(上接B067版)

第九部分基金的份额配对转换	整章删除	无
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 法定代表人:王炯 注册资本:1亿元 存续期间:持续经营 （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: （1）依法募集基金; （5）召集基金份额持有人大会; （11）在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请; （16）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、转换和非交易过户的业务规则; （17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。 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）依法募集基金,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; （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净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格; （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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 办公地址:上海市浦东新区银城路117号端明大厦9F 法定代表人:邓晖 注册资本:1亿元人民币 存续期限:持续经营 （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: （1）依法募集基金; （5）按照规定召集基金份额持有人大会; （11）在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请; （16）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; （17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。 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）依法募集基金,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; （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净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格; （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存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 办公地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号 注册资本:5,123,350,416元 联系人:李玉彬 联系电话:(0755)22168677 （二）基金托管人的权利与义务 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,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。 （7）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。 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: （6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照本合同及托管协议的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜; （12）从基金管理人处接收并保存基金份额持有人名册; （15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会; （21）执行生效的基金份额持有人大会的决定;	二、基金托管人 （一）基金托管人简况 办公地址:广东省深圳市福田区益田路6023号 注册资本:19,405,918,198元 联系人:高希泉 联系电话:(0755) 2219 7701 （二）基金托管人的权利与义务 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、证券账户等投资所需账户,为基金办理证券交易资金清算; （7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。 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: （6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户,按照本基金合同及托管协议的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜; （12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册; （15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会; （21）执行生效的基金份额持有人大会的决议;
	三、基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受,基金投资者自依据基金合同取得的基金份额,即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。 东吴转债份额、可转债A份额及可转债B份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果可转债A份额与可转债B份额的运作出现终止,则在终止可转债A份额与可转债B份额的运作后,本基金每份基金份额具有同等的合法权益。 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于: （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会; （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁; （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。 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: （1）认真阅读并遵守《基金合同》; （2）了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险; （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用; （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定;	三、基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。 本基金每份基金份额具有同等的合法权益。 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于: （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会; （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁; （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。 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: （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件; （2）了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险; （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; （7）执行生效的基金份额持有人大会的决议;
	基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。 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,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外; （10）终止可转债A份额与可转债B份额的运作; （11）终止可转债A份额与可转债B份额上市交易,但因可转债A份额与可转债B份额不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外; （12）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会; （13）代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各基金份额总数10%以上（含10%,每一级份额均应占该级份额总数的10%以上,对每一级份额而言,包括单独或合计持有该级基金份额的10%以上,基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时,应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会; （14）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项; 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; （3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率; （6）根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定,本基金修改可转债A份额与可转债B份额的上市与交易规定; （7）在不变更本基金合同其他约定的条件下,经基金管理人与基金托管人协商,本基金可以在报中国证监会备案后变更东吴转债份额的收益分配方式	基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的召开事由、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,如为将来颁布的涉及基金份额持有人大会规定的法律法规不一致的,基金管理人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。
	二、会议召集人及召集方式 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集。 4、代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各该级基金份额总数10%以上（含10%,每一级份额均应占该级份额总数的10%以上,对每一级份额而言,包括单独或合计持有该级基金份额总数的10%以上,基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时,应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人。本合同以下相同表述与此具有相同含义）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金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基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额总数10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金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基金份额持有人代表和基金管理人。基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金托管人决定不召集,代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各该级基金份额总数10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金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基金份额持有人代表和基金管理人。基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。 5、代表东吴转债份额、可转债A份额与可转债B份额各该级基金份额总数10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额总数10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。	二、会议召集人及召集方式 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。 4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金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基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。 5、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额总数10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。
	四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。 1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理授票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金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,基金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: （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）。 参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的,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）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加,方可召开。 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至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。 （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50%（含50%）; （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,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理授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,并与基金登记注册机构记录相符; （5）会议通知公布前报中国证监会备案。	四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。 1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理授票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金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,基金管理人或基金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: （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）。 参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的,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）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加,方可召开。 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至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。 （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50%（含50%）; （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,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理授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,并与基金登记注册机构记录相符; （5）会议通知公布前报中国证监会备案。

