（上接A53版）

17	第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。
18	第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式	（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产价值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 （3）暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。	（2）延缓支付赎回款项：基金管理人对符合法律法规及基金合同约定的赎回申请应全部予以接受和确认。但对于已接受的赎回申请，当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产价值造成较大波动时，基金管理人当日接比例分理的赎回份额不得低于基金总份额的20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限最长不超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。
18	第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式		新增： （3）在开放期内，当基金出现巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一估值日基金总份额40%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一估值日基金总份额40%的前提下，对其余赎回申请可以延期办理。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推。如延期办理期限超过开放期的，开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购，亦不接受新的赎回申请，但基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额40%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。	
18	第六部分 基金份额的申购与赎回 九、巨额赎回的情形及处理方式 3、巨额赎回的公告	当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。	当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项或延期赎回的情形时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。
18-19	第六部分 基金份额的申购与赎回 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告	2.如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日的基金份额净值。 3、如发生暂停的时间超过1日，基金管理人应最迟于重新开放日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个工作日的基金份额净值。	2.如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日各类基金份额的基金份额净值。 3、如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前一个工作日，在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。 4、如果发生暂停的时间超过两周，基金管理人最迟于重新开放日在指定媒介上刊登基重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的各类基金份额净值。
21	第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （一）基金管理人简况	住所：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室（人社深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：路强 注册资本：人民币2亿元	住所：深圳市前海深港合作区前湾一路51号A栋201室（人社深圳市前海商务秘书有限公司） 法定代表人：邹新 注册资本：人民币3亿元
22	第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （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： （14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构； （15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；	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： （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资； （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构； （16）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、转换和非交易过户等业务规则；
22	第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务	2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；	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： （1）依法办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的申购、赎回和登记事宜；
22-23	第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务	（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；	（8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
23	第七部分 基金合同当事人及权利义务 一、基金管理人 （二）基金管理人的权利与义务	（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；	删除
24	第七部分基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人 （一）基金托管人简况	法定代表人：宫少林 注册资本：人民币46.61亿元	法定代表人：霍达 注册资本：人民币66.99亿元
24	第七部分基金合同当事人及权利义务 二、基金托管人 （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、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；	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： （3）依法申请赎回其持有的基金份额；
26	第七部分基金合同当事人及权利义务 三、基金份额持有人	每份基金份额具有同等的合法权益。	同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。
27	第七部分基金合同当事人及权利义务 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： （4）缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；	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： （4）缴纳基金申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
28	第八部分 基金份额持有人大会	本基金份额持有人大会不设日常机构。	本基金份额持有人大会未设日常机构。
28	第八部分 基金份额持有人大会 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： （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外； （6）变更基金类别，但根据基金合同约定变更为跟踪同一标的指数的指数基金的除外； （8）变更基金投资目标、范围或策略，但根据基金合同约定变更为跟踪同一标的指数的指数基金的除外； （12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；	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： （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费的除外； （6）变更基金类别； （8）变更基金投资目标、范围或策略； （12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
28	第八部分 基金份额持有人大会 二、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；	2.以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （1）调低除基金管理费、基金托管费以外的其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用；	
29	第八部分 基金份额持有人大会 一、召开事由	（3）在法律法规和基金合同规定的范围内调低本基金的申购费率、调低赎回费率或在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式；	（3）在法律法规和基金合同规定的范围内调低本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费或变更收费方式、调整基金份额类别设置；
30	第八部分 基金份额持有人大会 三、召开基金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。 1.现场开会。…… （2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（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总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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总份额的三分之一（含三分之一）。 （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总份额的二分之一（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，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；	2.以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （1）调低基金管理费、基金托管费以外的其他应由本基金或基金份额持有人承担的费用； （4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；
