关于以通讯方式召开新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告

新华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）决定以通讯方式召开新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）（场内简称：新华惠鑫，代码：164302）基金份额持有人大会，并于2017年7月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、深圳证券交易网站（www.szse.cn）和基金管理人网站（www.ncfund.com.cn）发布了《关于以通讯方式召开新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“新华惠鑫”或“本基金”）的基金管理人新华基金管理股份有限公司决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，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2017年8月14日起至2017年8月23日17:00止（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准）

3、会议计票日：2017年8月24日

4、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T3楼11层1113室

公证员：王顺心、刘晓村

电话：（010）58073628

邮政编码：100044

请在信封表面注明：“新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-819-8866咨询。

二、会议审议事项

《关于新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明详见《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案说明书》（见附件四）。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2017年8月11日，即2017年8月11日交易时间结束后，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有权参加本次基金份额持有人大会（注：权益登记日当天申请申购的基金份额不享有本次会议表决权，权益登记日当天申请赎回的基金份额享有本次会议表决权）。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站（www.ncfund.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（或基金管理人认可的其他印章，下同），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）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（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有效身份证件正反面复印件，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和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）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（详见附件三）。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）；

（5）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，并提供机构投资者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（详见附件三）。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）；

（6）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和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）。

（7）以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书，以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2017年8月14日起，至2017年8月23日17:00以前通过专人送交或邮寄的方式送达至本次持有人大会公证机关的办公地址，并请在信封表面注明：“新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决专用”。

本次持有人大会公证机关的办公地址及联系方式如下：

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T3楼11层1113室

公证员：王顺心、刘晓村

电话：（010）58073628

邮政编码：100044

4、投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-819-8866咨询。

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（中国工商银行股份有限公司）授权代表的监督下于2017年8月24日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、本基金基金份额持有人所持有的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，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（2）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指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

（3）基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

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

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

六、决议生效条件

1、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所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）；

2、《关于新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案》须经参加本次持有人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；

3、本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人自决议通过之日起五日内报中国证监会备案。

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》和基金合同的规定，本次持有人大会需要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二分之一以上方可举行。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《中华人民共和国证券投资基金法》及基金合同，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：新华基金管理股份有限公司

2、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

3、公证机构：北京市方正公证处

4、见证律师事务所：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通知公告发布时间为2017年7月24日，本基金自2017年7月24日开市起至当日上午10:30停牌一小时。

3、本次基金份额持有人大会计票日为2017 年8 月24 日，为了保证本次基金份额持有人大会后续事项的顺利进行，本基金自2017 年8 月24 日开市起停牌至基金持有人大会决议生效公告日10:30 复牌。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

4、上述基金份额持有人大会有关公告可通过新华基金管理股份有限公司网站查阅，投资人如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-819-8866咨询。

5、本通知的有关内容由新华基金管理股份有限公司负责解释。

附件一：《关于新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案》

附件二：《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》（样本）

附件四：《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案说明书》

新华基金管理股份有限公司
二〇一七年七月二十五日

附件一：

关于新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案

新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人：

根据市场环境变化，为更好地匹配投资人需求，维护基金份额持有人利益，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》和《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，基金管理人新华基金管理股份有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议对基金合同进行适当修改和调整，包括投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准及赎回费率等。具体内容详见附件四《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案说明书》。

为实施对新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的调整，提议授权基金管理人办理有关具体事宜，包括但不限于根据现时有效的法律法规的要求和《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案说明书》的有关内容对基金合同、《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）托管协议》及《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》进行修改。

以上议案，请予审议。

新华基金管理股份有限公司
2017年7月24日

附件二：

新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名或名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号）		基金账户号/证券账户卡号	
审议事项	同意	反对	弃权
关于新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案			
基金份额持有人/受托人（代理人）签字或盖章　　2017年　月　日			

说明：

1、请以打“√”方式在相应栏内注明表决意见。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所填基金账户号/证券账户卡号下的全部基金份额（以权益登记日所登记的基金份额为准）的表决意见。

2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决；签字/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指定联系地址的，视为无效表决。

3、本表决票中“证件号码”，仅指基金份额持有人认购、申购或在证券交易所买卖新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

4、本表决票中“基金账户号/证券账户卡号”，指持有新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）的账户卡号。同一基金份额持有人拥有多个基金账户/证券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/证券账户卡号，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。

（本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站（www.ncfund.com.cn）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。）

附件三：

授权委托书（样本）

兹委托　　代表本人（或本机构）参加投票截止日为2017年8月23日的以通讯方式召开的新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，并代为全权行使对议案的表决权。授权有效期自本委托书签署日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。

