万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告

万家基金管理有限公司于2015年4月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.wjasset.com）发布了“万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告”。并于4月20日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

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》和《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金（以下简称“万家城建基金”或“本基金”）的基金管理人万家基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）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2015年4月18日起，至2015年5月18日17:00 止（以本基金管理人收到表决票时间为准）。

3、会议通讯表决票的寄达地点：

基金管理人：万家基金管理有限公司

联系地址：上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼

联系人：马晓倩

联系电话：95538转6；4008880800；021-38909769

邮政编码：200122

二、会议审议事项

《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。（见附件1）。

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2015 年4月21日，即2015 年4月21日在本基金注册登记机构登记在册的万家城建基金的基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会。

四、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票详见附件2。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录本基金管理人网站（www.wjasset.com）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）个人持有人自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件复印件；

（2）机构持有人自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（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）个人持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供被代理的个人投资者身份证件复印件，以及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）。

（4）机构持有人委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供被代理的机构持有人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。如代理人为个人，还需提供代理人的身份证件复印件；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）。

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于会议投票表决起止时间内（以本基金管理人收到表决票时间为准）通过专人送交或邮寄的方式送达至本基金管理人的办公地址，并请在信封表面注明：“万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金份额持有人大会表决专用”。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（建设银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期第二天进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议。

2、基金份额持有人所持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参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选或表决意见空白，但其他各项符合会议通知规定的，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，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（3）如表决票上的表决意见多选、模糊不清或相互矛盾的，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。无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

（4）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，计入无效表决票；

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收到的时间为准。

六、决议生效条件

1、如提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额占本基金在权益登记日基金总份额的50%以上（含50%），则本次通讯开会视为有效；

2、本次议案如经提交有效表决票的基金份额持有人或其代理人所对应的基金份额的50%以上（含50%）多数同意，则视为表决通过，形成的大会决议有效；

3、基金份额持有人大会表决通过的事项，将由本基金管理人在自通过之日起5日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决定的事项自表决之日起生效。

七、本次大会相关机构

1、召集人（基金管理人）：万家基金管理有限公司

2、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

3、公证机构：上海市东方公证处

4、见证律师：北京大成（上海）律师事务所

八、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、《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》的修改稿及其他本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话95538转6或400-888-0800(免长途话费)咨询。

3、本通知的有关内容由万家基金管理有限公司负责解释。

万家基金管理有限公司

二〇一五年四月二十一日

附件：

一、《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》

二、《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

三、《授权委托书》

四、《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同修改说明》

附件1：

关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案

万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金份额持有人：

为提高基金资产的运作效率，保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《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人建设银行股份有限公司协商一致，提议将万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金变更为万家新利灵活配置混合型证券投资基金，并按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式等事项进行相应修改。主要修改内容如下：

1、拟修改本基金名称为“万家新利灵活配置混合型证券投资基金”；

2、拟修改本基金类别为“混合型证券投资基金”；

3、拟修改本基金投资范围为“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股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、货币市场工具、权证、股指期货、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。

股票投资占基金资产的0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。”

4、拟修改本基金投资策略，删除城市建设相关债券投资策略，增加资产支持证券、证券公司短期公司债券、股票、权证的投资策略。

5、拟修改本基金投资限制，删除投资于承担城市建设相关业务、承担地方交通建设投资经营以及其他国有资产经营开发的国有企业发行的各类固定收益产品的投资比例，增加证券公司短期公司债券、股票、权证相关投资限制条款。

6、拟修改本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率*50%＋中证全债指数收益率*50%”

7、拟在本基金基金估值部分增加股指期货的估值方法，完善未上市期间的有价证券估值方法，固定收益工具估值的方法按照《中国证券投资基金业协会估值核算估值小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》修改。

8、拟修改本基金收益与分配方式为“1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的90%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。”

根据以上修订对基金合同进行修改的详细内容，请参见附件4《关于万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金修改基金合同事宜的说明》。

