基金管理人简况 （一）基金管理人简况 住所：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层 设立日期：1996年5月2日 批准设立机关及批准设立文号：深人银复字[1995]339号 组织形式：股份有限公司 注册资本：403,442.6956万人民币 联系电话：400-6666-888 （二）管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于： (12)依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利； (16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于： (2)办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续； (12)保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露； 二、托管人 （二）托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于： (4)根据相关市场规则，为集合计划开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为集合计划办理证券交易资金清算； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于： (2)设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜； (7)保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露； (8)复核、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购、赎回价格； (12)建立并保存集合计划份额持有人名册； 三、集合计划份额持有人 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于： (3)接受管理人或销售机构要求的风险承受能力调查和评价，如实提供身份信息、投资经验、财产状况、风险认知等相关信息，并保证所提供资料、信息的真实性、准确性、完整性；	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层 设立日期：2001年12月27日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55号 组织形式：有限责任公司 注册资本：人民币壹亿伍仟万元 联系电话：0755-29279188 （二）基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： (12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利； (16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金份额申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资和非交易过户等的业务规则； 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： (2)办理基金备案手续； (12)保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，法律法规另有规定，或监管机构、有权机关另有要求，或交易所要求披露，以及审计、法律等外部专业顾问依法要求提供的除外； 二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于： (4)根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： (2)设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜； (7)保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，法律法规另有规定，或监管机构、有权机关另有要求，或交易所要求披露，以及审计、法律等外部专业顾问依法要求提供的除外； (8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格； (12)从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册； 三、基金份额持有人 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：	一、投资目标 在追求资产安全性的基础上，力争满足客户对于短期固定周期的资金配置和保值增值的需求。 二、投资范围 本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的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，保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者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。 三、投资策略 （一）固定收益品种投资策略 “核心存量资产”为组合的主要部分，买入并战略性持有中短期限的国债、金融债、信用债等，确保总体组合取得一定的收益。核心资产投资主要采取买入持有策略，在稳定投资组合收益率、锁定下行风险方面起到重要作用。 在核心存量资产保证投资策略稳定的同时，根据市场和风险情况，灵活配置一部分为战术交易资产，采用多种固定收益投资策略，对流动性较高的债券资产进行交易，在严格控制下行风险的基础上获得增值收益。交易性资产选择以流动性良好为首要原则，另外还要为投资提供积极管理的机会。战略资产与战术交易资产比例根据各种类别固定收益投资工具的预期收益率和波动性来确定，用风险预算的原理保障使组合有很大的把握达到一定的最低收益水平。其中核心资产采用战略性持有策略，主要在选择市场切入点上追求增值，在利率走势无方向性变化时基本持有到期，可以不考虑收益率的波动性。 债券组合管理的策略应该是多元化的，其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法，其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析的合理运用。其中主要包括： 1、买入持有策略 以简单、低成本为原则，挑选符合投资目标要求的债券买入持有，并在到期后滚动投资于新发行的符合目标要求的债券。对执行买入持有策略的债券，应根据评估持有期的总回报水平评估能否满足组合在货币市场投资上的长期期望收益率。 2、债券类属配置策略 根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。 5、信用债投资策略 本集合计划将通过承担适度的信用风险来获取信用溢价的策略参与信用的投资。本集合计划将在公司内外部评级的基础上和内部的信用风险控制的框架下，通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。 本集合计划主动投资于信用债，其信用评级需在AA(含)以上，且应当遵守下列要求： (1)本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%； (2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%； (3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-20%。 信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级。 6、收益率曲线策略 在确定组合的类属久期后，进一步确定同一债券发行者不同期限债券的相对价值。确定采用哑铃型策略、梯形策略和子弹型策略等，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从其相对价格变化中获利。 7、可转换债券、可交换债券投资策略 可转换债券、可交换债券不受前述信用债评级和投资比例限制。本集合计划投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例占资产总值的0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券，其市值不得超过集合计划资产净值的5%。 除上述(2)、(9)、(13)、(14)情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，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。 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。 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： (4)买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； 管理人运用集合计划财产买卖管理人、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，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划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。 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。 五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率×90%+一年期定期存款利率×10%。 中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。 一年期定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币存款基准利率。 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。 如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，或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集合计划的业绩比较基准时，本集合计划管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略，调整集合计划的业绩比较基准，但应在取得托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开集合计划份额持有人大会审议。 六、风险收益特征 本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益低于混合型基金、股票型基金、高于货币市场基金。	