31-32	第八部分 基金份额持有人大会 四、基金份额持有人出席会议的方式		
35	第八部分 基金份额持有人大会	九、本部分关于基金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，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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。	九、本部分关于基金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。
36-37	第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二、基金管理人和基金托管人的更换程序	2.决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过； 4.备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须报中国证监会备案； 6.交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；	2.决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，且表决通过之日起生效； 4.备案：基金份额持有人大会选任基金托管人的决议须经中国证监会备案； 6.交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人应当基金管理人核对基金资产总值；
37	第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （二）基金托管人的更换程序	7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。审计费用在基金财产中列支。	7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案；审计费用在基金财产中列支。
42	第十二部分 基金的投资 一、投资目标	一、投资目标 通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。	一、投资目标 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
42	第十二部分 基金的投资 二、投资范围	二、投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以目标ETF、标的指数的成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（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。 基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不少于基金资产净值的90%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。	二、投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，以目标ETF、标的指数的成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（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。 基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例为0%－100%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，股票资产占基金资产的比例为0%－95%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。在开放期和封闭期内，港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的60%。
42	第十二部分 基金的投资 三、标的指数	三、标的指数 中创100指数。 如果华闻元大中创100交易型开放式指数证券投资基金变更其标的指数，或者深圳证券交易所变更或停止中创指数的编制及发布，或者中创100指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致中创100指数不宜继续作为目标基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于本基金投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在取得基金托管人的同意并履行适当程序后，更换本基金的标的指数和投资对象，并依据目标ETF的标的指数、市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。	删除
42-46	第十二部分 基金的投资 三、投资策略	四、投资策略 本基金以华闻元大中创100交易型开放式指数证券投资基金作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF，本基金并不参与目标ETF的管理，主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。 1、资产配置策略 本基金主要通过投资于目标ETF以实现对业绩比较基准的良好跟踪。本基金投资于目标ETF的资产比例将不低于基金资产净值的90%，其余资产可投资于标的指数的成份股和备选成份股票、国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定），其目的是为了使本基金在保障日常申购赎回的前提下，更好的跟踪标的指数。在日额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，基金管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。 在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、目标ETF的投资策略 本基金投资目标ETF有如下两种方式： 1）申购和赎回：目标ETF开放申购赎回后，以股票组合进行申购赎回。 2）二级市场方式：目标ETF上市交易后，在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 当目标ETF申购、赎回或二级市场交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。 在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。 3、本基金可通过买入标的指数成分股来跟踪标的指数。为了更好地实现投资目标，基金还将投资于股指期货和其他经中国证监会允许的衍生工具，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。 本基金将采用货币市场工具对基金资产进行流动性管理。在满足安全性和保证流动性的基础上，本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以及国债期货投资。基金投资国债期货将本着谨慎的原则，充分考虑其流动性和风险收益特征，适度参与国债期货投资。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。 4、投资组合的调整 本基金将根据每个交易日申购赎回情况及本基金实际权益类资产仓位情况，来决定对目标ETF的操作方式和数量。 1）当收到净申购时，本基金将根据净申购规模及实际权益类资产仓位情况，确定是否需要买入成份股，并申购目标ETF的操作； 2）当收到净赎回时，本基金将根据净赎回规模及实际权益类资产仓位情况，确定是否需要对目标ETF进行赎回，并卖出赎回所得成份股； 3）在部分情况下，本基金将会根据目标ETF二级市场交易情况，适时选择对目标ETF进行二级市场交易操作。	三、投资策略 本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、投资标的评估以及组合风险管理全过程中。本基金为灵活配置基金，封闭期内，股票资产占基金资产的比例为0%－100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为0%－95%。一般来说，首先根据宏观经济和政策预判，定性大类资产的边际变动方向。其次，参考全部A股整体估值（剔除金融）过去20年的历史情况，将A股历史估值区间划分成若干分位。如果在25分位下方，股票仓位变动是60%－95%；如果估值在25－50分位，股票仓位变动是50%－95%；如果估值在50－75分位，股票仓位在40%－90%；如果估值在75－90分位，股票仓位变动是30%－90%；如果估值在90－100分位，股票仓位在0-60%。最后，根据短期上涨速度和获利水平，决定短期仓位变化。结合本基金封闭期和开放期的设置，采用不同的投资策略。 （一）封闭期投资策略 1、资产配置策略 本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。 （1）战略资产配置策略 在长期范围内，基金管理人将在对中长期大类资产收益预期的基础上获得战略资产配置的最优比例，并以此作为资产配置调整的可参照基准。主要考虑因素包括国内外宏观经济环境、财政及货币政策趋势、大类资产的历史回报、历史波动率、各类资产之间的相关性、行情驱动因素、类别风格轮动等，从其变动及趋势中得出未来资产回报、风险及相关性的可能变化。 （2）战术资产配置策略 在短期范围内，基金管理人将对组合进行战术资产配置，即在战略资产配置长期维持均衡的基础上积极主动地实现对大类资产配置的动态优化调整，重点考虑的因素包括：经济基本面及中短期波动、资本市场资金面和流动性、大类资产的估值变化以及市场情绪等。 2、股票投资策略 本基金将运用“价值和成长并重”的投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。 同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。 本基金将通过基本面分析，结合定量分析和定性分析，进一步筛选出运营状况健康、治理结构完善、经营管理稳健的上市公司股票进行投资。其中定量分析重点关注上市公司的资产质量、盈利能力、偿债能力、成本控制能力、未来增长性、权益回报率及相对价值等方面；定性分析重点关注上市公司的公司治理结构、团队管理能力、企业核心竞争力、行业地位、研发能力、公司历史业绩和经营策略等方面。 对于港股投资，本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注： （1）A股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A股缺乏投资标的行业（如博彩）； （2）具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头； （3）符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股； （4）与A股同类公司相比具有估值优势的公司。 3、债券投资策略 本基金将采用“自上而下”的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在配置框架下进行具有针对性的券种选择。具体而言，基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策以及市场趋势调整因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期和市场信用偏好预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略，力争有效控制整体资产风险，在确定组合整体框架后，基金管理人将对收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行进一步预测，相机而动，积极调整。 