交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金调整大额申购（转换转入、定期定额投资）业务限额的公告

公告送出日期：2022年10月22日

1.公告基本信息

基金名称	交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金
基金简称	交银趋势混合
基金主代码	519702
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司
公告依据	《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金招募说明书》等
调整大额申购起始日	2022年10月24日
调整大额转换转入起始日	2022年10月24日
调整大额定期定额投资起始日	2022年10月24日
调整相关业务限额的起始日、金额及原因说明	限制大额申购金额（单位：元） 1,000
	限制大额转换转入金额（单位：元） 1,000
	限制大额定期定额投资金额（单位：元） 1,000
	调整大额申购（转换转入、定期定额投资）业务限额的原因说明 为保护现有基金份额持有人的利益，稳定基金规模，退出平稳运作
下属分级基金的基金简称	交银趋势混合A 交银趋势混合C
下属分级基金的交易代码	519702（前端）、519703（后端） 013430
该分级基金是否调整大额申购（转换转入、定期定额投资）业务限额	是 是

注：除了对单笔金额在人民币1000元以上（不含1000元）的申购及转换入申请（含定期定额投资业务发起的申购申请）进行限制外，对于当日单个基金账户累计申购及转换入金额在人民币1000元以上（不含1000元）的申购及转换入申请（含定期定额投资业务发起的申购申请，本基金A类、C类基金份额申请金额并予以合计），本基金管理人也有权拒绝，不予确认。

2.其他需要提示的事项

（1）在本基金上述暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务期间，本基金的赎回（转换转出）业务正常进行。

（2）关于取消上述暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）业务限制的时间，本基金管理人将另行公告。

（3）投资者可以登录本公司网站（www.fund001.com）或拨打客户服务电话（400-700-5000，021-61055000）咨询基金相关信息。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

交银施罗德基金管理有限公司已于2022年10月21日在《中国证券报》及交银施罗德基金管理有限公司网站（www.fund001.com）发布了《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。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一次提示性公告。

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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）和《交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金（以下简称“基金”，基金代码：005001）的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“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审议本基金调整投资范围及修改基金合同等相关事宜，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2022年10月24日起至2022年11月21日17:00止（以基金管理人收到表决票的时间或移动网络投票系统记载的表决时间为准）

3.会议纸质表决票的寄送地点：

收件人：交银施罗德基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期22楼

邮政编码：200120

联系人：郝婷婷

联系电话：021-61055050

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明系用于本基金基金份额持有人大会表决之用（如“交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告”）。

4.具体的授权效力确定规则请参见《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》正文。

5.如本次持有人大会权益登记日，投资者未在本基金登记机构登记在册，则其授权无效。

6.若本基金二次召开基金份额持有人大会，除非授权文件另有载明，基金份额持有人在第一次召集的持有人大会授权期间内就基金份额持有人大会，除非授权文件另有载明，基金份额持有人在第一次召集的持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知（如有）。

7.授权委托书可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载（www.fund001.com）并打印等方式获取，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

关于交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项议案的说明

一、重要提示

交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2018年1月12日成立并正式运作。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券基金证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金调整投资范围及修改基金合同事宜。

本次交银施罗德特续成长主题混合型证券投资基金调整投资范围及修改基金合同有关事项的议案须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。中国证监会对本次许可人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不代表对本基金的价值或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、基金合同修改要点

（一）增加基金合同启动终止条款

对《基金合同》原“第五部分基金备案”进行调整，增加基金合同启动终止条款，调整后的内容如下：

“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续50个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。”

（二）修改投资范围

将“港股通标的股票”纳入本基金的投资范围，并删除权证和小板、变更后的投资范围如下：

“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（含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、回业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、股指期货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。

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的80%-95%；本基金投资于持续成长主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日持有扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于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。

如果法律法规或中国证监会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）修改投资策略

删除权证投资策略。

增加港股通标的股票投资策略，调整后的投资策略如下：

“2.股票投资

……

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

本基金可根据投资策略需要或不可抗力因素等因素调整上述投资品种的投资比例，调整后的投资品种的投资比例应符合届时有效的法律法规或监管机构的规定。”

