(上接B25版)

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 名称：上海海通证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区广东路689号第32层01-12室单元 法定代表人：路颖 设立日期：2012年6月26日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]418号 组织形式：有限责任公司（非自然人投资或控股的法人独资） 注册资本：22亿元 存续期限：持续经营 联系电话：021-23219000 （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： （11）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、基金所产生的权利； （12）在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资； （15）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）办理基金备案手续； 二、托管人 （二）托管人的权利与义务 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： （16）按照法律法规和《资产管理合同》、托管协议的规定监督管理人的投资运作； （18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监督管理机构，并通知基金管理人；	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 名称：上海国泰海通证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山南路888号8层 法定代表人：陶耿 设立日期：2010年8月27日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会：证监许可[2010]631号 组织形式：有限责任公司 注册资本：20亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：021-38676999 （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： （11）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券、基金所产生的权利，在遵循基金份额持有人利益优先原则的前提下代表本基金就本基金所持有的基金份额行使相关基金份额持有人权利； （14）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、转托管和收益分配的业务规则； 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； 二、基金托管人 （二）基金托管人的权利与义务 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： （16）按照《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的投资运作；
第十部分 基金份额持有人大会	集合计划份额持有人大会由基金合同约定的代表权益合计份额持有人组成，集合计划份额持有人的合法授权代表有权代表集合计划份额持有人出席会议并表决。集合计划份额持有人持有的每一集合计划份额拥有平等的投票权。 本集合计划份额持有人大会未设立日常机构。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、中国证监会另有规定或本合同另有约定的除外： （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）； 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； （4）对《资产管理合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《资产管理合同》当事人权利义务关系发生变化； （6）调整本集合计划份额类别的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、转托管等业务的规则； 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、采取通讯开会方式开进行表决的情况下，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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。 3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金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 1、现场开会。由集合计划份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时管理人和托管人的授权代表应当列席集合计划份额持有人大会。管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行集合计划份额持有人大会议程： （1）亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者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票授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，并且持有集合计划份额的凭证与管理人持有的集合计划份额的凭证相一致； （2）经核对，到会者在权益登记日代表的有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金份额的二分之一，召集人可以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份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金份额的三分之一（含三分之一）。 2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日前以送达至召集人指定的地址。通讯开会以书面方式或大会公告载明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）召集人按基金份额持有人名册寄出的有效表决票数量不少于本集合计划在权益登记日基金份额的三分之一（含三分之一）。 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大会公告载明的其他方式在表决截止日前以送达至召集人指定的地址。通讯开会以书面方式或大会公告载明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）召集人按基金份额持有人名册寄出的有效表决票数量不少于本集合计划在权益登记日基金份额的三分之一（含三分之一）。 四、基金份额持有人大会的表决方式 1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程： （1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与管理人持有的基金份额的凭证相一致； （2）经核对，到会者在权益登记日代表的有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金份额的二分之一，召集人可以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）基金份额持有人大会表决权。 （3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金份额的三分之一（含三分之一）。 （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，同时提交的有关证明文件、受托出具书面意见的代理人出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。 3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。 五、议事内容与程序 2、议事程序 （3）现场开会 会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。 六、表决 基金份额持有人大会表决议分为一般决议和特别决议： 2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持有表权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规另有规定或《基金合同》另约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》，本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。 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，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。 七、计票 1、现场开会 （3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。 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。管理人或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。 九、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或监管规则的部分，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，基金管理人经与基金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，无需召开基金份额持有人大会审议。	第十二部分 基金合同的效力	1、《资产管理合同》经管理人、托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，并经管理人向中国证监会提交《海通月月升集合资产管理计划资产管理合同》变更为《海通鑫诚六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的申请经中国证监会批准后，自管理人公告的生效之日起生效，原《海通月月升集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 2、《资产管理合同》的有效期自其生效之日起至集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 4、《资产管理合同》正本一式四份，除上报有关监管机构一式二份外，管理人、托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。	1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，并经海通鑫诚六个月持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决通过后，自基金管理人公告的生效之日起生效，原《海通鑫诚六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 2、《基金合同》的有效期自基金合同生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 4、《基金合同》正本一式二份，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

