（上接D41版）

第四部分 基金的基本情况	三、集合计划的运作方式 本集合计划封闭期为3个月，具体指自每一开放期结束之日次日起（含该日）至3个月对日前一日（含该日）的期间，如果该对日无对应日期或为非工作日的，则封闭期顺延至下一个工作日的前一日。 首个开放期结束之日次日起（含该日）进入首个封闭期，首个封闭期为首个开放期结束之日次日起（含该日）至3个月对日前一日（含该日）的期间。首个封闭期结束之后第一个工作日起（含该日）进入第二个开放期，第二个封闭期为第二个开放期结束之日次日起（含该日）至3个月对日前一日（含该日）的期间，以此类推。本集合计划在封闭期内采取封闭运作模式，期间不办理申购与赎回等业务，也不上市交易。 如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使本集合计划无法按时开放申购与赎回等业务，或依据本合同需暂停申购或赎回等业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求，具体时间以管理人届时公告为准。 五、集合计划份额的面值 本集合计划份额的面值为人民币1.00元。 六、集合计划存续期限 自《东海证券稳健增值集合资产管理计划合同》生效至本合同终止之间的期限。中国证监会另有规定的，按规定执行。 七、集合计划份额类别设置 管理人可在不损害集合计划份额持有人利益的情况下，经与托管人协商，增加或调整集合计划份额类别，或对集合计划份额分类办法及规则进行调整，或者在法律法规和集合计划合同规定的范围内变更现有集合计划份额类别的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式等，调整实施前管理人依照《信息披露办法》的规定公告。	三、基金的运作方式 本基金封闭期为3个月，具体指自每一开放期结束之日次日起（含该日）至3个月月度对日前一日（含该日）止的期间。 首个开放期结束之日次日起（含该日）进入首个封闭期，首个封闭期为首个开放期结束之日次日起（含该日）至3个月月度对日前一日（含该日）止的期间。首个封闭期结束之后第一个工作日起（含该日）进入第二个开放期，第二个封闭期为第二个开放期结束之日次日起（含该日）至3个月月度对日前一日（含该日）止的期间，以此类推。本基金在封闭期内采取封闭运作模式，期间不办理申购与赎回等业务，也不上市交易。 如在封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使本基金无法按时开放申购与赎回等业务，或依据本基金合同需暂停申购或赎回等业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求，具体时间以基金管理人届时公告为准。 五、基金份额的面值 本基金基金份额的面值为人民币1.00元。 六、基金存续期限 不定期 七、基金份额类别设置 本基金根据申购、赎回规则，申购费用，销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。 A类基金份额：指本基金《基金合同》生效后，投资者申购时收取申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。 C类基金份额：指本基金《基金合同》生效后，投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。 D类基金份额：指对于投资者依据原《东海证券稳健增值集合资产管理计划合同》获得的东海证券稳健增值集合资产管理计划份额，自《东海资管海鑫增利3个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为东海资管海鑫增利3个月定期开放债券型集合资产管理计划的集合计划份额，以及依据《东海资管海鑫增利3个月定期开放债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海资管海鑫增利3个月定期开放债券型集合资产管理计划集合计划份额（以下统称“原东海资管海鑫增利3个月定期开放债券型集合资产管理计划份额”），自本基金《基金合同》生效之日起均将全部自动转换为本基金D类基金份额。D类基金份额只开放赎回，不开放申购，红利再投资份额除外。 本基金A类基金份额、C类基金份额和D类基金份额分别设置代码，并分别计算及公告基金份额净值和基金份额累计净值。 各类基金份额净值的计算公式为： T日某类基金份额净值＝T日该类基金份额的基金资产净值/T日该类基金份额余额总数。 投资者仅可在开放期内办理A类基金份额、C类基金份额的申购业务。 本基金不同基金份额类别之间暂不开通相互转换业务。如后续开通此项业务的，无需召开基金份额持有人大会审议，但调整前基金管理人需及时公告。 有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由管理人确定，并在招募说明书、基金产品资料概要中公告。 根据基金实际运作情况，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后可增加、减少或调整基金份额类别设置、停止现有基金份额类别的销售、对基金份额分类办法及规则进行调整，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，无需召开基金份额持有人大会。 八、发起资金的申购金额下限、持有期限下限 本基金为发起式基金，发起资金提供方申购本基金的金额不少于1000万元（不含申购费用）。 发起资金申购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于3年。申购份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内发生职务调整或离职的，其持有期限的承诺不受影响。 法律法规或监管机构另有规定的除外。
第五部分 基金的存续	集合计划合同生效后，连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，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，管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合资产管理计划合并或者终止集合计划合同等，并在6个月内召集集合计划份额持有人大会。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。	《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同按其约定程序进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。 《基金合同》生效满三年后继续存续的，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人民币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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。
第六部分 基金份额的申购与赎回	一、申购和赎回场所 本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由管理人在招募说明书或管理人公司网站列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的申购与赎回。 二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 本集合计划办理集合计划份额申购和赎回的开放日为开放期内的每个工作日，具体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，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。在封闭期内，本集合计划不办理申购、赎回等业务，也不上市交易。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 本集合计划每3个月开放一次，每次开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。投资者可在开放期内办理申购、赎回等业务。开放期的具体期间由管理人在每一开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使本集合计划无法按时开放申购与赎回等业务，或依据本合同需暂停申购或赎回等业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求，具体时间以管理人届时公告为准。 在确定申购开始与赎回开始时间后，管理人应在开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。 管理人不得在开放期之外的日期办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。本集合计划开放期内，投资人在交易时间之外的时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其集合计划份额申购、赎回价格为下一开放日集合计划份额申购、赎回的价格。在开放期最后一个工作日交易时间结束之后提出有关申请的，管理人将不予受理。 三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算； 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回； 四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放期内开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认集合计划份额时，申购生效。 集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券/期货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他非管理人及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情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本合同有关条款处理。 3、申购和赎回申请的确认 管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。 五、申购和赎回的数量限制 6、当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或集合计划单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停集合计划申购等措施，切实保护存量集合计划份额持有人的合法权益。管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对集合计划规模予以控制。具体见管理人相关公告。 7、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和赎回份额等数量限制。