（上接B11版）

②约占品种差异造成的风险。合约品种差异造成的风险，是指类似的合约品种，在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：1）价格变动的方向相反；2）价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险。

③标的物风险。股指期货交易中，标的物风险是由于投资组合与股指期货的标的指数的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险。

④无法品模型风险。本基金在构建股指期货组合时，可能借助模型进行期货合约的选择。由于模型设计、资本市场的剧烈波动或不可抗力，按模型结果调整股指期货合约或者持仓比例也可能将给本基金的收益带来影响。

8、其他风险

①随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

②因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

③因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

④因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

⑤对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

⑥战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

⑦其他意外导致的风险。

二、声明

1、投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金管理人指定的基金代销机构代理销售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒体公告。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

①《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

②对基金财产和债权债务进行清理和确认；

③对基金财产进行估值和变现；

④制作清算报告；

⑤聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

⑥将清算报告报中国证监会备案并公告。

⑦对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

十八、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《行作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

①募法募集资金；

②自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

③按照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

④销售基金份额；

⑤按照规定召集基金份额持有人大会；

⑥按照《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

⑦选基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

⑧选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

⑨组任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

⑩按照《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

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；

⑫按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；

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、融券；

⑭以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

⑮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；

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》、《行作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

①按法募集资金，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办理基金备案手续；

③自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产的运用和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

⑥按《招募说明书》、《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，不得委托第三人运作基金财产；

⑦法按接受基金托管人的监督；

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；

⑨进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

⑩编制季度、半年度和年度基金报告；

⑪严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

⑫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；

⑬按《基金合同》约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人公布基金收益；

⑭按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

⑮按照《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托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

⑯按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

⑰确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

⑱组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

⑲面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

⑳因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

㉑监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

㉒当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

㉓以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

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；

㉕执行生效的基金份额持有人大会的决议；

㉖建立并保存基金份额持有人名册；

㉗法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《行作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

①自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》规定安全保管基金财产；

②依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

③监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

④根据相关市场规则，为基金开设证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

⑤提议召开或召集基金份额持有人大会；

⑥在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

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》、《行作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

①以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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；

③建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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；

⑤保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

⑥按规定开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》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；

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；

⑧复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

⑨办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

⑩对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

⑪保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上；

⑫建立并保存基金份额持有人名册；

⑬按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

⑭依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

⑮按照《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；

⑯按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

⑰参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

⑱面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

⑲因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

⑳按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

㉑执行生效的基金份额持有人大会的决定；

㉒法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人的权利与义务

基金份额持有人不直接参与基金的管理和运作，其权利主要体现为：

①基金份额持有人大会的召集、议事及表决的权利；

②按《基金合同》约定比例计算基金份额持有人的权益的权利；

③按《基金合同》规定分配基金收益的权利；

④按《基金合同》规定申请赎回或者转让其持有的基金份额的权利；

⑤查阅或者复制公开披露的基金信息资料的权利；

⑥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；

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》、《行作办法》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；

③关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

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；

⑤在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

⑥不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

⑦执行生效的基金份额持有人大会的决定；

⑧返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

⑨法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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：

①终止《基金合同》；

②更换基金管理人；

③更换基金托管人；

④转换基金运作方式；

⑤提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

⑥变更基金类别；

⑦本基金与其他基金的合并；

⑧变更基金投资目标、范围或策略；

⑨变更基金份额持有人大会程序；

⑩基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

⑬法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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；

②法律法规要求增加的基金费用的收取；

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；

④因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

⑤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变化；

⑥按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

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。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应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的，应当自出具书面决定之日起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托管人。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。

5、代表基金份额10%以上（含10%）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10%以上（含10%）基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日提中国证监会备案。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。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（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

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

①会议召开的时间、地点和会议形式；

②会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

③有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

④授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

⑤会务常设联系人姓名及联系电话；

⑥出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

⑦召集人需要通知的其他事项。

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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（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、通讯开会方式或法律法规及监管机关允许的其他方式召开，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投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：

①亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投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，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

②经核对，汇总到会者出席在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进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

①会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

②召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

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参加，方可召开。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，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直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。

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投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。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行；基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

①现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

②通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，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）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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。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。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

①如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

②监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

③如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

④计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（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，自基金合同生效日起，凡与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。

三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

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10%，若《基金合同》未规定不满3个月可对于可供分配的收益。

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

四、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（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

本基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3-7项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

五、基金的投资

（一）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、债券、权证、货币市场工具、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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）投资比例不高于基金资产的95%；国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的5%；权证投资比例不高于基金资产的3%；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，保持现金或者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）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

①本基金股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）投资比例不高于基金资产的95%；债券、中期票据、中小企业私募债、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的5%；

②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；

③本基金持有一家上市公司的股票，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，不超过该证券的10%；

⑤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%；

⑥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%；

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%；

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%；

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%；

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%；

⑪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%；

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；

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；

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%；

⑮单只证券投资基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的10%；

⑯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%；

⑰本基金在任何交易日日终，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；

⑱本基金在任何交易日日终，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%；

⑲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%；

⑳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；

㉑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；

㉒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%；

㉓单只证券投资基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的10%；

㉔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%；

㉕本基金在任何交易日日终，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；

㉖本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%；

㉗本基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；

㉘本基金管理人将按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况；

㉙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，不高于基金资产净值的95%；

㉚本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）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%；

㉛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。

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其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

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基金合同的有关约定。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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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：

①承销证券；

②违反规定向他人贷款或者提供担保；

③从事未经其限责任的投资；

④买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

⑤向其基金管理人、基金托管人出资；

⑥从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

⑦依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

六、基金资产估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（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