# 金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告

金鹰基金管理有限公司已于2016年5月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及金鹰基金管理有限公司网站（www.gefund.com.cn）发布了《金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于2016年5月24日在上述报纸和网站发布了《金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

为了优化基金的投资目标与投资策略，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》和《金鹰中证500指数分级证券投资基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，金鹰中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人交通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，审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型成为“金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）”。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：2016年6月14日起，至2016年6月27日17:00止（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票的时间为准）

3、会议通讯表决票的寄达地点

公证机关：北京市方正公证处

办公地址：北京市西城区西环广场塔3办公楼11层1113室

收件人：王顺心

电话：（010）58073628

邮政编码：100044

会议议案咨询热线：400-6135-888（免长途话费），020-83936180

请在信封背面注明：“金鹰中证500指数分级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

本次基金份额持有人会议审议事项为《关于金鹰中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明见《金鹰中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》（见附件二）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2016年6月13日，即该日下午交易时间结束后在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均享有本次会议的表决权。

四、投票方式

1、本次基金份额持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可登录本基金管理人网站（www.gefund.com.cn）下载并打印表决票或从相关报纸上剪裁、复印表决票。

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、护照或其他身份证明文件的正反面复印件，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”中的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人授权代理投票的，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 3、授权方式”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。

3、基金份额持有人或其受托人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2016年6月14日起，至2016年6月27日17:00以前（以基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄方式送达至本公告列明的寄达地点，并请在信封背面注明：“金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4. 投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-6135-888（免长途话费），020-83936180咨询。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

1、委托人

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

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注册登记机构的登记为准。

2、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或个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

3、授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面授权方式授权受托人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件四。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.gefund.com.cn）下载等方式获取授权委托书样本。

（1）个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由受托人签字或盖章的表决票，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四的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（2）机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并加盖委托人公章的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本），并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及有受托人签字或盖章的表决票。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（3）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由受托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和填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本）。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供受托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）。

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（交通银行股份有限公司）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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，且每一份基金份额在其对应的份额级别内享有平等的表决权。基金份额持有人表决票代表其持有的各级别份额的表决意见。

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基金管理人委托的公证机关的，表决时间以收到时间为准。2016年6月27日17:00以后送达基金管理人委托的公证机关的，为无效表决，不视为参加本次基金份额持有人大会表决，亦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。

（2）纸面表决票的效力认定

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基金管理人委托的公证机关的，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。

如纸面表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或无法辨认，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。

如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或受托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委托的公证机关的，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面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

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委托的公证机关收到的时间为准。

七、决议生效条件

本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人持有的金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额占权益登记日各自级别基金份额的50%以上（含50%），则本次通讯开会有效。

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。本次议案按特别决议通过，须经参加本次基金份额持有人大会的金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额的基金份额持有人及其代理人所持各自级别表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

基金份额持有人大会表决通过的事项自基金持有人大会表决通过之日起生效，将由本基金管理人在自通过之日起5日内报中国证监会备案。

八、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，本次基金份额持有人大会需要出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人持有的金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额占权益登记日各级别基金份额的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够成功召开，根据《基金法》及《基金合同》的规定，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。

九、本次大会相关机构

1、召集人：金鹰基金管理有限公司

联系地址：广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30楼

客服热线：400-6135-888（免长途话费），020-83936180

传真：020-83283445

网址：www.gefund.com.cn

邮箱：csmail@gefund.com.cn

2、基金托管人：交通银行股份有限公司

3、公证机关：北京市方正公证处

4、律师事务所：广东岭南律师事务所

十、重要提示

1、投票截止时间为2016年6月27日17:00，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、基金管理人将在发布本公告后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告，就基金份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

3、基金管理人将根据深圳证券交易所的业务规则，向深圳证券交易所申请本基金在此期间的停复牌安排，即：基金持有人大会计票之日（2016年6月28日）开市起停牌至基金持有人大会决议生效公告日10:30。

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400-6135-888（免长途话费），020-83936180咨询。

