

（上接B10版）

四、估值程序

1. 每万份基金已实现收益是按照相关法规计算的每万份基金份额的日已实现收益,精确到小数点后第4位,小数点后5位采取截尾的方式去。本基金收益分配是按日结转份额的,7日年化收益率是以最近7日(含节假日)收益所折算的年资产收益率,精确到0.01%。百分号内小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

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约定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将估值结果发送基金托管人,经基金管理人复核无误后,由基金管理人对外公布。

五、估值错误的处理

基金管理人及基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金资产的计价导致每万份基金已实现收益小数点后4位或7日年化收益率百分号内小数点后4位以内发生差错时,视为估值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1. 估值错误类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任应当由过错方承担;由于估值错误导致损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”处理,承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2. 估值错误处理原则

(1) 估值错误发生后,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;若估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方直接承担先行赔偿责任;若估值错误责任方已经积极更正,并且有协助义务的其他当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行说明,除非估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方为有关当事人直接损失的责任方,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3) 因估值错误获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负有责任,如果由获得不当得利当事人不返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求返还其所获得的不当得利;如获得不当得利的当事人已经将该不当得利返还给受损方,则受损方认为其在获得的赔偿额加上已获得的不当得利返还的总和超过其所获得的不当得利赔偿部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3. 估值错误处理程序

估值错误处理程序如下的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对估值错误的损失进行估算;

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基金登记机构进行更正,并及时估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4. 基金资产净值估值错误处理的方法如下:

(1) 当基金资产净值出现错误时,基金管理人应立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;

(2) 错误偏差达到基金资产净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金资产净值的0.5%时,基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

六、暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易所市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净收益的分配

1. 基金净收益按照以下原则分配: 每万份基金已实现收益按7日年化收益率由基金管理人向基金份额持有人进行分配,基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值,每万份基金已实现收益按7日年化收益率并发送给基金托管人,基金托管人复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人予以公布。

第十二部分 基金的投资

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损益的余额。

二、收益分配原则

1. 本基金收益分配遵循下列原则: 1、本基金份额基金利润享有同等分配权; 2、本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;

3、“每份分配,按日支付”。本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位;

4、本基金每日进行收益分配,并只采用红利再投资的方式进行。若当日已实现收益大于零时,则增加投资者基金份额;若当日已实现收益等于零时,则维持投资者基金份额不变;基金管理人将采取必要措施尽量避免基金已实现收益小于零,若当日已实现收益小于零时,相应缩减投资者基金份额;

5、T日申购且成功确认的基金份额,自T+1日起享有基金收益分配权益;T日赎回且成功确认的基金份额,自T+1日起不享有基金收益分配权益;

6、在不影响基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,需在召开基金份额持有人大会审议。

三、收益分配方案

1. 基金按日计算并分配收益,基金管理人于每个开放公告收益分配方案。

四、收益分配的频率和程序

1. 基金每日进行收益支付,并只采用红利再投资的方式,基金管理人不得对基金份额收益分配方案。

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. 销售服务费;

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、律师费和诉讼费;

6.基金份额持有人大会费用;

7.基金的证券交易费用;

9.按照有关规定或《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用的计提和支付方式

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0.33%费率计提。管理费的计算方法如下:

H= E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,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3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. 销售服务费用

指基金份额持有人参与基金申购过程中,因申购费用不在申购或赎回费用中列支,为完成申购或赎回操作而产生的申购或赎回手续费、申购、赎回机构费用、会计师“期权”交易损失、IT系统维护等费用。

在本基金的多种交易组合中,可能因交易系统故障或申购赎回资金的不正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记结算机构、销售机构、证券交易所等等。

六、合规性投资

指基金资产管理运作过程中,违反国家法律法规的规定,或基金投资违反法律法规及基金合同有关规定的风险。

四、管理风险

指在基金资产管理过程中,除因基金管理人经济形势和证券市场的判断有误,获取的信息不全等影响基金收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

