Disclosure 信息技术 Zqsb@stcn.com (0755)83501750

(上**接B30版**) 18.在任何交易日日终. 持有的买人国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;在任何交易日日终. 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买人,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,在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债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30%;

19.基金总资产不得超过基金净资产的140%;

19基並忘玩厂不得超过基並评成厂的140%; 20.法律法规及中国证据会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 因证券、期货市场被动、上市公司合并、基金期模变对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。在上述期间内、本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查。

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:

3-6月/金並/1960年7人19日24人並、全並列) 不予用 1 予切及以及自由 - 茶精旺季。 - 违反规定向他人贷款或者提供担保; - 从事承担无限责任的投资; - 实实其他基金份额 但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外; - 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。 基金管理人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重大利 基金管理人应用品金则产头买基金管理人、基金忙官人及共伦区区水、关时公司从取自一共年里人产 害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略、遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突、建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议、并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每以在开始来作为。目标记述是对本

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限

九、基金的融资融券及转融通

本基金可以按照法律、法规和监管部门的有关规定履行适当程序后,进行融资、融券以及转融通等相关 业务。待基金参与融资融资中和等超少务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金版有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比 例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 建立健全内部控制制度、采取有效措施、防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会

2、本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取

(1)将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对特其管理的不同基金财产; (2)不公平地对特其管理的不同基金财产; (3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益; (4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

、本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规 (1)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(2) 起设盘运用网络工程协议; (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益; (4) 在向中国证监会报送的资料中寿康作假; (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6)玩忽职子、滥用职权; (7)违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定、泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息; (8)违反证券交易场所业务规则、利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格、扰乱市场秩序;

(9)贬损同行,以抬高自己;

(10)以不正当手段课来业务发展; (11)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象; (12)在公开信息披露和广告中故意含有虚假。误导,欺诈成分; (13)其他法律、行致法规以及中国证监会禁止的行为。

、基金经理承诺

4. 基蓝空球形的 (1) 依照有关注律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益; (2) 不利用职务之便为自己及其代理人,受雇人或任何第三人谋取利益;

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息; (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

第十部分 基金的财产

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

金亚亚尔 中于祖廷国籍金亚尔 公司明明公全金亚以1007日1707日186 三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专 用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以

(四、基金财产的保管和处分本基金财产的保管和处分本基金财产独立工程的保管。基金管理本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理、基金长管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本 基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得被处

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不 属于其清漳财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权、不得与其固有资产产生的债务相互抵销;基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。 第十一部分 基金资产的估值

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

基金所拥有的股票、债券、衍生工具和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

本基金所持有的投资品种,按如下原则进行估值:

各金亚州行有的汉文四种,农业厂界则211回。 1、对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值,估值日无市价,但最近交易 另日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确

是公元UTIBL。 2.对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发 行机构发生了影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近 交易市价,确定公允价值。 3.当投资品种不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同,或被以往市场实际交易价格验证的估值技

3、当投资品种介公价值。
4、本基金可以采用市场参与者普遍认同,或被以往市场实际交易价格验证的估值技术,确定投资品种的公价值。
4、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。
5、如有充足理由认为按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人向应后, 投废能吃爽公允价值的价格估值。
6、存在相关法律法规以及监管部门有相关规范的,从其规定。
如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分推护基金份额持有人利益的,应过即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本程、由基金的基金会计程度,如公社经发生方式空集中。上去公社总区。但

责任方中基金管理人担任 因此 就与本基全有关的会计问题 加经相关多方在平等基础上充分讨论后 仍 无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布 四、估值程序

1. 经金边的银行通足较低度 1 上下口切印点。经金边, 仔通床以当口签金边的职力来领权属 17 异,相明封 0.001元,小数点后第4位四全五人。国家另有规定的,从其规定。 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。 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杆管人,经基金杆管人 复核无误后,由基金管理人对外公布。

基金管理人和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 份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。 本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

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,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人("受损万")的直接损失按下述"估值错误处理原则"给予赔偿,承担赔偿责任。

2、估值错误处理原则

(1)估值错误已发生,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;由于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,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任,若估值错误责任方已经积极协调,并且 有协助义务的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确认。确保估值错误已得到更正 吳正的河南公門有大当事入地行明机,则採访值暗镇医口得到吳正。 (2)估值错误的勇士先为有关当事人的直接损失负责,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)因估值错误而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