在债券投资组合构建和管理过程中，基金管理人将具体采用久期控制、期限结构配置、市场转换、相对价值判断、信用风险评估等管理手段。在债券投资策略制定与执行的过程中，基金管理人将持续对风险进行动态评估和管理，以确保系统性的控制持仓风险，并且在寻求风险结构优化的过程中不断提高组合的收益水平。 4、权证投资策略 本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债中购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，主动进行部分权证投资。 5、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。 6、国债期货投资策略 本基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目的。本基金在国债期货投资中根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，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。 7、资产支持证券投资策略 本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险。本基金本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置，同时注意流动性风险，严格控制资产支持证券的总量规模，对部分高质量的资产支持证券可以采用买入并持有到期策略，实现基金资产增值增厚。 8、可转换公司债投资策略 由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。可转债相对价值分析策略首先从可转债的债性和股性分析两方面入手。本基金所可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征。本基金用可转债的平价溢价率和可转债的Delta系数来衡量可转债的股性特征。 此外，在进行可转债筛选时，本基金还对可转债自身的基本面要素进行综合分析。这些基本面要素包括股性特征、债性特征、摊薄率、流动性等。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估。将可转债自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起，最终确定投资的品种。 （二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的流动性，在遵守基金有关投资限制与投资比例的前提下，主要配置高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
46	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（1）本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%； （2）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%； （3）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%；	（1）封闭期内，本基金股票投资占基金资产净值的比例为0%－100%；开放期内，股票资产占基金资产的比例为0%－95%；港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的60%； （2）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%； （3）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%；
46	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制		新增： （3）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），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（同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），不超过该证券的10%；
46	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（4）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%；	（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%；
46	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（5）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%；	（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%；
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（6）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%；	（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%；
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（7）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%；	（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%；
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（8）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%；	（11）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%；
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（9）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；	（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；
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（10）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；	（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；
47	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（11）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%；	（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%；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；
47-48	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（12）本基金若投资股指期货、国债期货的，则应当遵守下列限制： 1）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%；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交易日基金资产净值的20%；本基金所持有的股票和买入、卖出股指期货合约的市值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定； 2）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定； 3）在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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、资产支持证券等；	（15）本基金参与股指期货、国债期货交易，除中国证监会另有规定，应当遵守下列要求： 1）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%； 2）在封闭期内任何交易日日终，本基金持有的买入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100%；在开放期内任何交易日日终，本基金持有的买入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； 3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%； 4）在封闭期内，本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；在开放期内，本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不超过基金资产净值的95%； 5）本基金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交易日基金资产净值的20%； 6）基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%； 7）基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%； 8）基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；
48	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（13）本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；	删除
48	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（14）基金总资产不得超过基金净资产的140%；	（16）在封闭期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的200%；在开放期内，本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；
48-49	第十二部分 基金的投资 四、投资限制 1.组合限制	（15）本基金参与股票发行申购，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；	增加如下内容： （17）本基金管理人管理的全部开放式基金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%；本基金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%； （18）在开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%； 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （19）本基金与私