上海海通证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的第一次提示性公告

上海海通证券资产管理有限公司(以下简称“管理人”)已于2025年9月15日在《证券时报》和管理人网站(www.htsamc.com)发布了《上海海通证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》。为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开，现发布《上海海通证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划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

根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2018年11月28日发布的《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》(证监会公告[2018]39号，以下简称“《操作指引》”)的规定，海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)经中国证监会《关于准予海通赢家系列-月月鑫集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函[2021]698号)准予，由海通赢家系列-月月鑫集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，变更后的《海通鑫选三个月持有期债券型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“资产管理合同”)于2021年12月20日生效。

本集合计划管理人为上海海通证券资产管理有限公司(以下简称“集合计划管理人”或“管理人”)，集合计划托管人为上海银行股份有限公司(以下简称“集合计划托管人”或“托管人”)。根据《操作指引》的规定及《资产管理合同》对本集合计划存续期限的约定“自《海通赢家系列-月月鑫集合资产管理计划资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限。本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至2025年12月31日。”本集合计划将于2025年12月31日到期。

鉴于以上情况，为充分保护集合计划份额持有人利益，根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《操作指引》等法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，管理人经与托管人上海银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本集合计划份额持有人大会，审议本集合计划更换管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，并相应变更为国泰海通鑫选三个月持有期债券型证券投资基金等有关事项，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2025年9月17日起至2025年10月14日17:00止(以本公告列明的表决票收件人收到表决票的时间为准或以集合计划管理人指定系统记录时间为准)。

3、会议计票日：表决截止日后2个工作日内

4、会议纸质表决票的寄达地点：

收件人：上海海通证券资产管理有限公司

地址：上海市黄浦区广东路689号第32层01-12室单元

邮政编码：200001

联系人：胡嘉炜

联系电话：95521

请在信封背面注明：“海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用”。

5、网络表决票的提交(仅适用于个人投资者)

网络投票形式的会议通讯表决票按本公告规定的网络投票方式进行。

6、短信表决票的提交(仅适用于个人投资者)

短信投票形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式回复至管理人指定的短信平台。

7、录音电话表决票的提交(仅适用于个人投资者)

录音电话投票形式的会议通讯表决票提交按本公告规定的录音电话投票方式进行。

8、投资人如有任何疑问，可致电管理人客户服务电话95521咨询。

二、会议审议事项

《关于海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通鑫选三个月持有期债券型证券投资基金有关事项的议案》(详见附件一)。

上述议案的说明详见《关于海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通鑫选三个月持有期债券型证券投资基金有关事项的说明》(详见附件四)。

三、集合计划份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2025年9月17日，即该日交易时间结束后，在本集合计划登记机构登记在册的本集合计划全体份额持有人均有权参加本次集合计划份额持有人大会并投票表决。

四、投票方式

(一)纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。集合计划份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录管理人网站(http://www.htsamc.com/)下载并打印表决票。

2、集合计划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，并提供本人有效身份证件(指本人在销售机构开户或参与本集合计划时使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新版本)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机构公章或经有效授权的业务公章(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)；

(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或其他能够表明其身份的有效证件或证明)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，并提供个人投资者有效身份证件(包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)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，还需提供代理人的有效身份证件(包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)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，还需提供代理人的有效身份证件(包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)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(详见附件三)。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件(包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)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)以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以管理人的认可为准。

3、集合计划份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的授权委托书等相关文件在2025年9月17日起，至2025年10月14日17:00止(以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准)通过专人送交、邮寄送达至本公告第一条第4项所述的寄达地址，并在信封背面注明：“海通鑫选三个月持有期债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用”。

(二)网络投票(仅适用于个人投资者)

为方便集合计划份额持有人(个人投资者)参与大会投票，自2025年9月17日起，至2025年10月14日17:00以前(以管理人系统记录时间为准)，集合计划份额持有人可登录管理人网站投票专区：(1)移动端：https://ehtam.htsec.com/holdVote；(2)PC端：https://ehtam.htsec.com/holdVote，通过前述投票专区进行网络投票。

通过网络方式进行投票的集合计划份额持有人，应按照管理人要求，准确填写姓名、证件号码等相关内容，并按系统要求操作，以核实集合计划份额持有人的身份，确保集合计划份额持有人权益。

集合计划份额持有人通过网络投票的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

(三)短信投票(仅适用于个人投资者)