值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不适还或不全都适还不当得利造成其他当事人的虚对证值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不适还或不全都适还不当得利造成其他当事人的品品损失("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公事人已经将此部分不当得利适还给受损方, 则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支

(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。 估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序加下。

(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

(2)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估; (3)根据估值错误外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)根据后值错误处理的方法。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,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措

(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。

(3) 所成的各种成果在原现成品自动大力有规定的、外类规定双重。 大、暂停估值的情形 1. 基金投资所涉及的证券交易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. 占基金指当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益。决定延迟估值时;出现基金管理人认为属于紧急事故的情况,导致基金管理人不能出售或评估基金资产时; 4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。 、基金净值的确认 計基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复

村。 1. 全並に高近域的投票並以「中国中央主任 核。基金管理人成于每个开放口交易转束后计算当目的基金资产单值和基金份额净值并发送分 人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

1.基金管理人按估值方法的第5项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理; 2.由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金 托管人虽然已经采取必要、适当,合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值

错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减 轻或消除由此造成的影响。

第十二部分 基金的收益与分配

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。 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。 E、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6次,每份基金份额每次收益分

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争值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额争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。

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介公告并报中 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。

法律法规设置管机关另有规定的、从其规定。 六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的费用 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。

第十三部分 基金费用与税收

1、基金管理人的管理费;

2.基金計6人以目录。 3.《基金台同》生效后与基金相关的信息披露费用; 4.《基金台同》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;

、基金的证券交易费用; 7、基金的银行汇划费用; 8、证券账户开户费用和银行账户维护费;

8.证分帐户用户设计和4股门账户经验设施 9. 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。 本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。 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 本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.0%÷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 查查自律员每日刊界,是日素时主每月月末,按月又刊,日签查自律人问签查几目人及还签查自律员划款指令,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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顾延。2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

基金托管费每日计算,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托管费划 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付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

、基金费用的种类中第3-9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 人当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三、不列人基金费用的项目 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;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;《基金合同》生效前的相关费用;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。

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费等相关费

调低基金管理费率和基金托管费率等费率,无需召开基金份额持有人大会

基金管理人必须于新的费率实施日前2个工作日在至少一种指定媒介上公告。 五、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。

第十四部分 基金的会计与审计

一、基金的会计较限 1.基金管理人为本基金的基金会计责任方; 2.基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果《基金 合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度; 3.基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位; 4.会计制度执行国家有关会计制度; 5.本基金独立建账,独立核算; 6.基金等理和及基本分析管人及自保留含数的会计账目 凭证此进行日常的会计核管 按照有关规定稳

、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册 会计师对本基金的年度财务报表进行审计。 会计师对本基金的年度财务报表进行审计。 2.会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作

日内在指定媒介公告并报中国证监会备案

第十五部分 基金的信息披露 一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律对信息披露的方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时,本基金从其最新规定。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等 法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。 本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实

性、准确性和完整性。 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的 媒介和基金管理人,基金托管人的互联网网站(以下简称"网站")等媒介披露,并保证基金投资者能够按 照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。 三、本基金信息按露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

二、本語並后总版略大男人不由公开设置 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏; 2、对证券投资业绩进行预测;

3、违规承诺收益或者承担损失

4.证题其性基金管理人、基金托管人或者基金销售机构; 5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的税赞性、恭维性或推荐性的文字; 6. 中国证监会禁止的其他行为。 四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种

文本的内容一致、两种文本发生歧义的,以中文文本为推。 本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。 五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括:

公开披露的基金信息包括:
(一)基金相写说明书、《基金合同》基金托管协议
1、《基金台国》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系、明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序、说明基金产品的养牲等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。
2.基金招募说明书应。最是大限度址按露影响基金投资者决策的企解事项、说明基金认购,申购和赎回安排。基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后,基金管理人在每个月结束之日起公日内、更新招募说明书并登载在网站上、将更新后的程第说明书摘要登载在招车,从市场上,基金管理人在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面谈明。
3. 其今在按约以是思考证本会任务。有其全经理人,在其全经理人,在全人是不是一个

