(上接B14版)

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算财产。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。

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

(二)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。

(三)估值对象 基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(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(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生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,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如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因素,调整最近交易市价,确定公允价格。 (2)交易所上市实行净价交易的债券按估值目收益价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变 化、按最近交易目的收益价值值。如最近交易日后经济环境灾生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化

因素、调整最近交易市价, 确定公允价格: (3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;

利息得到的净价进行估值。加坡过交易口后空的外观公正。 测整般正交易市价、确定公允的格。 (4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术 确定公价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。 2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理。 (1)送收 持續股。配股和公开增发的新股、按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以

(1) 透散、存電路、他欧州公介電及時間数、依田田口生世界×勿所に呼即時 & ボポロコロエリズ田ロエリズ ロステリカラ ルー日的市所 (収益) か (台信: (2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证、采用估值技术确定公允价值、在估值技术难以可靠计量公允价值的情况

(2) 首次公开设产未上市的股票、债券和权证、采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下、按成本估值。
(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
3. 全国银行间域等市场交易的债券、资产支柱市参等固定收益品种、采用估值技术确定公允价值。
4. 因持有股票而享有的配股权、采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。5.同一债券间时在两个或者两个以上市场交易的 技债券所还的市场分别估值。6. 本基本投资或特期债务约一,般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的、采用最近交易日结算价估值。
7. 如有确值证据表明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普人商定后、按量能反废处个价值的价格依估。

16.1 依據原区於公元071日前的「特合国」。 8.相关法律法规以及监管的「肯强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。 如基金管理」或基金社管人发现基金估值连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维护基金份额持有,系述制。它如随组取行,其间查到限因、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。本基金的基金会计责任方由基金管理

人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如些相关各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争值的计算结果对外予以公布。

1、基金份额净值是按照每个交易日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后 第位四音五人国家另有规定的,从其规定。 每个交易日计算基金资产净值发基金份额净值,并按规定公告。 2.基金管理人应每个交易日对基金资产估值,但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个交易日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个交易日对基金资产估值。所,基金管理人对外公布。 (4)让传统经验的处理。

(天) / hall 精彩的处理 基金管理人和基金任管人将采取必要、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 以内含第4位发生估值错误时,视为基金份额净值错误。 基金合同的当事人应按照以下约定处理:

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。过精的责任人应当对由于该信值错误遭受损失当事人("受损方")的直接损失按下述 "估值错 设处理规则"给予赔偿。并迅膨慢责任。
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。

上近日福阳6月12年交至185日21年7年7日,19月中刊62日3次到61年8日20日3年18日21日20日21年7日,12日72至18年9。 (1)估值错误处理原则 (1)估值错误产比多。19月1日,19月1

不对第二万位款。
(3)因估估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。但估值错误费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返还或"不全部返还不当得利造权其他当事人的和益损失""老机方"),则恰值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其文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交付不当得利的还的发现方,则受顺方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利逐还给受损方,则受顺方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利逐还的总 (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)根据估值错误发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)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误适成的报子进行更正称赔偿损失;

(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,并就估值错误的更正向

(1)基金份额争值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一 (2)错误偏差达到基金份额净值的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

(2) 错误编落达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通根基金托管人并报中国证监会备案;错误编笼达到基份额净值的0.35%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。 (七)暂停估值的情形 1.基金投资阶涉及的证券,则货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 2.因不可抗力或使基金管理人,基金托管人无法准确评估基金资产价值时; 3.占基金相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基金份额待有人的利益,已决定延迟估值; 4.出现基金管理人认为属于会导或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; 5.中国证监会相基金合同认定的其它情形。 (八)基金净值的确认

(八)基金净值的确认 用于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核。基金管理人应于 每个开放日交易结束信计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。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。

(九)特殊情形的处理 1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第7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.由于不可抗力,或证券、期货交易所、登记机构及存款银行发送的数据错误,或国家会计政策变更,市场规则变更等非 基金管理人与基金管管入原因,基金管理人和基金任管人直然已经采取必要,适当,合理的措施进行检查,但未能发现错误 的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金任官人实验赔偿费任。但基金管理人,基金社官人应当转来必要的

十二 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

左公元/JUILEX-0074.EELIH-201090 (二)基金可供分配利润指数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數低數。

(三)基金收益分配原则
1.在符合有关基金分组条件的前提下,本基金缩单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
间的25%, 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;
2.本基金收益分配5克万万两种。现金分量与1克利用投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按照除权除息日的基金份 使自立动物为基金份额投行再投资。若投资者不选举。本基金款比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水能低于面值;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 周F不能低于面值;
4.每一基金份额享有同等分配权;
5.法律法规或监管衔关另有规定的,从其规定。 (四)收益分配方案

(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

無力以上。 が大等内容。 (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、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。 (一)地方公本中均生的费用

(六)收益分配中发生的费用 基础收益分配中防发生的银行转帐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。不足于支付银行转帐或其他手续费用时,基金就记机内中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

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会计师费, 律师费, 仲裁费和诉讼费;

8、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

(二)基金费用计提方法; 计提标律和支付方式
1.基金管理人的管理费
本基金的管理费核前—日基金资产净值的1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下;
H=E×1.50%—当年天数
H为每日已计提的基金管理费
E为前—目的基金资产净值
基金管理费每日计据,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首
日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若固法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至
注定节假日、休息日结束之日起个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。
2.基金件管人放杆管费