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本集合计划份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T日的集合计划份额净值在当天收市后计算，并按约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本集合计划申购份额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的申购费率由管理人决定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的赎回费率由管理人决定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日集合计划份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 4、申购费用由投资人承担，不列入集合计划财产。 七、拒绝或暂停申购的情形 在集合计划合同约定的封闭期内，管理人不接受投资人的申购申请。在开放期内，发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形。 发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时，管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第7项情形时，管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，管理人应及时恢复申购业务的办理，且开放期按暂停申购的期间相应顺延，管理人有权合理调整申购业务的办理期间并予以公告。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应及时报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，且开放期按暂停赎回的期间相应顺延，管理人有权合理调整赎回业务的办理期间并予以公告。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 当集合计划开放期内单个开放日内出现巨额赎回时，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付赎回款项。 (2)延缓支付赎回款项：本集合计划开放期内单个开放日出现巨额赎回的，管理人对符合法律法规及本合同约定的赎回申请应于当日全部予以接受和确认。但对于已接受的赎回申请，如管理人认为全额支付投资人的赎回款项有困难或认为全额支付投资人的赎回款项可能会对集合计划的资产净值造成较大波动的，管理人在当日按比例办理的赎回份额不低于集合计划总份额20%的前提下可对其余赎回申请延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额。 (3)开放期内，当本集合计划发生巨额赎回时，在单个集合计划份额持有人赎回申请超过前一工作日集合计划总份额20%的情形下，对该单个集合计划份额持有人在该比例以内的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述(1)或(2)方式处理，对该单个集合计划份额持有人超过该比例的赎回申请，如管理人认为支付该集合计划份额持有人的赎回款项有困难或者因支付该集合计划份额持有人的赎回款项而进行的财产变现可能会对本集合计划资产净值造成较大波动时，管理人有权实施延期办理。对于该集合计划份额持有人未能赎回部分，集合计划份额持有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，并与下一开放日新增的赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的本集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到本开放期结束为止。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，即管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过本集合计划总份额20%以上而被延期办理赎回申请的单个集合计划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。 如集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，集合计划份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理，具体见相关公告。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。 3、巨额赎回的公告 当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，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个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。 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，管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的集合计划份额净值。 3、若暂停时间超过1日，则管理人可以根据《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的集合计划份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。 十一、集合计划转换 管理人可以根据相关法律法规以及本合同的规定决定开办本集合计划与管理人管理的其他集合资产管理计划之间的转换业务，集合计划转换可以收取一定的转换费，相关规则由管理人届时根据相关法律法规及本合同的规定制定并公告，并提前告知托管人与相关机构。 十二、集合计划的非交易过户 集合计划的非交易过户是指集合计划登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投资人。 十五、集合计划份额的冻结和解冻 集合计划登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。 十六、集合计划份额的转让 本集合计划暂时不支持份额的转让，但在法律法规允许且条件具备的情况下，管理人可受理集合计划份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请，并由登记机构办理集合计划份额的过户登记。管理人拟受理集合计划份额转让业务的，将提前公告，集合计划份额持有人应根据管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。 如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务，管理人将制定和实施相应的业务规则。 十七、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回 本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购与赎回安排详见招募说明书或相关公告。	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基金管理人网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。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份额的申购与赎回。 二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日申请办理基金份额的申购和/或赎回，具体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、赎回时除外。开放期内开放日的具体业务办理时间在相关公告中载明。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 本基金每3个月开放一次，每次开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。投资者可在开放期内办理申购、赎回等业务。开放期的具体期间由基金管理人在每一开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。如在封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使本基金无法按时开放申购与赎回等业务，或依据本基金合同需暂停申购或赎回等业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日下一个工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求，具体时间以基金管理人届时公告为准。 基金管理人应在每次开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告开放期的具体情况。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。本基金开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。在开放期最后一个工作日业务办理时间结束之后提出有关申请的，视为无效申请。 三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算； 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回；基金份额持有人持有的集合计划份额的期限连续计算； 四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。 投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。 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；登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等损失。 基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者T日赎回申请生效后，基金管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券/期货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他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情形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缓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。 3、申购和赎回申请的确认 基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项本金退还给投资人。 