第十二部分 基金的投资	一、投资目标 本基金为债券型指数证券投资基金,采用优化复制标的指数的方法,追踪成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪误差的最小化。 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、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证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。 本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括可转债（含分离交易可转债）、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。 本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股或增发新股的申购。因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证,须在达到可交易状态日起10个交易日内卖出。 本基金的投资组合比例为:投资于债券的比例不低于基金资产的80%,其中投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的80%;投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的20%;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,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。 四、投资策略 本基金为债券指数基金,对指数投资部分,采用最优复制法的投资策略,主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.5%以内,年跟踪误差控制在5%以内。如因指数编制规则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。 （一）资产配置策略 本基金将不低于基金资产净值的80%投资于债券资产,又将不低于非现金基金资产的80%投资于指数成份券及备选成份券。剩余资产将投资于流动性较好、收益较高的固定收益类产品,以保证投资组合能够在跟踪指数的基础上,具有较好的流动性。 （二）指数投资策略 对指数投资部分,采用优化复制法,主要以标的指数的成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。 （一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。	一、投资目标 本基金为债券型指数证券投资基金,采用优化复制标的指数的方法,进行被动指数化投资。本基金按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整,争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪误差的最小化。 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,包括标的指数的成份券及其备选成份券、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证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。 本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股或增发新股的申购。因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证,须在达到可交易状态日起10个交易日内卖出。 本基金的投资组合比例为:投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%;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;其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。 四、投资策略 本基金为债券指数基金,对指数投资部分,采用优化复制标的指数的投资策略,主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。如因指数编制规则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。 （一）资产配置策略 本基金将不低于基金资产净值的90%投资于指数成份券及备选成份券。剩余资产将投资于流动性较好、收益较高的固定收益类产品,以保证投资组合能够在跟踪指数的基础上,具有较好的流动性。 （二）指数投资策略 对指数投资部分,采用优化复制标的指数法,主要以标的指数的成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况,对投资组合进行优化调整,以保证对标的指数的有效跟踪。 （三）中小企业私募债券投资策略 中小企业私募债券由于该券种的发行主体资质相对较弱,且存在信息透明度较低等问题,因而面临更大的信用风险,属于高风险高收益品种,未来有可能出现债券到期后企业不能按时清偿债务的情况,从而导致基金资产的损失。 本基金将从发行主体所处行业的稳定性、未来成长性,以及企业经营、现金流状况、抵质押及担保增信措施等方面优选信用资质相对较强的高收益债进行投资。严格执行分散化投资策略,分散行业、发行人和区域集中度,以避免行业或区域性事件对组合造成的集体冲击。 （四）资产支持证券投资策略 本基金投资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以获得长期稳定收益。 五、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: （1）投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%; （3）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%; （4）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%; （5）本基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; （6）本基持有的同一（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%;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%;基金管理人管理的全部证券投资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%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的20%; （9）本基金持有的同一中期票据的比例,不得超过该中期票据规模的10%; （10）本基金投资于同一原始权益人的各类中期票据的比例,不得超过该基金资产净值的10%; （11）本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。 （13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的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; 除上述第（3）、（8）、（13）、（14）项之外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。 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上述约定。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。 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: （4）买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外; （7）法律、行政法规有关规定和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,应当符合本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。 法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准,不需要经基金份额持有人大会审议,但须提前公告。 五、业绩比较基准 本基金是债券型指数基金,投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%。同时,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。因此,中证可转换债券指数和银行税后活期存款利率分别赋予95%和5%的权重符合本基金的投资特性。 随着市场环境的变化,如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布,或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数,并同时变更本基金的基金名称与业绩比较基准。其中,若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案。并依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。 六、风险收益特征 本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。 从本基金的两类基金份额来看,可转债A份额为约定收益,将表现出预期低风险、预期收益相对稳定的机构,其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年; 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失,须承担相应的赔偿责任,但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外; 5、按基金合同及招募说明书规定为投资者办理申交易过户业务、提供其他必要的服务; 7、法律法规规定的其他义务。
	五、业绩比较基准 随着市场环境的变化,如果上述标的指数不适用本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,进行适当的程序变更本基金的标的指数,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。其中,若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案。并依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。 六、风险收益特征 本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。 七、本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。	五、业绩比较基准 本基金是债券型指数基金,投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%。同时,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。因此,中证可转换债券指数和银行税后活期存款利率分别赋予95%和5%的权重符合本基金的投资特性。 随着市场环境的变化,如果指数发布机构变更或停止该指数的编制及发布,或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数,并同时变更本基金的基金名称与业绩比较基准。其中,若标的指数变更涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等）,则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应在取得基金托管人同意后,报中国证监会备案,并依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。 六、风险收益特征 本基金是债券型指数基金,长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。 七、基金管理人代表基金行使权利的处理原则及方法 1、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理; 2、有利于基金资产的安全与增值; 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利,保护基金份额持有人的利益。

第十三部分 基金的财产	四、基金财产的保管和处分 本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、注册登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处分。	四、基金财产的保管和处分 本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处分。
第十四部分 基金资产的估值	三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 （1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等）,以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价（收盘价）估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,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。 （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。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理: （3）首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。	三、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 （1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等）,以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价（收盘价）估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,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。 （2）对在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外）,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值,具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定; （3）交易所上市交易的可转换债券,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; 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理: （3）在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。 5、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按相应利率逐日计提利息。 7、当本基金发生大额申购或赎回情形时,本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。
	四、估值程序 每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。	四、估值程序 基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。
	无	。 八、特殊情况的处理 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,或由于证券及登记结算公司等机构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。
第十五部分 基金费用与税收	一、基金费用的种类 4、基金上市费用; 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 6、《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、基金的证券交易或结算而产生的费用;	一、基金费用的种类 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 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; 7、基金的证券交易费用; 9、基金相关账户的开户及维护费用;
	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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下: H＝E×0.70%÷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,于次月前5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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法