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义

务天系的法律义计。 基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上;基金管理人,基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载

于指定媒介上。 (三)《基金合同》生效公告 (四)基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。 (四)基金资产净值、基金份额净值 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资

产净值和基金份额净值。 在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售

网点以及其他媒介,披露开放目的基金份额输给值。 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产等值和基金份额累计净值登载在指定媒介当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产等值。基金份额等值和基金份额累计净值登载在指定媒介

(五)基金份额申购、赎回价格基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方 f关由购、赎回费率,并保i (六)基金定期报告,包括基金年度报告,基金半年度报告和基金季度报告 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前定媒介上,基金管理报告的协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介上 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

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。报备应当采用电子文本或书面报告方式。 本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书,予以公告,并在公开

《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告

按露日分别採中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证金派出机构备案。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、转换基金运作力式; 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; 、基金管理人股东及其出资比例发生变更; 、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发

9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十: 10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十; 11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼; 12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查; 13. 基金管理人及其董事, 总经理及其他高级管理人员, 基金经理受到严重行政外罚, 基金托管人及其

基金托管部门负责人受到严重行政处罚; 15、基金收益分配事项; 16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

17、基金份额争值计价错误达基金份额净值百分之零点五; 18、基金改聘会计师事务所; 19、变更基金销售机构; 20、更换基金登记机构; 21. 本基金开始办理由购. 赎回:

23、本基金发生巨额赎回并延期支付; 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回; 26、基金份额实施分类或类别发生变化; 27、基金推出新业务或服务;

28、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有

比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10 名资产支持证券明细。

(九)基金份额持有人大会决议 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构备案,并予以公告。 (十)投资于中小企业私募债券的信息披露 基金管理人应当在基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,在中国证监会指定媒介披露所投资中 が企业を経入性、当任金鉱は以下、リビュニの安川が川の「メの」「ア・エー国山血太」日と味り収録する 小企业私募債券的名称 数量、期限、収益率等信息。 基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中

在《基金合同》存续期限内,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产

小企业私募债券的投资情况。 (十一)投资资产支持证券信息披露 基金管理人应在基金年报及举年报中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。 基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的

期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险 的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。 (十三)投资国债期投票的投票投票的股份, (十三)投资国债期投票的债期关公告 基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、机益情况、风险指标等,并充分揭示国债期货交易对基金总体风险

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专人负责管理信息披露事务 基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基

金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查、并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。 基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息, 但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致. 为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底

稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所,供公众查阅、复

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以供公众查阅、复制。 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:

(1)不可抗力; (2)基金投资沪涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; (3)出现基金管理人认为属于会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况; (4)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

第十六部分 风险揭示 、投资于本基金的主要风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响,导致基金收益水平变 化而产生风险,主要包括: (1)政策风险。因国家宏观政策(如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等)发生变化、导致市场价格波动而产生风险。

(2)经济周期风险。随经济运行的周期性变化,证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债

6. 以益水平也会随之变化、从而产生风险。
6. 收益水平也会随之变化、从而产生风险。
6. 取益水平也会随之变化、从而产生风险。
6. 3 利率风险。金融市场利率的波边会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率、影响着企业的融资成本和利润。基金投资干债券、其收益水平会受到利率变化的影响。
6. 4)上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响,如管理能力、财务状况、市场前景、行业

竞争、人员素质等。这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善,其股票价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险,但不能完全规避。 (5)债券市场流动性风险。由于银行间债券市场深度和宽度相对较低,交易相对较不活跃,可能增大银

行间债券变现难度,从而影响基金资产变现能力的风险。 (6)购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配,而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降,从而使基金的实际收益下降。 (7)再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响,这与利率 上升所带来的价格风险(即利率风险),互为消长。具体为当利率下降时,基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时,将获得比以前较少的收益率。 (8)信用风险。基金所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息,或由于债券发行人信用等级

降低导致债券价格下降,将造成基金资产损失。

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可 (1)决策风险:指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中,由于决策失误

(2)操作风险:指基金投资决策执行中,由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的 (3)技术风险:是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。 3.职业道施风险:是指公司员工不遵守职业操守,发生违法、违规行为而可能导致的损失。 4.流动性风险 在开放式基金交易过程中,可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难,导