5. 操作或技术风险 指相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规范等风险。例如,会计核算差错,会计记账“期权”交易损失,IT系统维护等风险。

在本基金的多种交易组合中,可能因交易系统故障或申购赎回资金的不正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、登记结算机构、销售机构、证券交易所等等。

六、合规性投资

指基金资产管理运作过程中,违反国家法律法规的规定,或基金投资违反法律法规及基金合同有关规定的风险。

七、其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

七、其它风险 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。 市场和证券市场风险 包括:商品市场和期货市场波动,托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致收益或者基金份额持有人利益受损。

7日年化收益率的计算方法:

$$\left[\left(1 + \frac{R}{360} \right)^{360} - 1 \right] \times 100\%$$

其中,R为最近7个自然日(包括计算日)的每万份基金已实现收益。 每万份基金已实现收益,保留至小数点后4位,小数点后第5位采取截尾的方式去,7日年化收益率采取四舍五入保留至百分号内小数点后两位。

如果基金成立不足7日,按实际持有天数计算。

2. 在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人将在每个开放日的次日,通过网站、基金销售网或其他方式披露,披露开放日的每万份基金已实现收益和7日年化收益率。若遇法定节假日,于节假日结束后第2个工作日,公告节假日期间的每万份基金已实现收益、节假日最后一日的7日年化收益率,以及节假日后首个开放日的每万份基金已实现收益和7日年化收益率。

3. 基金管理人将至少每周最后一个市场交易日(或自然日)公布基金资产净值、每万份基金已实现收益和7日年化收益率。基金管理人应当在上市证券交易所(或自然日)的次日,将基金资产净值、每万份基金已实现收益和7日年化收益率公告在指定网站上。

(四) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体上。

《基金合同》生效后不足2个月的,基金管理人应在编制当季季度报告、半年度报告或者年度报告时,基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案,报告应采用中文文本或电子报告形式。

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露前分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。 前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件:

1. 基金份额持有人大会的召开;

2. 终止《基金合同》;

3. 转换基金运作方式;

4. 更换基金管理人、基金托管人;

5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

6. 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员、基金经理以及其他高级管理人员发生变更,变更基金管理人持有基金份额比例发生变化;

7. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

8. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

9. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

10. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

11. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

12. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

13. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

14. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

15. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

16. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

17. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

18. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

19. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

20. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

21. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

22. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

23. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

24. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

25. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

26. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

27. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

28. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

29. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

30. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

31. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

32. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

33. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

34. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

35. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

36. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

37. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

38. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

39. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

40. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

41. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

42. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

43. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

44. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

45. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

46. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

47. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

48. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

49. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

50. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

51. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

52. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

53. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的基金业务资格、注册登记资格被取消、撤销、暂停或恢复;

(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公告;

(7)对基金财产进行变现;

基金财产清算期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。

五、清算费用

清算费用指基金财产清算小组在履行基金清算过程中发生的有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

六、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算后的分配方案,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,交纳欠税并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

七、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项及时公告;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。

八、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。

第十八部分 基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利和义务

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,办理基金份额的发售和登记事宜;

(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) 根据《基金合同》收取基金管理费及其他法律法规规定或中国证监会批准的其费用;

(4) 销售基金份额;

(5) 按照约定召集基金份额持有人大会;

(6) 依据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(7) 在基金合同存续期间,有权对基金财产的投资进行监督;

(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) 担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) 依据《基金法》、《基金合同》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,办理基金份额的发售和登记事宜;

(2) 在基金合同有效期内,按照法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(4) 销售基金份额;

(5) 按照约定召集基金份额持有人大会;

(6) 依据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(7) 在基金合同存续期间,有权对基金财产的投资进行监督;

(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) 担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) 依据《基金法》、《基金合同》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,办理基金份额的发售和登记事宜;

(2) 在基金合同有效期内,按照法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(4) 销售基金份额;

(5) 按照约定召集基金份额持有人大会;

(6) 依据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(7) 在基金合同存续期间,有权对基金财产的投资进行监督;

(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;