若新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人（签字/盖章）：_____

委托人身份证件号码或营业执照注册号：_____

委托人基金账户号/证券账户卡号：_____

受托人（代理人）（签字/盖章）：_____

受托人（代理人）身份证件号码或营业执照注册号：_____

委托日期：2017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。

授权委托书填写注意事项：

1、本授权委托书中“委托人身份证件号码或营业执照注册号”，指基金份额持有人认购、申购或在证券交易所买卖本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

2、本表决票中“基金账户号/证券账户卡号”，指持有新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）的账户卡号。同一基金份额持有人拥有多个基金账户/证券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/证券账户卡号，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：

新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案说明书

一、重要提示

1、新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“新华惠鑫”）由新华惠鑫分级债券型证券投资基金转型而成。新华惠鑫分级债券型证券投资基金于2013年10月18日获中国证监会证监行政许可【2013】1320 号文注册，《新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同》于2014年1月24日生效。根据《新华惠鑫分级债券型证券投资基金基金合同》的约定，三年封闭期到期，于2017年1月25日转型为新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF），并于2017年2月8日开放申购、赎回，2017年2月24日上市交易。

为更好地满足投资人需求，维护基金份额持有人利益，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》和《新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，本基金管理人（新华基金管理股份有限公司）经与基金托管人（中国工商银行股份有限公司）协商一致，决定召开基金份额持有人大会，审议《关于新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）变更投资范围、投资策略和赎回费率等有关事项的议案》。

2、本次新华惠鑫修改基金合同事宜属新华惠鑫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、本次持有大大会议案需经参加本次持有人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，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议自表决通过之日起生效。