一、投资目标 在追求资产安全性的基础上，力争实现资产的长期稳健增值。 二、投资范围 本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；本基金投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例不超过基金资产的20%；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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者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。 三、投资策略 （一）固定收益品种投资策略 “核心存量资产”为组合的主要部分，买入并战略性持有中短期限的国债、金融债、信用债等，以期总体组合取得一定的收益。核心资产投资主要采取买入持有策略，在稳定投资组合收益率、锁定下行风险方面起到重要作用。 在核心存量资产保证投资策略稳定的同时，根据市场和风险情况，灵活配置一部分为战术交易资产，采用多种固定收益投资策略，对流动性较高的债券资产进行交易，在严格控制下行风险的基础上获得增值收益。交易性资产选择以流动性良好为首要原则，另外还要为投资提供积极管理的机会。战略资产与战术交易资产比例根据各种类别固定收益投资工具的预期收益率和波动性来确定，用风险预算的原理保障使组合有很大的把握达到一定的最低收益水平。其中核心资产采用战略性持有策略，主要在选择市场切入点上追求增值，在利率走势无方向性变化时基本持有到期，可以不考虑收益率的波动性。 债券组合管理的策略应该是多元化的，其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法，其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析的合理运用。其中主要包括： 1、买入持有策略 以简单、低成本为原则，挑选符合投资目标要求的债券买入持有，并在到期后滚动投资于新发行的符合目标要求的债券。对执行买入持有策略的债券，应根据评估持有期的总回报水平评估能否满足组合在货币市场投资上的长期期望收益率。 2、债券类属配置策略 根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，争取取得较高收益。 5、信用债投资策略 本集合计划将通过承担适度的信用风险来获取信用溢价的策略参与信用的投资。本集合计划将在公司内外部评级的基础上和内部的信用风险控制的框架下，通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。 本集合计划主动投资于信用债，其信用评级需在AA(含)以上，且应当遵守下列要求： (1)本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%； (2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%； (3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-20%。 信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级。 6、收益率曲线策略 在确定组合的类属久期后，进一步确定同一债券发行者不同期限债券的相对价值。确定采用哑铃型策略、梯形策略和子弹型策略等，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从其相对价格变化中获利。 7、可转换债券、可交换债券投资策略 可转换债券、可交换债券不受前述信用债评级和投资比例限制。本集合计划投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例占资产总值的0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券，其市值不得超过集合计划资产净值的5%。 (二)资产支持证券投资策略 本集合计划将对基础资产质量、主体资质、未来现金流、发行条款、增信措施以及市场利率等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并采用基本面分析和数量化模型相结合的方式，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。 四、投资限制 1、组合限制 (4)本管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%； (8)本管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划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%； (9)本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。本集合计划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； (10)本集合计划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集合计划资产净值的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； (11)本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划(包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划)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%；完全按照有关指数的构成比例进行投资的开放式集合资产管理计划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； (16)本集合计划主动投资于信用债，其信用评级需在AA(含)以上，且应当遵守下列要求： 1)本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占信用债资产的50%- 100%； 2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-50%； 3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例占信用债资产的0%-20%。 信用评级参照评级机构(不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构)评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级。可转换债券、可交换债券不受此评级和投资比例限制。 本集合计划投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例占资产总值的0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券，其市值不得超过集合计划资产净值的5%； 除上述(2)、(9)、(13)、(14)情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，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。 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。 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： (4)买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、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。 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。 五、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混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。	第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、管理人 （一）管理人简况 住所：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层 设立日期：1996年5月2日 批准设立机关及批准设立文号：深人银复字[1995]339号 组织形式：股份有限公司 注册资本：403,442.6956万人民币 联系电话：400-6666-888 （二）管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于： (12)依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利； (16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于： (2)办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续； (12)保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露； 二、托管人 （二）托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于： (4)根据相关市场规则，为集合计划开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为集合计划办理证券交易资金清算； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于： (2)设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜； (7)保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露； (8)复核、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购、赎回价格； (12)建立并保存集合计划份额持有人名册； 三、集合计划份额持有人 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于： (3)接受管理人或销售机构要求的风险承受能力调查和评价，如实提供身份信息、投资经验、财产状况、风险认知等相关信息，并保证所提供资料、信息的真实性、准确性、完整性；	本集合计划份额持有人大会不设日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会，但法律法规另有规定的除外： (11)单独或合计持有本集合计划总份额10%以上(含10%)集合计划份额的集合计划份额持有人(以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算，下同)就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会； 2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会： (5)管理人、登记机构、销售机构调整有关申购、赎回、转换、集合计划份额交易、非交易过户、转托管、集合计划份额转让等业务规则； (6)管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司； 二、会议召集人及召集方式 2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。 