基金管理人或登记机构可以在法律法规和基金合同允许的范围内，且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对上述业务办理时间进行调整，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。 五、申购和赎回的数量限制 6、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见招募说明书或相关公告。 7、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和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后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日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并按约定公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算及余额的处理方式详见《招募说明书》。本基金的A类基金份额申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 4、A类基金份额申购费用由申购A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产。C类基金份额不收取申购费用。 七、拒绝或暂停申购的情形 在基金合同约定的封闭期内，基金管理人不接受投资人的申购申请。在开放期内，发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外）持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形。 8、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、当日申购金额限制、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的情形。 发生上述第1、2、3、5、6、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第7、8项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并公告，且开放期按暂停申购的期间相应顺延，基金管理人有权合理调整申购业务的办理期间并予以公告。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，开放期按暂停赎回的期间相应顺延，基金管理人有权合理调整赎回业务的办理期间并予以公告。 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、延缓支付赎回款项。 (2)延缓支付赎回款项：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净值造成较大波动时，基金管理人应对当日全部赎回申请进行确认，当日按比例办理支付赎回款项的赎回份额不得低于上一工作日基金总份额的20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过20个工作日，并应当在规定媒介上进行披露。延缓支付赎回款项的赎回申请以赎回申请当日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额。 (3)在开放期内，当基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人超过前一工作日基金总份额20%以上的赎回申请情形下，基金管理人对于其超过前一工作日基金总份额20%以上部分的赎回申请，可以实施延期办理，延期的赎回申请与下一个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，直到全部赎回为止。其中延期办理的期限不得超过20个工作日，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，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过上一工作日基金总份额20%以上而被延期办理赎回的基金份额持有人办理赎回业务。投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回，如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，则投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。而对该单个基金份额持有人赎回比例在前一工作日基金总份额20%以内的赎回申请与其他投资者的赎回申请一并按上述(1)或(2)方式处理。 3、巨额赎回的公告 当发生上述巨额赎回并延缓支付赎回款项时，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，并于两日内在规定媒介上刊登公告。 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，在规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个开放日的各类基金份额净值。 3、如发生暂停的时间超过1日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近1个开放日的各类基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。 十一、基金转换 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金基金份额之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。 十二、基金份额的转让 在法律法规允许且条件具备的情况下，且对基金份额持有人无实质性不利影响，基金管理人在履行相关程序后可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请，并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。 十三、基金的非交易过户 基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。 十六、基金份额的冻结、解冻与质押 基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分基金份额所产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配，法律法规另有规定的除外。 如相关法律法规允许，在对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，基金管理人履行相关程序后可办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。 十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回 本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。 十八、在不违反相关法律法规和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。
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：东海证券股份有限公司（简称：东海证券） 住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层 法定代表人：钱俊文 设立日期：1993年1月16日 批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行银复〔1992〕362号 资产管理业务资格批准文号：中国证监会证监机构字〔2005〕77号 组织形式：股份有限公司 注册资本：167,000万元整 存续期限：持续经营 联系电话：021-20333333 (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： (12)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所产生的权利； 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： (9)编制季度报告、中期报告和年度报告； (11)保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露； 二、托管人 (一)托管人简况 名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行） 住所：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120） (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： (2)设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜； (7)保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《集合计划合同》、《托管协议》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外； 三、集合计划份额持有人 集合计划投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《集合计划合同》的承认和接受，集合计划投资者自依据《集合计划合同》取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《集合计划合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。集合计划份额持有人作为《集合计划合同》当事人并不以在《集合计划合同》上书面签章或签字为必要条件。 每份集合计划份额具有同等的合法权益。 