（四）修改投资限制

删除权证投资限制。

修改投资限制如下：

“（四）投资限制

1.组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票资产（含存托凭证）占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的30%-50%；本基金投资于持续成长主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；

（2）每个交易日持有扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金进行股指期货投资，单个交易日内买入股指期货合约的交易保证金不得超过基金资产净值的3%，在任何交易日内持有的股指期货合约的合计市值不得超过基金资产净值的100%，其中，买入股指期货合约的交易保证金一般应在基金资产净值的5%-10%之间，但因申购赎回等原因导致基金规模变动等情形除外。

2.股票投资

……

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港股票市场。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

本基金可根据投资策略需要或不可抗力因素等因素调整上述投资品种的投资比例，调整后的投资品种的投资比例应符合届时有效的法律法规或监管机构的规定。”

（五）修改投资组合比例

“（1）股票资产（含存托凭证）占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的30%-50%；本基金投资于持续成长主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日持有扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。”

（六）修改业绩比较基准

“70%×沪深300指数收益率+10%×恒生指数收益率+20%×中证综合债券指数收益率

沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数，由中证指数有限公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成，该指数样本对沪深市场的覆盖率高，具有较好的代表性，投资者可以方便地跟踪、比较沪深300指数进行投资。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，该指数是市场上最早、最具代表性的综合性股票指数之一，是香港股市中最具影响力的指数之一。恒生指数是以市值加权方式编制的股票价格指数，成分股数目一般为50个左右，成分股涵盖了香港股市的主要行业，能够较全面地反映香港股市的整体价格变动趋势，具有较强的市场代表性。

根据本基金的投资目标及投资理念，选择沪深300指数作为业绩比较基准。

本基金可根据投资策略需要或不可抗力因素等因素调整上述业绩比较基准，调整后的业绩比较基准将在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。”

（七）修改估值方法

“（1）对于在活跃市场上的股票、债券、权证、资产支持证券、股指期货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），基金管理人应当采用市场法对其进行估值。

（2）对于在活跃市场上的股票、债券、权证、资产支持证券、股指期货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），基金管理人应当采用成本法对其进行估值。

（3）对于不在活跃市场上的股票、债券、权证、资产支持证券、股指期货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），如有证据表明其估值成本不能反映其公允价值的，应对其进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响，特征是指对资产可出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（3）对于存在活跃市场的投资品种，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公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不可观察输入值的情况，尽可能使用可观察输入值。

（4）对于采用活跃市场报价或估值技术确定公允价值的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）本基金管理人应建立内部估值委员会，负责公允价值的确定工作。

（6）对于在活跃市场上的股票、债券、权证、资产支持证券、股指期货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），基金管理人应当采用市场法对其进行估值，估值日无报价的最近交易日后经济环境发生了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，可参考类似投资品种的估值方法进行估值；

（7）对于采用成本法估值的投资品种，基金管理人应当定期对其进行减值测试，当其成本高于可收回金额时，应将其成本减记至可收回金额，减记的金额计入当期损益，对于已计提减值准备的投资品种，在减值因素消失的情况下，应采用估值技术确定公允价值，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（8）基金管理人应建立内部估值委员会，负责公允价值的确定工作。

（9）若基金实施侧袋机制，则相关基金份额持有人大会召集和表决权的比例在主要份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权存在实质性差异情况下，但若相关基金份额持有人大会召集和表决权的比例在主要份额持有人和侧袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权存在该等比例，则仅相关基金份额持有人大会召集和表决权存在该等比例。

1.基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；

2.即日开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3.通讯开会的表决出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4.在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额合计不在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5.现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人或代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6.一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7.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表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧侧账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

二、基金管理人和基金托管人的更换程序

（一）基金管理人的更换程序

7.审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请合代（中华人民共和国证券法）规定的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。审计费用由基金财产中列支；

（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合代（中华人民共和国证券法）规定的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。审计费用由基金财产中列支。

二、投资范围

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（含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、回业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、股指期货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）。

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的30%-50%；本基金投资于持续成长主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日持有扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

三、投资策略

1.资产配置

本基金利用经交银施罗德研究团队修正后的投资时钟分析框架，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合形成对不同资产市场长期回报的预期判断，确定基金资产在护盾A股、港股、债券及货币市场工具等各类资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，在基金合同约定的范围内动态调整组合中各类资产的比例，以期通过资产配置实现风险控制和收益提升。