上述议案，请予审议。

万家基金管理有限公司

二〇一五年四月十八日

附件2：

万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人名称：			
证件号码(身份证件号/营业执照号)	基金账号		
审议事项	同意	反对	弃权
(关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券基金基金合同有关事项的议案)			
基金份额持有人/代理人签名或盖章 年 月 日			

说明：请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。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持全部基金份额的表决意见。未选或表决意见空白(且其他各项符合会议公告规定)的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。多选、模糊不清、相互矛盾的表决意见或签字/盖章部分不完整、不清晰的，将视为无效表决。

附件3：

授权委托书

兹委托 先生/女士/公司代表本人（或本机构）参加投票截止日为2015年 月 日的以通讯方式召开的万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为全权行使对所有方案的表决权。

委托人签字/盖章：

委托人身份证号或营业执照注册号：

委托人基金账户号：

受托人签字/盖章：

受托人身份证号或营业执照注册号：

委托日期： 年 月 日

注：此授权委托书复印、或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均有效。

附件4：

关于万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同的修改说明

万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金（以下简称 “本基金”或“万家城建”）于2014年1月24日正式成立运作，托管于中国建设银行股份有限公司。根据市场环境的变化，为提高基金资产的运作效率，保护基金份额持有人利益，我公司根据《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《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议对《基金合同》相应条款进行修改，具体方案如下：

一、《基金合同》具体修改要点

(一)修改基金名称

原名称：万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金

拟修改为：万家新利灵活配置混合型证券投资基金

(二)修改《基金合同》第三部分基金的基本情况“（二）基金的类别”的内容

原有表述：债券型证券投资基金

拟修改为：混合型证券投资基金

修改说明：万家城建由纯债基金转型为灵活配置混合型基金

（三）修改《基金合同》第三部分基金的基本情况“（四）基金投资目标”的内容

原有表述：本基金以城市建设主题相关的债券作为主要投资对象，通过严格的信用风险控制和流动性管理，力争实现超越业绩比较基准的收益。

拟修改为：本基金重点关注经营状况良好、财务健康、具备成长性的上市公司，通过有效配置股票、债券投资比例，控制投资风险，谋取基金资产的长期稳定增值。

修改说明：根据基金类别的变化调整

(四)将《基金合同》第四部分“基金份额的发售”和第五部分“基金备案”替换为“基金的历史沿革和存续”

拟加入：

一、基金的历史沿革

万家新利灵活配置混合型证券投资基金由万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金转型而来。万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2013]1110号文注册募集，基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金自2013年12月26日至2014年1月21日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》于2014年1月24日生效。

2015年xx月xx日万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以xx方式召开，大会审议并通过《关于修改万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金变更名称、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、收益分配方式和修订基金合同等事项。自持有人大会决议生效之日起，《万家城市建设主题纯债债券型证券投资基金基金合同》失效且《万家新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

修改说明：因本基金属于转型，增加历史沿革和存续，删除基金份额的发售、备案等内容。

（五）修改《基金合同》第五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”的部分内容

原有表述：基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

拟修改为：基金管理人自基金合同生效之日起开始办理申购。

基金管理人自基金合同生效之日起办理赎回。

修改说明：本基金属于转型，自基金合同生效之日起办理申购、赎回。

（六）修改《基金合同》第五部分基金份额的申购与赎回“四、申购和赎回的程序”的部分内容

原有表述：2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购申请即为有效，申购成立。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，若申购不成立或无效，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资人赎回申请成功后，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基金合同有关条款处理。

拟修改为：2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；本基金登记机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，若申购不成立，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；本基金登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T＋7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述影响因素消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延迟支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

（七）修改《基金合同》第五部分基金份额的申购与赎回“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”的部分内容

原有表述：5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

拟修改为：5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期等于或长于30日、少于3个月的投资人收取的赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期等于或长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期等于或长于6个月的投资人，应当将赎回费总额的25%计入基金财产，赎回费的其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