三、召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划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。 3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为托管人，则应另行书面通知管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为集合计划份额持有人，则应另行书面通知管理人和托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。管理人或托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。 四、集合计划份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。 在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： (2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人(如果托管人为召集人，则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力； (3)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在权益登记日基金计划总份额的二分之一(含二分之一)；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见； (4)上述第(3)项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投资权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并与基金合同登记机构记录相符。 六、表决 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出席会议的基金份额持有人所代表的基金份额总数。 七、计票 2、通讯开会 在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在托管人授权代表(若由托管人召集，则为管理人授权代表)的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或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。 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 3、通讯开会的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在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一)； 十、本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。	第八部分 基金份额持有人大会	本基金计划份额持有人大会不设日常机构。 在本基金计划存续期内，根据本基金计划的运作需要，基金计划份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规另有规定的除外： (11)单独或合计持有本基金计划总份额10%以上(含10%)基金计划份额的基金计划份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会； 2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对基金计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开基金计划份额持有人大会： (5)管理人、登记机构、销售机构调整有关申购、赎回、转换、集合计划份额交易、非交易过户、转托管等业务规则； (6)管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司； 二、会议召集人及召集方式 2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。 三、召开基金计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金计划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。 3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为托管人，则应另行书面通知管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金计划份额持有人，则应另行书面通知管理人和托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。管理人或托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。 四、集合计划份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。通讯开会系指基金计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。 在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： (2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人(如果托管人为召集人，则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金计划份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力； (3)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在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金计划份额持有人大会。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)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见； (4)上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金计划份额的凭证及委托人的代理投资权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。 六、表决 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出席会议的基金份额持有人所代表的基金份额总数。 七、计票 2、通讯开会 在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在托管人授权代表(若由托管人召集，则为管理人授权代表)的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或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。 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 3、通讯开会的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在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一)； 十、本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金计划份额持有人大会审议。	第十二部分 基金的投资	一、投资目标 在追求资产安全性的基础上，力争实现资产的长期稳健增值。 二、投资范围 本基金计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%，本基金计划投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例不超过基金资产的20%；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，保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者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。 三、投资策略 （一）固定收益品种投资策略 “核心存量资产”为组合的主要部分，买入并战略性持有中短期限的国债、金融债、信用债等，以期总体组合取得一定的收益。核心资产投资主要采取买入持有策略，在稳定投资组合收益率、锁定下行风险方面起到重要作用。 在核心存量资产保证投资策略稳定的同时，根据市场和风险情况，灵活配置一部分为战术交易资产，采用多种固定收益投资策略，对流动性较高的债券资产进行交易，在严格控制下行风险的基础上获得增值收益。交易性资产选择以流动性良好为首要原则，另外还要为投资提供积极管理的机会。战略资产与战术交易资产比例根据各种类别固定收益投资工具的预期收益率和波动性来确定，用风险预算的原理保障使组合有很大的把握达到一定的最低收益水平。其中核心资产采用战略性持有策略，主要在选择市场切入点上追求增值，在利率走势无方向性变化时基本持有到期，可以不考虑收益率的波动性。 债券组合管理的策略应该是多元化的，其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法，其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析的合理运用。其中主要包括： 1、买入持有策略 以简单、低成本为原则，挑选符合投资目标要求的债券买入持有，并在到期后滚动投资于新发行的符合目标要求的债券。对执行买入持有策略的债券，应根据评估持有期的总回报水平评估能否满足组合在货币市场投资上的长期期望收益率。 2、债券类属配置策略 根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。 5、信用债投资策略 本集合计划将通过承担适度的