2.股票投资

本基金可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。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

本基金可根据投资策略需要或不可抗力因素等因素调整上述投资品种的投资比例，调整后的投资品种的投资比例应符合届时有效的法律法规或监管机构的规定。

3.债券投资

在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变动、不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期管理策略、类属配置策略、收益率曲线配置策略、杠杆放大策略及信用债券、可转换债券投资等多种策略，以期获取债券市场的长期稳定收益。

（6）可转换债券与可交换公司债券投资策略

本基金对于可转换债券与可交换公司债券投资性的研究将完全依托于公司投研团队对股票的研究，在此基础上利用可转换债券定价模型，充分考虑转债发行条款、剩余期限、股票波动率、信用风险、流动性风险等因素的影响，对目标转债的投资性进行合理定价。通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求寻找说明转债投资价值的品种，构建本基金可转换债券的投资组合。

4.权证投资

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的风险特性、流动性及风险传特征，通过资产配置、品种与类属选择、退求基金资产稳定的当期收益。

九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例在主要份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权存在该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和表决权的比例在主要份额持有人和侧袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权存在该等比例：

1.基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）；

2.即日开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3.通讯开会的表决出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4.在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额合计不在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5.现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人或代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6.一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7.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表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧侧账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

二、基金管理人和基金托管人的更换程序

（一）基金管理人的更换程序

7.审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请合代（中华人民共和国证券法）规定的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。审计费用由基金财产中列支；

（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合代（中华人民共和国证券法）规定的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。审计费用由基金财产中列支。

二、投资范围

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（含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、回业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、股指期货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）。

基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的30%-50%；本基金投资于持续成长主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日持有扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

三、投资策略

1.资产配置

本基金利用经交银施罗德研究团队修正后的投资时钟分析框架，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合形成对不同资产市场长期回报的预期判断，确定基金资产在护盾A股、港股、债券及货币市场工具等各类资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，在基金合同约定的范围内动态调整组合中各类资产的比例，以期通过资产配置实现风险控制和收益提升。

2.股票投资

本基金可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。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。

本基金可根据投资策略需要或不可抗力因素市场环境变化等因素调整上述投资品种的投资比例，调整后的投资品种的投资比例应符合届时有效的法律法规或监管机构的规定。

3.债券投资

在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变动、不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期管理策略、类属配置策略、收益率曲线配置策略、杠杆放大策略及信用债券、可转换债券投资等多种策略，以期获取债券市场的长期稳定收益。

（6）可转换债券与可交换公司债券投资策略

本基金对于可转换债券与可交换公司债券投资性的研究将完全依托于公司投研团队对股票的研究，在此基础上利用可转换债券定价模型，充分考虑转债发行条款、剩余期限、股票波动率、信用风险、流动性风险等因素的影响，对目标转债的投资性进行合理定价。通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求寻找说明转债投资价值的品种，构建本基金可转换债券的投资组合。

4.权证投资

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的风险特性、流动性及风险传特征，通过资产配置、品种与类属选择、退求基金资产稳定的当期收益。