致流动性风险,甚至影响基金份额净值。 指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的 6、投资管理风险:(1)本基金为混合型基金,其预期收益和风险均高于货币型基金、债券型基金,而低

于股票型基金,属于证券投资基金中的投商风险、较高收益的基金类型;(2)选股方法、选股模型风险;(3)基金经理主观判断错误的风险;(4)其他风险。 7.投资于中小企业私募债券的风险 小孩员」,小小正亚岛等间分的外级 中小企业私募债的发行主体一般是信用资质相对较差的中小企业,其经营状况稳定性较低、外部融资 的可得性较差,信用风险高于大中型企业;同时由于其财务数据相对不透明,提高了及时跟踪并识别所蕴含 的潜在风险的难度,其进约风险高于现有的其他信用品种,极端情况下会给投资组合带来较大的损失。

(1)基差风险。标的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差

(1) 基塞风险。新的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险。
(2) 合约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对幅度上的差异。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,导致投资组合特区风险无法完全锁定所带来的风险。
(4) 衍生品模型风险。本基金在构建取指期货组合时,可能借助模型进行期货合约的选择。由于模型设计。

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

9、投资国债期货的风险 9. 投放自国研则成的风险 国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格被动使所持有 的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是单期货市场的特有风险之一、是指由于期货与现货间的价差的 波动、影响套期保值或套利效果,使之发生意料强的风险。流动性风险可分为两类,一类为流通量风险 指期货合约无法及时以所希望的价格键立或了结头寸的风险。此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致 的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

(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

等來的风险;
(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;

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。 第十七部分 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表决通过之日起生效。生效后方可执行,通过之 日起五个工作日内报中国证监会备案,生效之日起两个工作日内在指定媒介公告。 口起五个上作口内保中国证益会备案。在效之口起两个上作口内任指定规介公告。
二、《基金合同》的发址事由
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址的;
2.基金管理人、基本任管人承接处的;
3、《基金合同》生效后,连续60 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
5000万元人民币情形的、基金管理人应当终址《基金合同》,不需要召开基金份额持有人大会;
4 《基本会同》的定时 植地桂形。

4、《基金合同》约定的其他情形 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(3)对基金财产进行估值和变现;

名称:广发基金管理有限公司

成立日期・1996年2月7日

(7)其他意外导致的风险。

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。 47组中以代达2011至宋明5元等(1049)。
4.基金财产清算程序:
(1)《基金台同》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;

(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; 5、基金财产清算的期限为6个月,基金财产清算小组可根据清算的具体情况适当延长清算期限,并提前

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 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。

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

六、基金财产清算的公告 八·逸运》// ###5公日 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

第十八部分 基金合同的内容摘要

详见本基金管理人今日刊登的《广发安泰[资基金基金合同摘要》。 第十九部分 基金托管协议的内容摘要 、基金托管协议当事人 一)基金管理人

名称:) 及基金官理有限公司 注册地址:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼 邮政编码:510308 法定代表人:王志伟 成立日期:2003年8月5日

批准设立机关及批准设立文号:证监基金字[2003]91号

组形式:有限责任公司 经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

名称:中国民生银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号 法定代表人:洪崎

基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号组织形式:股份有限公司 注册资本:28,365,585,227元人民币 存续期间:持续经营 行李·州山:17岁-12日 经营范围,吸收公众存款;发放短期,中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现、发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;

至2017年02月18日);提供保管箱服务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务 一)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。 基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的,基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品 金並言问明明時,這些並以以外研究。 种他,以便走多托管人运用相关技术系统,对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。

从事结汇、售汇业务;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;保险兼业代理业务(有效期

板及其他经中国证监会核准上市的股票),权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债,央行票据,地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、 债券回购、银行存款、现金等)、国债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 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,可以将其纳人投

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

本基金为混合型基金,投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例不超过30%,债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债,央行票据,地方政府债,金融债,企业债、公司债、公股债、可转换债券,为离交易可转债,可交换债券,中小企业私募债,中期票据,短期融资券,超短期融资券,资产支持证券,债券回购,银行存款,现金等,占基金资产的比例不低于70%,其中每个交易日日终在扣 全国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人在履行适 (二)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

(1)股票等权益类资产占基金资产的比例不超过30%,债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发