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于：	一、基金管理人 (一)基金管理人简况 名称：东海基金管理有限责任公司 住所：上海市虹口区丰镇路806号3幢360室 法定代表人：严晓珺 设立日期：2013年2月25日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会《关于核准设立东海基金管理有限责任公司的批复》（证监许可[2013]179号） 组织形式：有限责任公司 注册资本：16480.3118万元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：021-60586900 (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： (12)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所产生的权利；代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于证券投资基金所产生的权利，包括但不限于参加本基金持有基金的基金份额持有人大会并行使相关投票权利； 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： (9)编制基金季度报告、中期报告和年度报告； (11)保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关、行业自律组织的要求提供，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外； 二、基金托管人 (一)基金托管人简况 名称：交通银行股份有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号（邮政编码：200120） (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： (2)设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜； (7)保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关、行业自律组织的要求提供，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外； 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。 同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。 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： (9)发起资金提供方申购本基金的金额不少于1000万元人民币（不含申购费），持有申购的基金份额自基金合同生效之日起不少于3年；
第八部分 基金份额持有人大会	本集合计划份额持有人大会不设日常机构。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，但法律法规另有规定或本合同另有约定的除外： (4)转换集合计划运作方式； (5)调整管理人、托管人的报酬标准； (11)单独或合计持有本集合计划总份额10%以上（含10%）集合计划份额的集合计划份额持有人（以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会； (12)对本合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项； 2、在法律法规规定和《集合计划合同》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)增加、减少或调整本集合计划的集合计划份额类别、对集合计划份额分类办法及规则进行调整、停止现有集合计划份额类别的销售、调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率，或变更收费方式； (4)对《集合计划合同》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《集合计划合同》当事人权利义务关系发生变化； (5)管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司； 二、会议召集人及召集方式 2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。 六、表决 2、特别决议，特别决议应当经参加大会的集合计划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）通过方可做出。除本合同另有约定外，转换集合计划运作方式、更换管理人或者托管人、终止《集合计划合同》、本集合计划与其他集合资产管理计划合并以特别决议通过方为有效。 九、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定 7、特别决议应当经参加大会的集合计划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。 同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。	本基金基金份额持有人大会不设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金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。 本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时，在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下，本基金的基金管理人可直接参加该基金份额持有人大会并行使相关投票权利，无需事先召开本基金的基金份额持有人大会。基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为同意本基金管理人参与本基金所持基金的基金份额持有人大会并行使相关投票权利。法律法规另有规定的从其规定。 在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下，本基金的基金管理人可代表本基金的基金份额持有人在符合条件的情况下提议召开或召集本基金所持基金的基金份额持有人大会，无需事先召开本基金的基金份额持有人大会。基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为同意本基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金所持基金的基金份额持有人大会。法律法规另有规定的从其规定。 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，但法律法规另有规定或本基金合同另有约定的除外： (4)转换基金运作方式（不包括本基金封闭期与开放期的转换）； (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率，但法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费率的除外； (11)单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（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； (12)对本基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项； 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金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： (2)增加、减少或调整本基金的基金份额类别、对基金份额分类办法及规则进行调整、停止现有基金份额类别的销售、调整本基金的申购费率、调低销售服务费率，或变更收费方式； (4)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化； (5)基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则； (6)履行适当程序后，基金推出新业务或服务； 二、会议召集人及召集方式 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。 六、表决 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表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规或本基金合同另有约定外，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。 九、本基金持有的证券投资基金召开基金份额持有人大会时，本基金基金管理人应当代表其基金份额持有人的利益，根据基金合同的约定参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。本基金基金管理人需将表决意见事先征求本基金基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。 法律法规对于本基金参与本基金持有的基金召开基金份额持有人大会的程序另有规定的，从其规定。 十、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 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。 侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。 侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分相关约定。
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	一、管理人和托管人职责终止的情形 (一)管理人职责终止的情形 4、管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立的具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司； 二、管理人和托管人的更换程序 (二)管理人更换的特殊程序 当管理人根据相关法律法规的规定，以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司时，在管理人和托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司，本集合计划的管理人变更为前述从事资产管理业务的公司。前述变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议，但管理人应当保证受让人具备管理本集合计划的相关资格，按照法律法规和中国证监会的要求履行相关程序，并按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。	一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形 (一)基金管理人职责终止的情形 二、基金管理人和基金托管人的更换程序
第十一部分 基金份额的登记	四、集合计划登记机构的义务 集合计划登记机构承担以下义务： 1、配备足够的专业人员办理本集合计划份额的登记业务；	四、基金登记机构的义务 基金登记机构承担以下义务： 1、配备足够的专业人员办理本基金基金份额的登记业务；