修改说明：根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》中对于混合型基金的相关规定调整赎回费率。

（八）修改《基金合同》第六部分基金合同当事人及权利义务“一、（二）基金管理人的权利与义务”的部分内容

原第1款部分内容：

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）依法募集资金；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（17）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。

拟作如下修改：

删除：原序号“（1）依法募集资金”这一项。其他序号做相应调整，其中第（4）、（16）项文字修改为：

（4）召集基金份额持有人大会；

（16）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

原第2款部分内容：

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，办理基金份额的发售和登记事宜；

（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；

拟作如下修改：

原（1）项修改为：

（1）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；

删除上述序号（24）项内容。

修改说明：本基金属于转型，删除募集、募集完成备案、认购相关内容，并根据新基金法精神完善表述。

（九）修改《基金合同》第六部分基金合同当事人及权利义务“二、（二）基金管理人的权利与义务”的部分内容

原有表述：2、（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

拟修改为：2、（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为基金份额持有人以外的人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

修改说明：根据新基金法精神修订

（十）修改《基金合同》第七部分基金份额持有人大会的部分内容

原第一条第1款第（1）项：

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：

（1）终止《基金合同》

拟修改为：（1）终止《基金合同》（本基金合同另有约定的除外）

原第一条第2款第（3）项：

一、召开事由

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：

（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；

拟修改为：

（3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内，在不影响现有基金份额持有人利益的前提下调整本基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；

原第八条“生效与公告”中规定

基金份额持有人大会的决议自向中国证监会完成备案之日起生效。

拟修改为：基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

拟加入第九条：

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。

（十一）修改《基金合同》第八部分基金管理人、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”的“（一）基金管理人的更换程序“部分内容

原有表述：2、决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任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，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定资格条件；

4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会完成备案后2日内在指定媒体公告。

拟修改为：2、决议：基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后6个月内对被提名的新任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，自表决通过之日起生效；新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定资格条件；

4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会完成备案后2个工作日内在指定媒体公告。

拟修改为：2、决议：基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后6个月内对被提名的新任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，自表决通过之日起生效；新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定资格条件；

4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

修改说明：根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》完善。

（十三）修改《基金合同》第八部分基金管理人、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”的“（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序 ”部分内容

原有表述：3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议向中国证监会完成备案后2日内在指定媒体上联合公告。

拟修改为：3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上联合公告。

修改说明：根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》完善。

（十四）增加《基金合同》第八部分基金管理人、基金托管人的更换条件和程序部分内容

拟加入：

三、基金管理人、基金托管人更换条件和程序除应符合本部分的约定外，还应符合第七部分的约定。在基金管理人、基金托管人更换事宜中，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，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

修改说明：根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》完善。

（十五）修改《基金合同》第十一部分基金的投资“一、投资目标二、投资范围”的部分内容

原有表述：一、投资目标

本基金以城市建设主题相关的债券作为主要投资对象，通过严格的信用风险控制和流动性管理，力争实现超越业绩比较基准的收益。

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，包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、次级债、地方政府债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、可分离交易的可转换债券的纯债部分、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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）。

本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具；因所持可转换债券转股形成的股票、因投资于可分离交易的可转换债券而产生的权证，在其可上市交易后不超过50个交易日的时间内卖出。

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。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，其中对承担城市建设相关业务、承担地方交通建设投资经营以及其他国有资产经营开发的主体发行的各类固定收益产品的投资比例不低于非现金基金资产的80%。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%。

拟修改为：

一、投资目标

本基金重点关注经营状况良好、财务健康、具备成长性的上市公司，通过有效配置股票、债券投资比例，控制投资风险，谋取基金资产的长期稳定增值。

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股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、货币市场工具、权证、股指期货、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。

股票投资占基金资产的0%-95%。其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

修改说明：删除对承担城市建设相关业务、承担地方交通建设投资经营以及其他国有资产经营开发的主体发行的各类固定收益产品的投资比例，投资范围加入证券公司短期公司债券和股票、股指期货等权益类资产。