行和上市交易的国债,央行票据,地方政府债。金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存 款、现金等)占基金资产的比例不低于70%; (2)每个交易日日终在扣除国债期货和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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
(3)本基金持有一家公司发行的证券,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)本基金产品企业主席企业的目录公司及10元分,包含20元分,10元分。 (5)本基金管理人管理的全部基金持有的同时交证,不得超过该权证的10%; (7)本基金在任何交易日买人权证的总金额,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

(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

(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个月为7分以全部实出。 (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;

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)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(16)本基金持有的全部中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(17)在任何交易目段,持有的实入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的05%,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(不合质明式问购)等,在任何交易目日各,持有的实人可能得免费的。权证,资产支持证券,买入返售金融资产(不合质明式问购)等,在任何交易目日各,持有的变更请任得各过基金资产净值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的在7最起过基金资产净值的20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的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%;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;

(18)在任何交易日日终,持有的买人国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;在任何交易日 日终、持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%,基金原持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买人、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;在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上

丁顷寿权负比例的月天约定;任任间交易日内交易(不包括平仓)的国愤期误合约的放交金额不停超过上一交易日基金资产净值的30%;
(19)基金总资产不得超过基金净资产的140%;
(20)法律法规及中国证监金规定的和(基金合同)约定的其他投资限制。
因证券、期货市场波动、上市公司合并、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。
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。在上述期间内、本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本批单人同日依为了由证据必

查自本基金合同生效之日起开始。 如法律法规或监管机构对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更或取消限制的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下,本基金可根据法律法规规定作出调整,不需召开基金份额持有

本基金在开始进行股指期货投资之前,应与基金托管人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投

资禁止行为进行监督。基金代管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资美止行为进行监督。 (四)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、 本基金這用的銀行间债券市场交易对手名单、并约定各交易对手所适用的交易结算方式、基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对于。基金托管人监督基金管理人是否按审前提供的银行间债券市场必要为于名单进行交易,并提醒管理人推销交易或重新确定交易方式、基金用人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行交易,并提醒管理人推销交易或重新确定交易方式、基金

每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行目尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算,如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手免收及转声方式,应及时向基金杆管人均即理由、协商解决。 基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而适成的纷纷及损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手不履行合同而适成的纷纷及损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手应差私任管人与基金管理人倾时的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金针管人事后发现基金管理人及存按照事先党定的交易对手或交易方式进行交易时,基金任管人应及时根据基金管理人、基金任管人不承担由此选取的任何损失和责任。 (五)基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,与基金托管银行签订风险控制补充协议。基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人投资流通受限证券进行监督。基金管理人投资流通受限证券,对重小根据中国证监会科关规定,明确基金投资还是限证券的比例,制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度,流动性风险处置预索以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。
1. 本基金投资的受职证券前对各中国证监会社准的在发行时确个定期限物定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时转牌的证券,已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受

包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受

包括由于发布重大消息或其他原因加临时导牌的业券。已发行未上市业券。10购交易中的质押券等流通受限证券。本基金升投资有锁定期但锁定期不明确的证券。 本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限公司负责登记和存管,并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。 本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下,基金管理人负责相关工作的落实和协调,并确保基金任管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题。造成基金任管人无法安全保管本基金资产的责任与损失,及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失,由基金管理人承担。 本基金投资受限证券、不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责。确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金观金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算。对本基金因投资受限证券导致的流 动性风险,基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人违反基金合同或预先确定的投资流通受限证券的 北例导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的,基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的 。 3. 本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定,在合理期限内未能进行及时调整,基金管理人

 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的,从其规定。 (六)基金管理人应当分投资中期票据必多进行研究。认真评估中期票据投资业务的风险。本着审慎、勤 勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定、制定了经公司董事 会批准的基金投资中期票据相关制度(以下简称"《制度》"),以规范对中期票据的投资决策流程、风险控

在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

应在两个工作日内编制临时报告书,予以公告。 4. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督:

1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况

制。基金管理人《制度》的内容与本协议不一致的,以本协议的约定为准。基金管理人应在基金首次投资中期票据前,与基金托管银行签订风险控制补充协议。 1. 基金投资中期票据应遵循以下投资限制。 (1)中期票据属于固定收益类证券,基金投资中期票据应符合法律、法规及《基金合同》中关于该基金投

