（上接B23版）

第六部分 基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由管理人在招募说明书或基金管理人网站列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划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、赎回业务。

若管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行集合计划份额的申购与赎回。具体办法由管理人或指定的销售机构另行公告。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本集合计划参与港股通交易日是该下日为非港股通交易日时，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时发布的公告为准）。但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本集合计划的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

资产管理合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，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。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人可根据实际情况依法决定本集合计划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载明。

管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理A类份额、C类份额赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中载明。

管理人不得在资产管理合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金管理合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日集合计划份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算；

2、“先进先出”原则，即按照持有基金份额期限的先后次序进行顺序赎回。

管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整，管理人必须依新规则并公告披露依据《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购与赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；集合计划份额登记机构确认集合计划份额时，申购生效。

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本合同有关条款处理。遇证券/期货交易所市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至前述因素消失日的下一个工作日划出。

3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构以T日收到申请的当天作为投资人所能控制的投资决策时间，基金管理人将视情况对销售机构的投资决策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。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定和基金合同约定的范围内，且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，对上述业务办理时间进行调整，但须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

五、申购和赎回的数量限制

4、基金管理人可以规定本基金的总规模限额、单日申购金额限制、单日赎回份额比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限，具体规定请参照销售机构有关公告。

6、基金管理人可在不违反法律法规规定的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制，或新增基金规模控制措施。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本集合计划A类份额和C类份额分别设置代码、分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。本集合计划各类份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金份额持有人承担。T日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购份额的计算及金额的处理方式：本集合计划申购份额的计算详见《招募说明书》。本集合C类基金份额不收取申购费。本基金A类基金份额申请基金管理人认定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为申购金额除以当日的该类集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果按份额单位四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由集合计划资产承担。

3、赎回金额的计算及处理方式：本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的赎回费率及费率计算方式，在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。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资产承担。

4、申购费用由申购相应类别集合计划份额的投资人承担，不列入基金资产。本基金C类基金份额不收取申购费用。

5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额赎回时从赎回金额中扣除。赎回费用扣入基金财产的比例依照相关法律法规规定，具体见招募说明书的规定，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费，其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入集合计划资产。

6、投资者申购本集合计划A类份额净申购费，申购本集合计划C类份额不需缴纳申购费用。本集合计划各类计划份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由管理人根据资产管理合同的规定确定，并在招募说明书中列示。管理人可以在资产管理合同约定的范围内调整费率或收费方式，并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

7、当本基金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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定。

8、管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据届时市场情况制定临时规则，定期或不定期地开展促销活动。在促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低集合计划的销售费率。

七、拒绝或暂停申购的情形

2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划份额申购的情形；

3、证券、期货交易所或外汇市场依法决定临时停市或交易时间非正常停市或港股通临时暂停，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、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接受基金申购申请；

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构发生重大故障，导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

8、申请期过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限、单日申购金额限制的；

10、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或终止接受买入申请，或者无法接受与服务公司等机构认定的交易指令相关申请的情况下，基金管理人根据届时市场情况决定全面接受赎回申请，或暂停接受赎回申请，或选择部分接受赎回申请，其中，对于未能接受的赎回申请，其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；

3、证券、期货交易所或外汇市场依法决定临时停市或交易时间非正常停市或港股通临时暂停，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、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接受基金申购申请；

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构发生重大故障，导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

8、申请期过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限、单日申购金额限制的；

10、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或终止接受买入申请，或者无法接受与服务公司等机构认定的交易指令相关申请的情况下，基金管理人根据届时市场情况决定全面接受赎回申请，或暂停接受赎回申请，或选择部分接受赎回申请，其中，对于未能接受的赎回申请，其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

九、暂停基金资产估值的情形

1、发生巨额赎回或连续巨额赎回的情形；

2、证券交易所或外汇市场依法决定临时停市或交易时间非正常停市或港股通临时暂停，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金管理人认为在当日收市后计算当日的基金份额净值可能会对现有基金份额持有人利益造成重大不公平的情形；

4、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接受基金申购申请；

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构发生重大故障，导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

8、申请期过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限、单日申购金额限制的；

10、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或终止接受买入申请，或者无法接受与服务公司等机构认定的交易指令相关申请的情况下，基金管理人根据届时市场情况决定全面接受赎回申请，或暂停接受赎回申请，或选择部分接受赎回申请，其中，对于未能接受的赎回申请，其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；

3、证券、期货交易所或外汇市场依法决定临时停市或交易时间非正常停市或港股通临时暂停，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