为方便集合计划份额持有人参与本次大会，自2025年9月17日起，至2025年10月14日17:00以前(以管理人系统记录时间为准)，管理人提供短信通道供投资者进行投票。

管理人或部分销售机构可向预留手机号码的个人投资者发送征集投票的短信，集合计划份额持有人回复短信表决意见(内容需包含三部分内容：投资者身份证件号码、本集合计划指定代码L、投资者表决意见(同意/反对/弃权))；各部分内容无先后顺序要求，但需以空格、顿号或其他符号间隔；“同意/反对/弃权”中必须选择一种且只能选择一种表决意见。如集合计划份额持有人对议案表示同意，短信表决意见示例为：“123456198001011234、L、同意”；如集合计划份额持有人对议案表示反对，短信表决意见示例为：“123456198001011234、L、反对”；如集合计划份额持有人对议案表示弃权，短信表决意见示例为：“123456198001011234、L、弃权”。

集合计划份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。因电信运营商原因或通讯故障等不可抗力或非管理人人为因素，导致集合计划份额持有人无法获取短信进行投票或逾期接收到短信致使短信投票无效的，管理人不承担责任，请集合计划份额持有人采用管理人认可的其他投票方式进行投票。

集合计划份额持有人通过短信投票的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

(四)录音电话投票(仅适用于个人投资者)

为方便集合计划份额持有人参与本次大会，自2025年9月17日起，至2025年10月14日17:00以前(以管理人系统记录时间为准)，管理人或部分销售机构可通过各自的客户服务电话与集合计划份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实集合计划份额持有人身份后，集合计划份额持有人可在电话中对本次大会议案进行表决。

为保护集合计划份额持有人利益，上述整个通话过程将被录音。

集合计划份额持有人通过录音电话投票的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由管理人授权的两名监督员在托管人(上海银行股份有限公司)授权代表的监督下于2025年10月16日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如托管人经通知但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。

2、本集合计划份额持有人所持有的每份集合计划份额享有一票表决权。

3、纸质表决票效力的认定如下：

(1)表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，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，其所代表的集合计划份额计入参加本次大会的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。

(2)如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，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，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数；能够核实身份但未发表明确表决意见的，视为弃权表决票，计入有效表决票；无法核实身份的为无效表决票。

7、如果同一集合计划份额持有人存在包括有效纸质方式表决、有效短信投票(非纸质方式)、有效录音电话投票(非纸质方式)和有效网络投票(非纸质方式)表决的，如不同途径的有效表决意见相同，则视为同一表决票；如不同途径的有效表决意见不相同，则以最后送达的有效的表决票为准，若无法判断收到时间先后的，则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。

六、决议生效条件

(下转B27版)