第八部分 基金份额持有人大会	九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例在主要份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权存在该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和表决权的比例在主要份额持有人和侧袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权存在该等比例： 1.基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上（含10%）； 2.即日开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）； 3.通讯开会的表决出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）； 4.在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额合计不在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票； 5.现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人或代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人； 6.一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过； 7.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表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。 同一主侧侧账户内的每份基金份额具有平等的表决权。
第九部分 基金管理人或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 （一）基金管理人的更换程序 7.审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请合代（中华人民共和国证券法）规定的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。审计费用由基金财产中列支； （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合代（中华人民共和国证券法）规定的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。审计费用由基金财产中列支。
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 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（含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回购、回业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、资产支持证券、股指期货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）。 基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的30%-50%；本基金投资于持续成长主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日持有扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。 三、投资策略 1.资产配置 本基金利用经交银施罗德研究团队修正后的投资时钟分析框架，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合形成对不同资产市场长期回报的预期判断，确定基金资产在护盾A股、港股、债券及货币市场工具等各类资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，在基金合同约定的范围内动态调整组合中各类资产的比例，以期通过资产配置实现风险控制和收益提升。 2.股票投资 本基金可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。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股纳入本基金的股票投资组合。 本基金可根据投资策略需要或不可抗力因素市场环境变化等因素调整上述投资品种的投资比例，调整后的投资品种的投资比例应符合届时有效的法律法规或监管机构的规定。 3.债券投资 在全球经济的框架下，本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化作出判断，运用数量化工具，对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变动、不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期管理策略、类属配置策略、收益率曲线配置策略、杠杆放大策略及信用债券、可转换债券投资等多种策略，以期获取债券市场的长期稳定收益。 （6）可转换债券与可交换公司债券投资策略 本基金对于可转换债券与可交换公司债券投资性的研究将完全依托于公司投研团队对股票的研究，在此基础上利用可转换债券定价模型，充分考虑转债发行条款、剩余期限、股票波动率、信用风险、流动性风险等因素的影响，对目标转债的投资性进行合理定价。通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求寻找说明转债投资价值的品种，构建本基金可转换债券的投资组合。 4.权证投资 本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的风险特性、流动性及风险传特征，通过资产配置、品种与类属选择、退求基金资产稳定的当期收益。
第十四部分 基金资产估值	五、估值程序 1、各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。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，具体可参见相关公告。国家另有规定的，从其规定。 基金管理人于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。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。 2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同的约定和相关法律法规的规定对外公布。
第十四部分 基金收益分配	七、暂停估值的情形 3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金应当暂停估值； 4、法律法规或中国证监会规定的和基金合同约定的其它情形。
第十四部分 基金费用	八、基金净值的确认 各类基金份额的基金资产净值和基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。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，具体可参见相关公告。国家另有规定的，从其规定。 基金管理人于每个工作日计算各类基金份额的基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。 2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同的约定和相关法律法规的规定对外公布。
第十四部分 基金信息披露	九、暂停估值的情形 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金应当暂停估值； 4.法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。
第十四部分 基金费用	十、基金净值的确认 各类基金份额的基金资产净值和基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。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，具体可参见相关公告。国家另有规定的，从其规定。 基金管理人于每个工作日计算各类基金份额的基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。 2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基托行，经基托行复核无误后，由基金管理人依据基金合同的约定和相关法律法规的规定对外公布。
第十四部分 基金份额申购、赎回	十一、申购和赎回场所 本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增加销售机构，并在管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金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的申购与赎回。
第十四部分 基金份额申购、赎回	十二、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基金份额的申购和赎回，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，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回除外。 2.申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3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3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。
第十四部分 基金份额申购、赎回	十四、申购与赎回的程序 1.申购和赎回申请的确认 基金管理人可在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告并报中国证监会备案。
第十四部分 基金份额申购、赎回	十五、申购和赎回的数量限制 5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额和最低基金份额保留金额的数量限制。基金管理人必须在调整实施日前在规定媒介上公告并报中国证监会备案。
第十四部分 基金份额申购、赎回	十六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1.本基金份额净值的计算，均精确到小数点后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财产承担。T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日内披露。（包括该日1内公告，遇特殊情况，经中国证监会同意，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：本基金申购份额的计算及金额的处理方式详见《招募说明书》。本基金在申购费率未调低的情况下，若因基金管理人决定，并在招募说明书中列示，申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。 3.赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算及处理方式详见《招募说明书》。赎回费用及赎回份额净值的计算均保留到小数点后2位，赎回费用由赎回人承担，赎回人赎回份额时，赎回金额为赎回份额乘以赎回当日的份额净值。
第十四部分 基金份额申购、赎回	十七、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基金份额的申购和赎回，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，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回除外。 2.申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3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3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。
第十四部分 基金份额申购、赎回	十八、申购和赎回的价格、费用及其用途 1.本基金份额净值的计算，均精确到小数点后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财产承担。T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日内披露。（包括该日1内公告，遇特殊情况，经中国证监会同意，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：本基金申购份额的计算及金额的处理方式详见《招募说明书》。本基金在申购费率未调低的情况下，若因基金管理人决定，并在招募