5、中国证监会对本次新华惠鑫变更注册所作的任何决定或意见，均不表明其对新华惠鑫的价值或投资人的收益做出实质性判断或保证。

二、基金合同修改内容

章节	修改前	修改后
第一部分 前言		添加：六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。
第五部分 基金的存续	一、基金的变更登记《新华惠鑫债券型证券投资基金(LOF)基金合同》生效后，基金管理人负责办理基金份额的变更登记。基金管理人根据生效日的基金份额持有人名册，进行基金份额更名以及必要的信息变更，并对投资者持有的基金份额予以确认或重新登记。二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模。	删除
第七部分 基金份额的申购与赎回	(二)申购和赎回的开放日及时间2、申购、赎回开始日及业务办理时间本基金的申购、赎回自转换为上市开放式基金(LOF)之日起不超过30 日内开始办理，具体业务办理时间在申购、赎回开始公告中规定。	(二)申购和赎回的开放日及时间2、申购、赎回开始日及业务办理时间删除
第七部分 基金份额的申购与赎回	(七)拒绝或暂停申购的情形7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。发生上述第1、2、3、5、6、7项暂停申购情形之一且基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。	(七)拒绝或暂停申购的情形添加：7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的50%，或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形。8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
第十三部分 基金的投资	二、投资范围本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包含国债、央票、政策性金融债及所有非国家信用的固定收益类金融工具)、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)，货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为：本基金是债券型基金，投资于国债、中央银行票据、银行同业存款、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、可转换公司债(含分离交易的可转换公司债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、回购等债券资产占基金资产比例不低于80%；其中单只中小企业私募债占基金资产比例不高于10%。本基金将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。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等非固定收益类金融工具，但可以参与一级市场新股与增发新股的申购，并可持有因可转债转股所形成的股票，因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的权益类金融工具，其中持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起60个交易日内卖出。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。	二、投资范围本基金的投资对象主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易的可转债)、可交换债券、中小企业私募债、短期融资券等)、债券回购、同业存单、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
第十三部分 基金的投资	三、投资策略本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略以及权益类资产投资策略。首先，本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略，在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例。在此基础之上，一方面综合运用久期策略、收益率曲线策略以及信用策略进行固定收益类资产投资组合的构建；另一方面通过定量与定性相结合的分析方法，积极进行新股申购、定向增发、可转债转股等投资操作，在新股流通后择机卖出以提高基金的整体收益水平。	三、投资策略本基金管理人将采用战略性与战术性相结合的大类资产配置策略，在基金合同规定的投资比例范围内确定各大类资产的配置比例，在此基础之上，一方面综合运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、信用策略等进行债券投资组合的构建；另一方面采用自下而上的个股精选策略，精选具有持续成长性且估值相对合理的个股进行重点关注。另一方面，本基金也将积极跟踪公司股价表现，运用趋势跟踪及模式识别模型进行股价跟踪，重点关注股价具有向上趋势的个股，基于以上两方面构建股票投资组合，以提高基金的整体收益水平。(五)权证投资策略……
第十三部分 基金的投资	三、投资策略(二)固定收益类资产投资策略1、久期策略久期策略……2、收益率曲线策略……3、信用策略本基金主要投资信用债券，主要包括：金融债券(不含政策性金融债)、企业债券(含中小企业私募债券)、公司债券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类债券。因此，信用策略是本基金固定收益类资产投资策略的重要组成部分。本基金的信用策略主要包含信用利差曲线配置、个券精选策略、信用调整策略以及信用风险控制等方面。(1)信用利差曲线策略……8、资产支持证券的投资策略资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券(MBS)等。可以从信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素等五个方面进行考虑。其中信用因素是目前最重要的因素，本基金运用CreditMetrics模型——信用矩阵来估计信用利差。该模型的方法主要是估计一定期限内，债务及其它信用类产品构成的组合价值变化的远期分布。这种估计是通过建立信用评级转移矩阵来实现的。其中先对单个资产的信用风险进行分析，然后通过考虑资产之间的相关性和风险头寸，把模型推广到多个债券或贷款的组合。9、流动性管理策略本基金将采用持续滚动投资方法，将回购或债券的到期日进行均衡等量配置，以应对大量赎回产生的流动性需求。本基金将通过发行量、前一个月日均成交量、前一个月的交易频率、买卖价差、剩余到期期限等指标甄别个券的流动性。	三、投资策略(二)债券投资策略本基金采用的债券投资策略包括：久期调整策略、收益率曲线配置策略、骑乘策略、信用策略、中小企业私募债选择策略等。1、久期调整策略久期调整策略……2、收益率曲线配置策略……3、信用策略……本基金的信用策略主要包含信用利差曲线配置、个券精选策略、信用调整策略以及信用风险控制等方面。(1)信用利差曲线策略……8、流动性管理策略本基金将采用持续滚动投资方法，将回购或债券的到期日进行均衡等量配置，以应对大量赎回产生的流动性需求。本基金将通过发行量、前一个月日均成交量、前一个月的交易频率、买卖价差、剩余到期期限等指标甄别个券的流动性。(三)资产支持证券的投资策略资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等。可以从信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素等五个方面进行考虑。其中信用因素是目前最重要的因素，本基金运用CreditMetrics模型——信用矩阵来估计信用利差。该模型的方法主要是估计一定期限内，债务及其它信用类产品构成的组合价值变化的远期分布。这种估计是通过建立信用评级转移矩阵来实现的。其中先对单个资产的信用风险进行分析，然后通过考虑资产之间的相关性和风险头寸，把模型推广到多个债券或贷款的组合。
第十三部分 基金的投资	三、投资策略(三)权益类资产投资策略1、一级市场策略在参与股票一级市场投资(新股申购及增发)的过程中，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平、一二级市场价差及股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好投资收益。2、权证投资策略……	三、投资策略(四)股票投资策略本基金主要采取自下而上的个股精选策略。一方面，本基金将从公司盈利模式、盈利能力、所属行业发展前景、公司行业地位、竞争优势、治理结构等方面对公司进行深入分析和研究，筛选出具有持续成长性且估值相对合理的个股进行重点关注。另一方面，本基金也将积极跟踪公司股价表现，运用趋势跟踪及模式识别模型进行股价跟踪，重点关注股价具有向上趋势的个股，基于以上两方面构建股票投资组合，以提高基金的整体收益水平。(五)权证投资策略……
第十三部分 基金的投资	四、投资限制(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%；(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%；(17)本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管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。基金管理人应制定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；	四、投资限制(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%；(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；(17)本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管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。基金管理人应制定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；
第十三部分 基金的投资	五、业绩比较基准本基金的业绩比较基准为：中债新综合指数(全价)。中债新综合指数(全价)由中央国债登记结算公司编制，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。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。	五、业绩比较基准本基金的业绩比较基准为：中债企业债总全价指数收益率×60%+中债国债总全价指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%。中债企业债总全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司(以下简称中债公司)编制并发布。中债企业债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的所有中央企业债和地方企业债的整体价格走势和投资回报情况；中债国债总全价指数综合反映了银行间债券市场、柜台以及上海证券交易所流通交易的记账式国债的整体价格走势和投资回报情况。沪深300指数是由中证指数有限公司编制的反映A股市场整体走势的指数。其样本覆盖了沪深市场60%左右的市值。上述指数具有良好的市场代表性，能够分别反映我国企业债、国债以及沪深股票市场的总体走势，适合作为业绩比较基准。
第十三部分 基金的投资	八、基金的融资、融券本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。	删除
第十五部分 基金资产估值	三、估值方法1、证券交易所上市的有价证券的估值(2)交易所上市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)交易所上市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；4、因持有股票而享有的配股权，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。	三、估值方法1、证券交易所上市的有价证券的估值(2)交易所上市实行净价交易的固定收益品种按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，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，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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；(3)交易所上市未实行净价交易的固定收益品种按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去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，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去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；删除
第十五部分 基金资产估值	六、暂停估值的情形1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；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、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基金份额持有人的利益，决定延迟估值；4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。	六、暂停估值的情形1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十五部分 基金资产估值		添加：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6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、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司发送的数据错误等原因，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，但未能发现错误的，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消除或减轻由此造成的影响。
第十六部分 基金的费用与税收	一、基金费用的种类5、(基金合同)生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；8、基金的银行汇划费用；	一、基金费用的种类5、(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；8、基金的银行汇划费用、账户开户费用、账户维护费；
第十九部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息(五)基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告	五、公开披露的基金信息(五)基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告添加：如报告期内出现单一投资者持有基金份额数的比例超过基金份额总数20%的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。
第十九部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息(九)中国证监会规定的其他信息。	五、公开披露的基金信息(九)投资于资产支持证券的信息本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年报及半年报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。(十)中国证监会规定的其他信息。
第二十部分	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完成备案手续生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。	一、(基金合同)的变更2、关于(基金合同)变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