4、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接受基金赎回申请；

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构发生重大故障，导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

8、申请期过基金管理人设定的单笔赎回份额、单日赎回份额比例上限、单个投资者单日或单笔赎回金额上限、其他限制赎回份额的申请；

10、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或终止接受买入申请，或者无法接受与服务公司等机构认定的交易指令相关申请的情况下，基金管理人根据届时市场情况决定全面接受赎回申请，或暂停接受赎回申请，或选择部分接受赎回申请，其中，对于未能接受的赎回申请，其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

十一、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时；

3、证券、期货交易所或外汇市场依法决定临时停市或交易时间非正常停市或港股通临时暂停，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

4、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接受基金赎回申请；

7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构发生重大故障，导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行；

8、申请期过基金管理人设定的单笔赎回份额、单日赎回份额比例上限、单个投资者单日或单笔赎回金额上限、其他限制赎回份额的申请；

10、因港股通交易当日额度使用完毕而暂停或终止接受买入申请，或者无法接受与服务公司等机构认定的交易指令相关申请的情况下，基金管理人根据届时市场情况决定全面接受赎回申请，或暂停接受赎回申请，或选择部分接受赎回申请，其中，对于未能接受的赎回申请，其他影响通过内地与香港股票市场交易互联互通机制进行正常交易的情形。

第八部分 基金份额持有人大会

一、召集人

1、除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定之外，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：

(1)终止《资产管理合同》(因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外)；

(5)调整管理人、托管人的报酬标准、提高销售服务费；

(11)单独或合计持有本集合计划总份额10%以上（含10%）集合计划份额的持有人(以管理人收到报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：

(2)调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费或变更收费方式；

(5)集合计划推出新业务或服务；

(6)增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；

(7)管理人、登记机构、销售机构调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；

2、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；

3、托管人认为有必要召开集合计划份额持有人大会的，应当向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知托管人。管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；管理人决定不召集，托管人仍认为有必要召开的，应当由托管人自行召集，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知管理人，管理人应当配合。

4、代表集合计划份额10%以上（含10%）的持有人就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会，应向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和托管人。管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；管理人决定不召集，代表集合计划份额10%以上（含10%）的持有人仍认为有必要召开的，应当向托管人提出书面提议。托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和管理人。若托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；管理人决定不召集，代表集合计划份额10%以上（含10%）的持有人仍认为有必要召开的，应当向托管人提出书面提议。托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和管理人。若托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；托管人决定不召集，代表集合计划份额10%以上（含10%）的持有人仍认为有必要召开的，应当向托管人提出书面提议。托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和管理人。若托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；并告知管理人。管理人应当配合。

5、代表集合计划份额10%以上（含10%）的持有人就同一事项要求召开集合计划份额持有人大会，而管理人、托管人都不召集的，单独或合计代表集合计划份额10%以上（含10%）的持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。集合计划份额持有人依法自行召集集合计划份额持有人大会的，召集人应当在发出召开集合计划份额持有人大会的通知前，向基金管理人、托管人所在地中国证监会派出机构进行备案。

六、召集人在发出召开集合计划份额持有人大会的通知前，向中国证监会派出机构提供有关证明文件。召集人应当在发出召开集合计划份额持有人大会的通知的当日，将公告送交基金管理人、托管人、基金销售机构以及其他有关机构。

七、基金管理人应当配合召集人召集集合计划份额持有人大会的工作，提供召集时权益登记日的集合计划份额持有人名单等资料。

八、基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当按照中国证监会的有关规定，在权益登记日当天将集合计划份额持有人名单登记在册。

九、基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当按照中国证监会的有关规定，对召集人要求召开集合计划份额持有人大会的意图保密。

十、基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当按照中国证监会的有关规定，对集合计划份额持有人的信息保密。

十一、召集人在发出召开集合计划份额持有人大会的通知前，应当就拟召开集合计划份额持有人大会的议题进行充分协商，议题内容应当有助于集合计划份额持有人的合理决策。

十二、基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当在权益登记日当天将集合计划份额持有人名单提供给召集人。

十三、召集人在权益登记日当天将集合计划份额持有人名单提供给基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构的当日，基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当保证名单的完整性、准确性、时效性。

十四、基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当配合召集人召集集合计划份额持有人大会的工作，不得妨碍召集人召集集合计划份额持有人大会。

十五、基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当按照中国证监会的有关规定，对召集人要求召开集合计划份额持有人大会的意图保密。