（十六）修改《基金合同》第十一部分基金的投资“三、投资策略”的部分内容

原有表述：

2）利率预期策略

利率变化是影响固定收益投资品价格的最重要的因素，当市场基准利率上升时，市场上所有的固定收益品种收益率都将会随之调整。利率预期策略是本基金的基本投资策略。本基金通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析，采用定性分析与定量分析相结合的方法，形成对未来利率走势的判断，并在此基础上对固定收益投资品组合的久期结构进行有效配置，以达到降低组合利率风险，获取较高投资收益的目的。

3）期限结构配置策略

利率期限结构表明了固定收益投资品的到期收益率与到期期限之间的关系。本基金通过数量化方法对利率进行建模，在各种情形、各种假设下对未来利率期限结构变动进行模拟分析，并在运作中模拟期限结构不同变动情形在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择适当的配置策略。

4）城市建设相关债券投资策略

在信息反映充分的债券市场中，信用利差的变化有规律可循且在一定时期内较为稳定。当债券收益率曲线上移时，信用利差通常会扩大，而在债券收益率曲线下移的过程中，信用利差会收窄；行业盈利增加、处于上升周期中，信用利差会缩小，行业盈利缩减、处于下降周期中，信用利差会扩大。提前预测并制定相应投资策略，就可能获得收益或者减少损失。

本基金将通过定性与定量相结合的方式，综合考虑监管环境、市场供求关系、行业分析，并运用财务数据统计模型和现金流分析模型等对整个市场的信用利差结构进行全面分析，在有效控制整个组合信用风险的基础上，采取积极的投资策略，发现价值被低估的信用类债券产品，挖掘投资机会，获取超额收益。

本基金的投资重点为城市建设相关的信用债券，此类信用债券与国债等其他无风险收益产品的风险溢价较同等评级债券不同。在过去五年中一直显示了较其他债券更高的风险溢价水平。对于风险溢价水平是否合理决定此类债券的可投资程度。

涉及城市建设相关的债券多数是由地方政府融资平台、公用事业建设单位等发行的债券。这类发行人由于资金需求大、周转时间长及经营杠杆较大，容易受到宏观经济调控的影响。

第一，作为发债主体股东的地方政府的持续征税能力、征税数量是重要的投资考虑。当地方政府对属地企业征税持续性出现问题，或政府征税数量有可能大幅度减少时，市场对债券的定价将会要求较高的风险补偿。

第二，作为未来项目产生的现金流为偿还的发债主体，例如：公路、铁路、水务、垃圾处理、污水处理等等，项目现金流的持续性是非常重要的衡量风险溢价因素。当未来的现金流来源有可能出现较大的波动时，对债券定价将会要求较高的风险补偿。

第三，房地产市场的景气程度是衡量地方政府融资平台的重要指标。

目前的融资平台类发行人多数涉及一级土地开发，土地出让金收入是重要的收益来源。当国家对房地产实行较为严厉的调控初期，土地出让金收益有可能骤然缩小，此时对涉及该类业务的发行人将要求更高的风险补偿。

第四，除以上三个方面以外，发行人本身的经营能力也是非常重要的衡量指标。对于部分已经公司化经营、经营能力突出的发行人来说，其经营稳定性所对应的融资能力和谈判价格能力较强，因此这类发行人所发行的债券风险补偿更低。

根据不同的经营情况，也会相应给出发行人不同的风险溢价。

5）债券品种选择策略

在上述债券投资策略的基础上，本基金对每个债券进行定价，充分评估其到期收益率、流动性溢价、信用风险补偿、税收、含权等因素，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金债券投资重点关注的对象：

(1)符合前述投资策略；

(2)短期内价值被低估的品种；

(3)具有套利空间的品种；

(4)符合风险管理指标；

(5)双边报价债券品种；

(6)市场流动性高的债券品种。

本基金围绕上述因素综合评估发行主体的信用风险，确定市场上该类债券的合理风险溢价水平，有效管理组合的整体信用风险。

6）信用债券投资的风险管理

本基金采取内部评级与外部评级相结合的办法，对所持债券面临的信用风险进行综合评估。在获取数据方面不仅限于经营数据，对于地方政府或其他种类发行人所处的区域经济做主要的评估，以地方政策、地方收入支出、城市化率、在国民经济中的重要性等一系列指标为基础做系统评估。