修订后的基金合同自本次持有人大会决议生效并公告的下一工作日起生效。

三、赎回费率的调整

1、新华惠鑫的赎回费率调整如下：

持有基金份额期限（T）	赎回费率
T<30日	0.1%
T≥30日	0

上述赎回费全部归入基金资产。

2、赎回金额的计算及处理方式

新华惠鑫采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日基金份额净值为基准进行计算，赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。计算公式：

赎回总金额=赎回份额(T日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额(赎回费率

赎回金额=赎回总金额(赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者赎回本基金10,000.00 份基金份额，假设持有期限为20日，对应的赎回费率为0.10%，假定T 日本基金的基金份额净值为1.210 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000.00×1.210 元=12,100.00 元

赎回费用=12,100.00×0.1%=12.10元

赎回金额=12,100.00-12.10=12,087.90元

即投资者赎回本基金份额10,000.00份，假设持有期限为20日，赎回当日本基金的基金份额净值为1.210 元，则其可得到的赎回金额12,087.90元。

3、自修订后的基金合同生效日（T日）起，上述赎回费率适用于申购新华惠鑫基金份额的新持有人，对T日前（不含T日）已持有基金份额的持有人不收取赎回费。

证券代码：603568　证券简称：伟明环保　公告编号：临2017-040

浙江伟明环保股份有限公司 关于完成注册资本及经营范围工商变更登记的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

浙江伟明环保股份有限公司（以下简称"公司"）于2017年4月14日召开的第四届董事会第二十次会议审议通过了《关于增加公司经营范围的议案》和《关于修改（公司章程）部分条款的议案》。上述议案已经公司2016年年度股东大会审议通过。具体内容详见公司在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的《浙江伟明环保股份有限公司第四届董事会第二十次会议决议公告》（公告编号：临2017-018）、《浙江伟明环保股份有限公司关于增加公司经营范围和修订<公司章程>的公告》（公告编号：临2017-024）、《浙江伟明环保股份有限公司2016年年度股东大会决议公告》（公告编号：临2017-028）。

公司董事会依据股东大会的授权修改了《公司章程》相应条款，并办理工商变更登记等相关事宜。近日，公司取得浙江省工商行政管理局换发的《企业法人营业执照》（统一社会信用代码：91330000734522019A）。本次变更的登记事项具体如下：

一、基本登记信息变更情况：

（一）公司注册资本由"人民币陆亿捌仟零柒拾万元整"变更为"人民币陆亿捌仟柒佰贰拾壹万元整"。

（二）公司经营范围由"垃圾焚烧发电，垃圾处理项目的投资，环保工程的投资咨询及建设，垃圾、烟气、污水、灰渣处理技术的开发及服务，环保设备的制造、销售及安装服务。"变更为"垃圾焚烧发电，垃圾处理项目的投资，固废处理工程、垃圾渗滤液处理工程、环保工程的设计、投资咨询、施工、运营管理及技术服务，垃圾、烟气、污水、灰渣处理技术的开发及