5、本基金份额持有人大会召开期间，本基金日常申购赎回业务照常进行，投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。

6、本公告的有关内容由金鹰基金管理有限公司负责解释。

**金鹰基金管理有限公司**

**二〇一六年五月二十五日**

附件一：《关于金鹰中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《金鹰中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》

附件三：《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件四：《授权委托书》

附件一：

**关于金鹰中证500指数分级证券投资基金**
**转型有关事项的议案**

金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额持有人：

为了优化基金的投资目标与投资策略，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“《运作办法》”）和《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，金鹰中证500指数分级证券投资基金的基金管理人——金鹰基金管理有限公司经与基金托管人——交通银行股份有限公司协商一致，提议将金鹰中证500指数分级证券投资基金转型为金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）。基于此次基金转型事宜，需要对本基金基金名称、基金的投资目标、投资范围和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用、基金的申购赎回、基金资产估值、基金的收益分配原则、基金份额持有人大会、基金份额的分级、折算、配对转换等条款以及因法律法规变更而对基金合同部分条款进行修改。《金鹰中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》见附件二。

为实施本基金转型方案，提议授权基金管理人办理本次金鹰中证500指数分级证券投资基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现时有效的法律法规的要求和《金鹰中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》的有关内容对金鹰中证500指数分级证券投资基金的基金合同、托管协议及招募说明书进行必要的修改和补充，并根据《金鹰中证500指数分级证券投资基金转型方案说明书》相关内容对金鹰中证500指数分级证券投资基金实施转型。

以上议案，请予审议。

**基金管理人：金鹰基金管理有限公司**

**二〇一六年五月二十五日**

附件二：

**金鹰中证500指数分级证券投资基金**
**转型方案说明书**

一、声明

金鹰中证500指数分级证券投资基金（以下或简称“金鹰中证500分级”）经中国证监会证监许可[2012]247号文批准，于2012年6月5日成立，金鹰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）为本基金的管理人，交通银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）为本基金的托管人。

为了优化基金的投资目标与投资策略，维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，依照《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《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，建议对本基金实施转型。

本次金鹰中证500分级转型事宜属金鹰中证500分级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。

本次金鹰中证500指数分级证券投资基金转型方案应当经参加大会的金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额的基金份额持有人及其代理人所持各自级别表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效，故本转型方案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

持有人大会的决议自表决通过之日起生效，本次持有人大会决议生效后，金鹰中证500指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转出或者卖出）。中国证监会对本次金鹰中证500分级变更注册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、金鹰中证500分级基金转型的方案要点

金鹰中证500分级转型方案的主要内容如下：

（一）更名

基金名称由“金鹰中证500指数分级证券投资基金”更名为“金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）”（以下简称“本基金”或“金鹰量化精选”）。基金由“指数分级基金”变更为“上市契约型开放式基金”。

（二）不再设置基金份额的分级、折算与配对转换等机制

由于本基金拟由金鹰中证500指数分级证券投资基金转型而来，转型后基金由“指数分级基金”转型为“上市契约型开放式基金”，因而将不再设置基金份额的分级、折算（定期折算及不定期折算）与配对转换等机制。

（三）授权基金管理人向深圳证券交易所申请金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额的终止上市

基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人在本次基金份额持有人大会决议生效后，按照深圳证券交易所的业务规则申请金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额终止上市等业务。

（四）转型选择期的相关安排

本次持有人大会决议生效后，金鹰中证500指数分级证券投资基金将在转型正式实施前安排选择期以供基金份额持有人做出选择（如赎回、转出或者卖出），具体时间安排详见管理人届时发布的相关公告。选择期期间，金鹰中证500份额的申购赎回、转入转出业务，金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额的交易、配对转换业务照常办理，不受影响。基金份额持有人在金鹰中证500分级正式实施转型前，可选择卖出金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额或赎回、转出金鹰中证500份额，对于在选择期内未作出选择的基金份额持有人，其持有的金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额或金鹰中证500B份额将于转换基准日进行转换，最终将转换为金鹰量化精选份额。在选择期期间，由于金鹰中证500分级需应对赎回、转出等情况，基金份额持有人同意在选择期豁免金鹰中证500分级基金合同中约定的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，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出或调整赎回方式等。