第十二部分 基金的投资	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，包括债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 集合计划的投资组合比例为： 本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%。但在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期间不受上述80%的比例限制。在开放期内，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，本集合计划持有现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，封闭期内不受上述5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。 三、投资策略 (一)封闭期投资策略 在封闭期内，本集合计划的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属和板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、信用债券投资策略、可转换债券/可交换债券投资策略、国债期货投资策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略以及股票投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。 7、信用债券投资策略 本集合计划的内部信用评级体系包含即期评级和跟踪评级。即期评级侧重于评级的准确性，为信用产品的实时交易提供参考；此外，本集合计划会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪评级，以有效规避信用风险，并把握市场变动带来的投资机会。 本集合计划所投资的信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于AA，并将根据经济周期、信用周期的变化，动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例，在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。 本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于AA（含），且应当遵守下列要求： (1)本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占集合计划资产净值的50%-100%； (2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的50%； (3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的20%。 信用评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级或担保人评级。 8、可转换债券/可交换债券投资策略 可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点，具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本集合计划着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的转债，确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值，同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征，选择合适的投资品种，分享正股上涨带来的收益。 本集合计划将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债券的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择最具吸引力标的进行配置。 本集合计划投资于可转换债券和可交换债券的比例合计不超过集合计划资产净值的20%。 12、股票投资策略 主要选择有良好增值潜力的股票以及有良好现金流、经营业绩持续增长、估值合理的防御类股票构建股票投资组合。在集合计划运作初期，轻度参与股票投资，在集合计划份额净值高于集合计划面值，具有一定风险承受能力后，当判断股票市场趋好时，增加股票资产以获得更高的收益率，当判断股票市场形势不好时，减少对股票的投资。 四、投资限制 1、组合限制 (1)本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%。但在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，集合计划投资不受上述80%的比例限制； (2)开放期内，本集合计划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，保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，封闭期内不受上述5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金； (4)本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制； (8)本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划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%； (9)本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。集合计划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； (11)本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划（包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划）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%；本集合计划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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； (12)本集合计划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集合计划资产净值的40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期； (13)本集合计划投资于国债期货合约，应满足如下限制： (c)本集合计划所持有的债券（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）应不低于集合计划资产的80%； (14)本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； 除上述(2)、(9)、(14)、(15)情形之外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。 法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经集合计划份额持有人大会审议。 2、禁止行为 为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动： (4)买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； 五、业绩比较基准 本集合计划采用“中债新综合指数（全价）指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%”作为业绩比较基准。 中债新综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖银行间市场和交易所市场，指数成份券种包括国债、企业债等主要债券品种。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本集合计划的业绩比较基准。 本集合计划投资于债券、股票等，其中投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%。根据本集合计划设定的投资范围和投资比例，管理人以90%的中债新综合指数和10%的沪深300指数构建的复合指数作为本集合计划的业绩比较基准，与本集合计划的投资风格基本一致，因此上述业绩比较基准目前能够较好地反映本集合计划的投资风格及风险收益特征。 如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，或今后法律法规发生变化，或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本集合计划的业绩比较基准时，本集合计划管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略，调整集合计划的业绩比较基准，但应在取得托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开集合计划份额持有人大会审议。 六、风险收益特征 本集合计划是一只债券型集合资产管理计划，理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。	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，包括债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含可分离交易可转债，下同）、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国内依法发行上市的股票（包括主板、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）、国债期货、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型ETF和基金管理人管理的股票型基金和基金管理人管理的计入权益类资产的混合型基金，不包括QDII基金、香港互认基金、FOF基金、可投资基金的非FOF基金、货币市场基金）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： 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制。本基金对股票（含存托凭证）、股票型基金、应计入权益类资产的混合型基金等权益类资产及可交换债券、可转换债券（含可分离交易可转债）的投资比例合计不超过基金资产的20%；本基金持有公开募集证券投资基金的市值不超过基金资产净值的10%。开放期内，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，本基金持有的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%；封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。