对进入研究库中的信用债券通过内部信用评级，运用定性和定量相结合、动态和静态相结合的方法，建立相应的债券的投资库，在具体操作上，采用指标定量打分制，对债券发行人进行综合打分评级，并动态跟踪债券发行人的状况，建立相应预警指标，及时对信用债券的投资库进行更新维护。

在投资操作中，结合适度分散的投资策略，适时调整投资组合，降低信用债券投资的信用风险。

7）中小企业私募债券投资策略

本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别注重中小企业私募债券的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例，保证本金相对安全和资产流动性，以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中，将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性；同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素，并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券进行深入研究，由债券研究员根据公司内部《信用债券库管理办法》对中小企业私募债券的信用风险和投资价值进行分析并给予内部信用评分和投资评级。本基金可投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券；对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券，禁止进行投资。

8）其他衍生工具的投资策略

未来市场推出信用风险缓释工具、国债期货等新的衍生产品，如法律法规或监管机构允许基金投资，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以套期保值或无风险套利为主要目的。将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。

拟修订为：

2、股票投资策略

本基金主要投资具有较高成长性且估值有吸引力的公司股票。本基金从定性和定量两个方面来把握投资对象的特征：

（1）定性方面

具有良好的公司治理结构，信息透明，注重公众股东利益和投资者关系；具有优秀、较为稳定的管理层，管理规范进取，能适应不断发展的公司规模；财务透明、清晰，资产质量及财务状况较好；在生产、技术、市场、政策环境等经营层面具有一方面或几方面竞争优势；有清晰的增长战略，并与其现有的竞争优势相契合。

（2）定量方面

已具备历史成长性，历史每股主营业务收入、EPS等财务指标已具有增长性；未来成长性持续，预期每股主营业务收入增长率和预期EPS增长率等指标高于行业平均水平；

为达精选之目的，本基金结合定量分析和定性分析，构建过滤模型来动态建立和维护核心股票库，从而精选出具有较高成长性且估值有吸引力的公司股票进行投资布局；同时将风险管理意识贯穿于股票投资过程中，对投资标的进行持续严格的跟踪和评估。

3、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

4、普通债券投资策略

在债券投资部分，本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上，对影响个别债券定价的主要因素，包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

5、中小企业私募债券投资策略

本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别注重中小企业私募债券的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例，保证本金相对安全和资产流动性，以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中，将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性；同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素，并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券进行深入研究，由债券研究员根据公司内部《信用债券库管理办法》对中小企业私募债券的信用风险和投资价值进行分析并给予内部信用评分和投资评级。本基金可投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券；对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券，禁止进行投资。

6、资产支持证券投资策略

本基金投资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，以期获得长期稳定收益。

7、证券公司短期公司债券投资策略

本基金在对证券公司短期公司债券特点和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其债券价值；采用多种定价模型以及研究人员对证券公司基本面等不同变量的研究确定其投资价值。投资综合实力较强的证券公司发行的短期公司债券，获取稳健的投资回报。

8、股指期货投资策略

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

修改说明：删除城市建设相关债券投资策略，增加资产支持证券、证券公司短期公司债券、股票、权证的投资策略。

（十七）修改《基金合同》第十一部分基金的投资“四、投资限制”的部分内容

原有表述为：1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，其中对承担城市建设相关业务、承担地方交通建设投资经营以及其他国有资产经营开发的国有企业发行的各类固定收益产品的投资比例不低于非现金基金资产的80%；

（2）本基金不直接买入股票、权证等权益类金融工具；因所持可转换债券转股形成的股票、因投资于可分离交易的可转换债券而产生的权证，在其可上市交易后不超过50个交易日的时间内卖出；

（3）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；

（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，不超过该证券的10%；

（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%；

（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%；

（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%；

（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