十六、基金管理人、托管人、基金销售机构或登记机构应当按照中国证监会的有关规定，对集合计划份额持有人的信息保密。

第十一部分 基金的投资

一、集合计划投资目标

本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中股票资产和债券资产的配置比例。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险收益特征进行预测。根据上述宏观层面指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标风险条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产配置。

2、股票投资策略

(1)股票组合的构建

本基金主要从以下几个方面对上市公司进行评估：公司的商业模式及所处行业的竞争格局、公司在行业内的核心竞争力、公司的成长潜力及持续性、公司的组织架构及治理、公司财务状况和经营状况。

(2)港股通标的股票投资策略

本基金将关注在港股市场上市、具有行业代表性、A股市场稀缺性和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

(3)风险控制策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，通过定性分析和定量分析相结合的方式，对存托凭证的发行企业和所属行业进行深入研究判断，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，精选出具备投资价值的存托凭证进行投资。

3、债券投资策略

本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率走动走势，且上市未满一年的新股预计会入围，结合信用分析等工具下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券品种。

信用债投资策略方面，由于影响信用债券利差水平的因素包括市场利率水平和信用债自身的风险特征两方面变化，因此本基金的信用债投资策略可以从外部市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

本基金通过综合分析国内外宏观经济走势、利率走势、收益率曲线变化趋势等因素，并结合各种固定收益类产品特定经济形势下的估值水平、预期收益和风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的期限结构和类属配置，并在此基础上实施债券投资组合管理，以获取较高的收益。

4、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性。本基金主要定价分析、债券条款分析、债券发行方的意图、投资导向的变化等方面综合评估可转换债券投资价值，选取具有较高价值的可转换债券进行投资。本基金将结合行业分析和个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，选择转债价值较高的个券进行投资。

本基金将综合分析可交换债券的基本情况、发行人资质、转股标的等因素，对可交换债券的风险收益特征进行评估，在风险可控的前提下，选取具有显著超额回报的优质标的进行投资。

同时，本基金还将密切跟踪可交换债券的信息变化情况和发行主体经营状况，合理控制可交换债券的投资风险。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资策略方面，将从利率、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，对资产支持证券的交易结构风险、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、按照利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

6、债券回购投资策略

作为本基金的日常投资管理，还将充分利用组合的债券回购操作，利用债券回购政策本能于债券收益率的机会，融入资金购买收益率较高的债券品种，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的债券回购投资。

7、衍生品投资策略

(1)股指期货投资策略

(2)国债期货投资策略

本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险控制的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性。本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割债券价格的偏离程度，结合国债期货合约期限结构、利率走势曲线所蕴含合约流动性情况提供确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理和套期保值的目标。

8、股指期权投资策略

(1)股票组合的构建

本基金主要从以下几个方面对上市公司进行评估：公司的商业模式及所处行业的竞争格局、公司在行业内的核心竞争力、公司的成长潜力及持续性、公司的组织架构及治理、公司财务状况和经营状况。

(2)港股通标的股票投资策略

本基金将关注在港股市场上市、具有行业代表性、A股市场稀缺性和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

(3)风险控制策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，通过定性分析和定量分析相结合的方式，对存托凭证的发行企业和所属行业进行深入研究判断，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，精选出具备投资价值的存托凭证进行投资。

3、债券投资策略

本基金密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率走动走势，且上市未满一年的新股预计会入围，结合信用分析等工具下而上的个券选择方法构建债券投资组合，配置能够提供稳定收益的债券品种。

信用债投资策略方面，由于影响信用债券利差水平的因素包括市场利率水平和信用债自身的风险特征两方面变化，因此本基金的信用债投资策略可以从外部市场整体信用利差曲线策略和单个信用债信用分析策略。

本基金通过综合分析国内外宏观经济走势、利率走势、收益率曲线变化趋势等因素，并结合各种固定收益类产品特定经济形势下的估值水平、预期收益和风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的期限结构和类属配置，并在此基础上实施债券投资组合管理，以获取较高的收益。

4、可转换债券和可交换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性。本基金主要定价分析、债券条款分析、债券发行方的意图、投资导向的变化等方面综合评估可转换债券投资价值，选取具有较高价值的可转换债券进行投资。本基金将结合行业分析和个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，选择转债价值较高的个券进行投资。

本基金将综合分析可交换债券的基本情况、发行人资质、转股标的等因素，对可交换债券的风险收益特征进行评估，在风险可控的前提下，选取具有显著超额回报的优质标的进行投资。

同时，本基金还将密切跟踪可交换债券的信息变化情况和发行主体经营状况，合理控制可交换债券的投资风险。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资策略方面，将从利率、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，对资产支持证券的交易结构风险、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、按照利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