（五）基金份额的转换

基金份额持有人大会决议生效并公告后，基金管理人将确定份额转换基准日，并在该日对金鹰中证500分级的基金份额进行份额的转换，转换成金鹰量化精选的基金份额。基金份额转换的具体安排请详见基金管理人届时发布的公告。

本次转型涉及到基金份额的转换，主要可分成以下两个步骤进行：

1、将金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额转换成金鹰中证500份额的场内份额

在份额转换基准日日终，以金鹰中证 500 份额的基金份额净值为基准，金鹰中证500A 份额、金鹰中证500B 份额按照各自的基金份额参考净值转换成金鹰中证 500 份额的场内份额。金鹰中证500A 份额（或金鹰中证500B 份额）基金份额持有人持有的转换后金鹰中证 500 份额的场内份额取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

金鹰中证500A（或金鹰中证500B）的转换比例＝份额转换基准日金鹰中证500A（或金鹰中证500B）的基金份额参考净值/份额转换基准日金鹰中证 500 份额的基金份额净值

金鹰中证500A（或金鹰中证500B）基金份额持有人持有的转换后金鹰中证 500份额的场内份额＝基金份额持有人持有的转换前金鹰中证500A（或金鹰中证500B）的份额数×金鹰中证500A（或金鹰中证500B）的转换比例

2、将金鹰中证500份额转换成金鹰量化精选份额

在金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额转换为金鹰中证500份额后，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将金鹰中证500份额统一转换为份额净值为1.0000元的金鹰量化精选份额。金鹰中证500份额的场内份额和场外份额相应地转换成金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）的场内份额和场外份额。金鹰中证500 份额的场内份额持有人持有的转换后的金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）场内份额取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金财产。

份额转换的计算公式如下：

转换后金鹰量化精选场内份额的份额数=转换前金鹰中证500场内份额数×份额转换基准日金鹰中证500 份额的基金份额净值/1.0000

转换后金鹰量化精选场外份额的份额数=转换前金鹰中证500场外份额数×份额转换基准日金鹰中证500 份额的基金份额净值/1.0000

转换后金鹰量化精选场内份额和场外份额的份额净值均为1.0000元。

金鹰中证500A份额（或金鹰中证500B份额）、金鹰中证500份额的场内份额经转换后的份额数采用取整计算（最小单位为1份），取整后的余额计入基金资产。故基金份额转换后，由于基金份额数取整计算产生的误差，基金份额持有人存在着基金资产净值减小的风险。对于持有份额数较少的金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额或金鹰中证500份额场内份额的持有人，存在着持有的基金份额转换后份额数不足一份而被计入基金资产的风险。

在金鹰量化精选基金份额上市交易前，由原金鹰中证500场内份额转换而来的金鹰量化精选场内份额的持有人只能通过赎回基金份额的方式退出投资。在金鹰量化精选基金份额上市交易后，基金份额持有人可通过赎回或卖出基金份额的方式退出投资。

（六）基金合同的生效

自金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额转换基准日（指金鹰中证500指数分级基金基金份额转换为金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额之日）的次日起，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》同时失效，金鹰中证500指数分级证券投资基金正式变更为金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF），本基金基金合同当事人将按照《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》享有权利并承担义务。

上述具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

（七）转型后基金的基本情况

1、基金名称

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

2、基金的类别

股票型证券投资基金

3、基金的运作方式

上市契约型开放式（LOF）

4、基金的投资目标

运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。

5、基金份额的上市交易

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。

（八）基金的投资目标、投资范围、投资限制和投资策略

1、投资目标

运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。

2、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（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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：本基金投资组合中股票资产占基金资产的80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于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，基金保留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%；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。”