近收益差证等的相关上例或期限限制。 (2)基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的10%。 2.基金托管人对基金管理人流动性风险处置的监督职责限于: 基金托管人对基金投资中期票据是否符合比例限制进行事后监督,如发现异常情况,应及时以书面形式通知基金管理人。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人接到通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查,督促基金管理 人改正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。 3. 如因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素、基金管理人投资的中 其据超过投资比例的、基金托管人有权要求基金管理人在10个交易日内将中期票据调整至规定的比例要

(七)本基金投资中小企业私募债券的应符合证监会《关于证券投资基金投资中小企业私募债券有关问 题的通知》等有关法律法规的规定。基金管理人应在基金首次投资中小企业私募债券前,基金托管银行签订风险控制补充协议。向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资中小企业私募债券的投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案、信用风险处置预案等。

通知后应及时核对并向基金托管人说明原因和解决措施。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查,督 通从间边及时依约于时途或九百人况的原因外解决自愿。签述九百人有权规则对则通知争项处门发重,首促基金管理人故正。基金管理人违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。如基金托管人没有切实履行监督职责(因基金管理人未就相应风险控制制度的修订及时通知基金托管人的除外),导致基金出现风险,基金托管人须承担连带责任。

个业私募债券超过投资比例的,基金托管人有权要求基金管理人在10个交易日内将中小企业私募债券 (八)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计 等、加収资金が高イルは指子がよけれる地が必定を基立自由に対しいる金がイトはバチ、金が加州を指 等、加収资金が、基金管用于支及収入确定、基金収益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金 业绩表现数据等进行监督和核查。 (九)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和 本托管协议的规定 应及时以由话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正 并及时向中国证监会 4代上海沙风的观点,远处时以电话或通知,1882年,于2018年至18年,1982

纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查。 督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告 日に一般である。 一日可正監会。 (十)基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执 行核查。对基金托管人发出的书面提示、基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项、基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,由此造成的损失由基金管理人承担,并及时向 加亚岛之际中。 (十二)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限 期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由、拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使 监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,

(十一) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关

三、基金管理人对基金托管人的业务核查 (一)基金管理人对基金托管人跟行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金 财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、根据基 金管理人指令办理清算交收。相关信息披露和监督基金投资运作等行为。 (二)基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟 执行基金管理人员金划拨行令、泄露基金投资信息等违反(基金法)、《基金台同)、本协议及其他有关规则时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日及时核对并以非 面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限

内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的

行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内容 (三)基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金托管人限期 纠正,并将纠正结果报告中国证监会,基金杆管人无正当理由,拒绝,阻挠对方根据本协议规定行便监督权,或采取拖延,欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的,基金管理

7.85至30/7 作目 一)基金财产保管的原则 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金财产的债权,不得与基金管理人、基金 托管人固有财产的债务相抵销,不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

人应报告中国证监会

四、基金财产保管

与本基金联名的证券账户。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财 3. 基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人依据合法程序作出的合法合规指令,基金托管人 自行运用、处分、分配基金的任何财产。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。 4. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户、确保基金财产的完整与独立。 基金托管人根据基金管理人的指令,按照基金合同和本协议的约定保管基金财产,如有特殊情况双 7. 对于因为基金投资产生的应收资产,应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金 托管人、到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行储收。由此 给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失,基金托管人对此不承担任

8. 除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

三),基金募集期间及募集资金的验资 基金募集期间应开立"基金募集专户",用于存放募集的资金。该账户由基金管理人开立。 基金募集期浦或基金停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合

《基金法》、《运作办法》等有关规定后、基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户,同时在规定时间内,聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字并加盖会计师事务所公章方为有效。 3. 若基金募集期限届满,未能达到基金合同生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜,基金

基金托管人应以本基金名义在其营业机构开立基金的银行账户,并根据基金管理人合法合规的指

2. 基金托官人应以本基金名义在其宫业机构开立基金的银行账户,开根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。
3. 基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户,亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。
4. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。
5. 在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。
(四)基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理
1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本基金开立基金托管人与本基金账名的证券账户

7-3年盛速吹石印证方塚下。 2. 基金证券帐户的开立和使用,仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方书面同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的