6、债券回购投资策略

作为本基金的日常投资管理，还将充分利用组合的债券回购操作，利用债券回购政策本能于债券收益率的机会，融入资金购买收益率较高的债券品种，在严格头寸管理的基础上，在资金相对充裕的情况下进行风险可控的债券回购投资。

7、衍生品投资策略

(1)股指期货投资策略

(2)国债期货投资策略

本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险控制的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险、改善组合的风险收益特性。本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割债券价格的偏离程度，结合国债期货合约期限结构、利率走势曲线所蕴含合约流动性情况提供确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理和套期保值的目标。

第十五部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

1、集合计划费用的种类

4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；

5、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费和诉讼费和仲裁费；

7、集合计划的证券、期货交易费用；

9、集合计划的开户费用、账户维护费；

二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、集合计划的管理费

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.00%年费率计提，计算方法如下：

G=E×年管理费率÷当年天数

G为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日顺延至最近可支付日支付。费用自动计划后，基金管理人应计提核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.10%年费率计提。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日顺延至最近可支付日支付。费用自动计划后，基金管理人应计提核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、销售服务费

销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.4%。C类份额的销售服务费按前一日C类份额的集合计划资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H=E×销售服务费一当年天数

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日顺延。

4、上述一、集合计划费用的种类中第4—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，由托管人从集合计划财产中支付。

三、不列入集合计划的费用项目

1、基金合同生效前的相关费用，根据《光大阳光稳健增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定执行；

五、实施侧袋机制期间的集合计划费用

本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后列支，有关费用可酌情取取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

第十六部分 基金收益与分配

一、集合计划收益的种类

1、集合计划收益的种类

4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；

5、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费；

7、基金的证券、期货交易成结算费用；

9、账户开户费用、账户维护费；

二、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1.00%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

H=E×1.00%÷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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日顺延至最近可支付日支付。费用自动计划后，基金管理人应计提核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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0.10%年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日顺延至最近可支付日支付。费用自动计划后，基金管理人应计提核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、销售服务费

销售服务费用于可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等费用。本基金基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.40%。

本基金C类基金份额销售服务费计提的计算公式如下：

H=E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日顺延至最近可支付日支付。费用自动计划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类”中第4—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。

三、不列入基金费用的项目

1、基金合同生效前的相关费用，根据《光大阳光稳健增长混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定执行；

四、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情取取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

第十七部分 集合计划份额的折算

一、集合计划份额折算基准日

在资产管理合同生效日或管理人决定的其他日期，管理人可根据市场情况确定折算基准日。

二、集合计划份额折算对象

份额折算基准日登记在册的本集合计划份额。

三、份额折算频率

不定期。

四、集合计划份额折算方式

管理人对本集合计划份额的折算方式，具体见管理人届时发布的相关公告。

五、集合计划份额折算期间的集合计划业务办理

为保证集合计划份额折算期间本集合计划的平稳运作，管理人可暂停本集合计划份额的申购或赎回等相关业务，具体见管理人届时发布的相关公告。

六、份额折算的公告

管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告，并报中国证监会备案。

第十七部分 集合计划的会计与审计

一、集合计划会计政策

1、管理人为本集合计划的会计责任方；

二、集合计划的年度审计

3、管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报托管人。更换会计师事务所需在2日内在规定媒介公告，并报中国证监会备案。

第十八部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《资产管理合同》的变更

1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《资产管理合同》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。

四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组先从基金剩余财产中支付。

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托管人保存，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。

第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《资产管理合同》的变更

1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《资产管理合同》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。

四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组先从基金剩余财产中支付。

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托管人保存，保存期限不少于法律法规规定的最低期限。

第二十章部分 基金的信息披露

一、基金信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定。

二、公开披露的集合计划信息

（一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要

经中国证监会批准后，管理人将集合计划招募说明书提示性公告、《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在规定网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息

在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或者其他途径公开披露开放日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告，并报中国证监会备案。

（四）集合计划信息披露文件存放地点

在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或者其他途径公开披露开放日的各类集合计划份额申购、赎回的价格。

（五）公开披露的集合计划信息

（一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要

经中国证监会批准后，管理人将集合计划招募说明书提示性公告和《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在规定网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息

在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或者其他途径公开披露开放日的各类集合计划份额申购、赎回的价格。

（四）集合计划份额累计净值信息

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人授权后，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日顺延至最近可支付日支付。费用自动计划后，基金管理人应计提核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.10%年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基