3、投资策略

（1）资产配置策略

本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于80%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量宏观面、政策面、基本面、资金面、系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。

（2）股票投资策略

本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。在实际运行过程中，将定期或不定期的进行修正，优化股票投资组合。本基金采用的量化投资策略主要有：

1）多因子选股模型

多因子选股模型由本基金管理人根据中国资本市场的实际情况开发的具有针对性和实用性的数量化选股模型。模型首先综合考虑经济因素、流动性因素、行业发展轨迹等大的市场环境，其次细致评估个股的估值情况、成长情况、动量情况、交易行为情况等进行多维度的筛选。模型按照多维因子，并经过数量量化模型进行筛选，选出符合模型的个股组成一篮子投资组合，并定期更新投资组合。

2）事件驱动模型

通过研究发现，有较多事件驱动策略在中国A股市场有效或阶段性有效。如一致预期变动策略、上市公司业绩超市场预期策略、管理层增持策略、大股东减持策略、指数成份股调整策略等。我们将在适当的时机选用合适的策略，用于捕捉阶段性的超额收益或绝对收益。

3）行业轮动模型

本基金通过把握经济周期变化，依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动、市场情绪轮动等因素的综合判断，识别出当阶段影响行业股价收益率的关键因素，判断行业是否在估值修复、触底回升等阶段，并计算各行业的绝对、相对上涨趋度强度，以实现各行业的合理和优化的配置。

4）评级反转策略

评级反转策略综合利用证券分析师提供的研究报告信息、以及股票的市场交易信息进行选股。该策略倾向于选择具有以下特征的股票：在一段时期内，某个股票的多个研究报告均给出较正面的信息，即大部分的证券分析师看好该股的后市走势，然而在二级市场上，该股票的表现却滞后于行业指数的表现。当分析师已获取的信息和预测被市场进一步验证时，该类股票有望获得超额收益。

（3）债券投资策略

基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。本基金以经济基本面变化趋势分析为基础，结合货币、财政宏观政策，以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，判断利率和债券市场走势；运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

（4）中小企业私募债券投资策略

本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法，对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。深入研究债券发行人基本面信息，分析企业的长期运作风险；对债券发行人进行财务风险评估；利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率并考察债券发行人的增信措施。综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，确定具有投资价值的债券品种。

（5）衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。本基金将合理利用股指期货、权证等衍生工具发掘可能的投资机会，稳健投资，实现基金资产的保值增值。

（6）资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。”

4、投资限制

（1）基金的投资组合应遵循以下限制：

1）本基金投资组合中股票资产占基金资产净值的比例为80%-95%；

2）本基金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，应当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；

3）本基金持有一家公司的证券，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）基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

16）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）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；

18）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；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个交易日基金资产净值的20%；

19）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）占基金资产净值的比例为80%-95%；

20）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%；

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。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。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。期间，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，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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

5）向其基金管理人、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、行政法规或者中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

如法律法规或监管部门取消上述限制，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。”

5、业绩比较基准

沪深300指数收益率×80%＋中证全债指数收益率×20%

沪深300指数对A股市场总体走势具有较强代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证全债指数能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金固定收益部分的业绩比较基准。此外，本基金还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重。

如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照，不决定也不必然反映本基金的投资策略。”

6、风险收益特征

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

(九)转型后基金的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的相关账户的开户费用、账户维护费用；

（7）基金的证券交易、期货交易及结算费用；

（8）基金的银行汇划费用；

（9）基金上市费及年费；

（10）基金注册登记TA服务费；

（11）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3－11项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

（十）转型后基金的收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者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，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红；

3、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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（十一）转型后基金的申赎与赎回

1、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

投资者可使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销中心和其他场外销售机构，办理基金份额的场外申购与赎回业务。投资者也可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所系统办理基金份额的场内申购与赎回业务。场内申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

具体的销售网点将由基金管理人在其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

2、申购和赎回的开放日及时间

（1）开放日及开放时间

投资者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