上述应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%； 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%。 如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、投资策略 (一)封闭期投资策略 在封闭期内，本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、板块轮换策略、骑乘策略、个券选择策略、信用债券投资策略、可转换债券（含可分离交易可转债）/可交换债券投资策略、国债期货投资策略、融资杠杆策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略以及基金投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。 7、信用债券投资策略 本基金将视经济周期、信用周期的变化，动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例，在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。 本基金投资信用债（含资产支持证券，下同）评级须在AA+（含AA+）以上，为更好控制投资组合面临的信用风险，本基金的投资遵从以下投资比例限制： (1)本基金投资于AAA信用评级的信用债的比例占全部信用债资产的50%-100%； (2)本基金投资于AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的50%。 上述信用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本基金投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。评级信息参照资信评级机构发布的最新评级结果，评级机构不包含中债资信评估有限责任公司。本基金持有信用债期间，如果其信用评级下降、基金规模变动、变现信用债券支付赎回款项等使得投资比例不再符合前述标准，应在评级报告发布之日起不再符合前述标准之日起3个月内调整至符合约定。 8、可转换债券（含可分离交易可转债，下同）、可交换债券投资策略 可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点，具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本基金着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的可转换债券，确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值，同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征，选择合适的投资品种，分享正股上涨带来的收益。 本基金将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债券的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择具有吸引力标的进行配置。 12、股票投资策略 主要选择有良好增值潜力的股票以及有良好现金流、经营业绩持续增长、估值合理的防御类股票构建股票投资组合。 13、存托凭证投资策略(1)存托凭证投资策略 本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。 14、基金投资策略 针对基金投资，本基金投资于全市场的股票型ETF及基金管理人管理的股票型基金、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%； (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%。 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研文化等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，主要参考基金规模、历史业绩、风险调整后的收益、风险控制指标等一系列量化指标对基金进行分析，选取出预期可能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，符合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、风险控制能力等方面进行筛选。 四、投资限制 1、组合限制 (1)本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制。本基金对股票（含存托凭证）、股票型基金、应计入权益类资产的混合型基金等权益类资产及可交换债券、可转换债券（含可分离交易可转债）的投资比例合计不超过基金资产的20%。上述应计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一： a、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%； b、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%。(2)开放期内，本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%；封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； (3)本基金持有公开募集证券投资基金的市值不超过基金资产净值的10%； (4)本基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），其市值不超过基金资产净值的10%； (5)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（不含本基金所投资的基金份额），不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制； (9)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)本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； (12)在开放期内，本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的40%。在封闭期内，本基金债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日基金资产净值的100%； (13)若本基金投资于国债期货合约，应满足如下限制： (c)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； (14)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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (17)本基金管理人管理的全部基金（ETF联接基金除外）持有单只基金不得超过被投资基金净资产的20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准； (18)本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额； (19)本基金投资其他基金时，被投资基金的运作期限应当不少于1年，最近定期报告披露的基金净资产应当不低于1亿元； (20)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算； (21)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前款第(17)项规定的比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述(2)、(14)、(15)、(17)情形之外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动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。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。 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)持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额； (5)投资基金中基金、可投资其他基金的非基金中基金和本基金基金经理管理的其他基金； 五、业绩比较基准 本基金采用“中债新综合指数（全价）收益率×90%+沪深300指数收益率×10%”作为业绩比较基准。 中债新综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖银行间债券市场和交易所市场，指数成份券种包括国债、企业债等主要债券品种。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。 本基金投资于债券、股票等，其中投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%（但在开放期开始前10个工作日、开放期以及开放期结束后的10个工作日内，本基金债券资产的投资比例不受上述比例限制）。根据本基金设定的投资范围和投资比例，基金管理人以90%的中债新综合指数（全价）和10%的沪深300指数构建的复合指数作为本基金的业绩比较基准，与本基金的投资风格基本一致，因此上述业绩比较基准目前能够较好地反映本基金的投资风格及风险收益特征。 如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，或今后法律法规发生变化，或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，依据维护基金份额持有人利益的原则，经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整基金的业绩比较基准并及时公告。 六、风险收益特征 本基金是一只债券型基金，理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。
第十三部分 基金的财产	一、集合计划资产总值 集合计划资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和集合计划应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和。	一、基金资产总值 基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、证券投资基金基金份额、银行存款本息和基金应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和。

（下转D43版）