第十四部分 基金份额持有人大会	二、投资范围 本集合计划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(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板、存托凭证及其他依法发行、上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、国债期货、信用衍生品、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(不包括QDII基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金(股票型ETF除外))等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)。 其中，对于基金投资，本基金可以投资全市场的股票型ETF(不含QDII、ETF及商品ETF)及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。其中，计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一： (1)基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产60%的混合型基金； (2)根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于60%的混合型基金。 基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%。本基金投资权益类资产、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券合计占基金资产的比例不超过20%(投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%)，本基金投资的权益类资产包括股票、存托凭证、股票型基金和计入权益类资产的混合型基金。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的10%。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，本基金持有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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，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。 如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。 三、投资策略 本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定其属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。 1、资产配置策略 本基金将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将基金资产在可投资的大类资产类别之间进行动态资产配置。 4、信用债投资策略 本基金将投资于信用等级不低于AA的信用债(含资产支持证券、不含可转换债券和可交换债券，下同)，其中投资于评级AA的信用债比例不超过本基金投资于信用债资产的20%；投资评级AA+的信用债比例不超过本基金投资于信用债资产的50%；投资评级AAA的信用债比例不低于本基金投资于信用债资产的50%。上述评级为债券券种的最新债项评级(不含外资控股的评级机构、不含中债资信)，无债项评级或者债项评级为A-1的以最新主体评级为准(不含外资控股的评级机构，不含中债资信)。基金持有信用债券期间，如果其信用评级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资评级或投资比例不再符合上述约定，应采取投资处置方式，基金管理人将在上述约定之日起3个月内调整至符合约定(流动性受限资产除外)。可转换债券和可交换债券不受上述信用评级要求限制。 5、可转债投资策略 在股票二级市场投资方面，本基金采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。在行业配置方面，除通过对包括产业政策、行业成长性、市场竞争、行业信息等方面进行深入研究以外，基金管理人将着重分析未来一段时间通胀水平的变化特征及其成因，选择受益于该运行特征或者受其负面影响最小的行业进行重点投资。在个股选择方面，基金管理人将精选满足以下特征的公司进行重点投资： 10、国债期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货的投资，充分发挥国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定适度参与国债期货投资。 11、基金投资策略 针对基金投资，本基金可以投资全市场的股票型ETF(不含QDII、ETF及商品ETF)及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。其中，计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一： 1)基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产60%的混合型基金； 2)根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于60%的混合型基金。 本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投资风格、投资业绩、管理团队稳定性因素进行二次研判，双重维度力求筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。 对于权益类基金，本基金基于权益类基金投资目标的不同，将标的基金分为主动和被动两大类。其中，针对主动管理类基金，本基金从基金风格、业绩表现、稳定性、规模变化等多角度进行分析，选取出预期能够获得良好业绩的基金；针对被动管理类基金，本基金从标的指数表现、跟踪误差、超额收益、规模变化等多角度进行分析，选取出表现稳定、跟踪误差较小、规模适中、有未来市场发展方向的基金。同时，本基金还将通过分析标的基金基金管理人的资产管理规模、投研文化、风险控制能力等因素，对标的基金的业绩稳定性、风险控制能力进行筛选。 本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的标的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。 12、信用衍生品投资策略 本基金将密切关注信用衍生品，若本基金投资于信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为主要目的，遵守证券交易所或银行间市场的相关规定。本基金将综合考虑债券的信用风险、信用衍生品的价格及流动性情况，信用衍生品创设机构的财务状况、偿付能力等因素，审慎开展信用衍生品投资，在规避它信用衍生品的投资风险、管理等，同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理。 未来，随着市场的发展和投资工具的丰富，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告，而无需召开基金份额持有人大会。	二、估值对象 基金所拥有的各类证券、基金份额、国债期货合约、资产支持证券、信用衍生品和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 四、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值(不含证券投资基金) (2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值； (3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值； (4)对于交易所上市交易的可转换债券，若为实行全价交易的债券，选取估值日收盘价作为估值全价进行估值；若为实行净价交易的债券，选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值； (5)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值； (6)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值； (7)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。 2、处于未上市期间的有价证券(不含证券投资基金)应区分如下情况处理： (2)首次公开发行未上市的股票、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，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。 3、对金融银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值基准服务机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。 4、对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响；回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。 6、本基金投资回业存单，按估值日第三方估值基准服务机构提供的估值全价估值。 8、本基金持有的国债期货合约，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。 11、对于未在交易所上市的证券投资基金的估值 本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。 12、对于在交易所上市的证券投资基金的估值 1)本基金投资的交易型开放式指数基金(ETF)，按所投资基金估值日的收盘价估值。 (2)本基金投资的境内上市开放式基金(LOF)，按所投资基金估值日的份额净值估值。 (3)本基金投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。 上述LOF基金及11日所述未在交易所上市的证券投资基金，份额净值由管理人以约定的方式发送托管人。管理人应确保净值的准确性，因所投资基金的份额净值不准确导致本基金估值错误的，相关责任由责任方承担。 13、对于证券投资基金特殊情况的估值处理 如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，基金管理人根据以下原则进行估值： (1)以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按托最近公布的基金份额净值为基础估值。 (2)以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值。 (3)若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人将根据基金份额净值或收盘价、单位分红金额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。 14、基金管理人可以委托中国证券投资基金业协会引入的估值基准服务机构提供估值服务，基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。对信用衍生品的估值方法如下： (1)对证券交易所或银行间市场上交易的凭证类信用衍生品，根据以下原则确定公允价值： 对于存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应当采用估值技术确定其公允价值。 (2)对证券交易所或银行间市场上未交易的合约类信用衍生品，且估值基准服务机构未提供估值价格的，采用估值技术确定其公允价值。 五、估值程序 1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，国家法律法规另有规定的，从其规定。 基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。 六、估值错误的处理 基金合同的当事人应按照以下约定处理：