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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下; H=E×2.5%、当年天数1分每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日

起今个工作目內从基金樹产中一次性支付给基金托管人、若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的。顺延至法 定节假日、休息日结束之日起全个工作印度、不可抗力情形;哪念己日起个工作日内支付 上述"(一)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,接费用实际支出金额列人当期费用,由

(三)不列人基金费用的项目 下列费用不列人基金费用:

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人基金费用的项目。

本基並定行以陸中沙皮的各時的上半。具明稅又多按国家形以法律、法稅採行。 (五)基金管理费和基金托管费的调整 基金管理人用基金托管人可報据基金規模等因素协商一致、酌情调低基金管理费率和基金托管费率、无需召开基金份额 「人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过,但法律法规要求提高该等报酬标准或费率的除外。

(一) 施靈云(以來). 1.基金管服/美本基金的基金会计所任方; 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个可以并入下一个会计年度; 3.基金核解以人民币为记账本位而;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.基金管理人基金件管人条自保留完整约会计账目,凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表; 7.基金任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。

、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

28%对抗核征[147]。 2.会计师事务所更换经功注册会计师,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

十五 基金的信息披露

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

金产品的特性等的支基金投资者重大利益的事项的法律文件。 金产品的特性等的支基金投资者重大利益的事项的法律文件。 (2)基金招募项用书应当最大积度地按赛影响基金投资者长策的全部事项,说明基金认购,申购和赎回安排。基金投资 金产品特性、风险揭示,信息披露及基金份特有人服务等内容。基金合同生发后,基金管理人在每6个月结束之日起45日 内,更新招募项用书并登载在网站上,将更新后的招募项用书确要容数在指定媒介上,基金管理人在公告的15日前向主要办

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。

3.基金合同生效公告 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日(若遇法定节假日指定报刊休刊,则顺延至法定节假日后首个出报 下周)在指定媒介上登载基金合同生效公告。
4.基金资产等值、基金份额等值

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中购或者额回后,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,按离开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。
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净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值。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,赎回价格的计算方式及有关申购,赎回费率,并保证投资者能够在基金价额发售网点查回或者复制的混合自资料。

6.基金定期报告,但括基金年度报告,基金半年度报告和基金季度报告,并将平度报告正文登载于网站上,将年度报告接要登载在指定媒介上。基金管理人应当在每年结束之日起60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,将年度报告接要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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指定媒介上。

鑑验自建入应当证单,于成后来之口配引、工厅口守、珊瑚江地感避于及下口、厅中子及下口是城口自是城口上。 基金合同生效不足少月的、基金管理人可以不编制当期率度报告、半年度报告或者年度报告 基金定期报告在公开披露的第个工作口、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日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会

和基金管理人主要办公场所作让他的中国证益会抵出机场客。 前政师东重大事件、是指可能对基金价级制度的主要证益会最近机构路客。 前政师东重大事件、是指可能对基金价额持有人权益或者基金价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;

3.74宋盛逝后17.70; 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.)基金管理人股东及其出资比例发生变更;

(6)基金管理人股东及其出资比例发生变更;
(7)基金祭集制班长;
(8)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生变动;
(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、基金托管社会工作,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)涉及基金财产、基金管理头、基金托管心旁的诉讼或者仲裁;
(12)基金管理人、基金杆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处罚,基金托管人及其基金托管部门负受到严重行政处罚。

(15)基金收益分配事项; (16)基金管理费、基金托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

(17)基金份额净值估值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)本基金开始办理申购、赎回; (22)本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更; 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;

(27)中国证监会规定的其他事项

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,并将有关情况立即报告中国证监会。 大及项即,相关信息收益 关于人和磁和型 工品中公司 以10.0000 1.2 4人,10.000 9. 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,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。 10.中国证监会规定的其他信息 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)等文件中披露股指期货交易情况 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。

和投资目标。 基金管理人应在基金年报及半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

基金管理人业任政家上和区人工工作。 期內所有的资产支持证券明细。 (六)信息披露事务管理 基金管理人,基金托管人员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定。 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 物净值,基金份器申购赎回价格,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 Δ本年 11 山目北面文件或者盖章确认。

每时间、透过的细中的影响也们在这些大型的目的是对实现的目录。2017年至7月发展的对于大型企业自显过11发标。中直,并问题会管理人出具书面立件或者盖章输入。 基金管理人、基金托管人应当在指定媒介上披露信息的报刊。 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

(七)信息披露文件的存放与查阅

(七)信息披露文件的存款与查阅 据察说明书公布后。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、复制。 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) 暂停或起迟披露基金信息的情形。 1.基金投资所涉及何证差,则恢交易所遇法定市假日或因其他原因暂停营业时; 2.因不可抗力或其他情形致使基金管理人基金任管人无法准确评估基金资产价值时; 3.占基金相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基金份额持有人的利益。已决定延迟估值; 4.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; 5.法律法规规定。中国证监会或基金合同认定的其他情形。

· 恬投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险、本基金特有的风险和其它风险。

本基金的投资风险包括投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险、本基金特有的风险和其它风险。 (一)投资组合的风险 投资组合不成主要包括系统性风险、非系统性风险以及流动性风险。 1.系统性风险 证券市场价格因受各种影响市场整体的因素如经济因素、政治因素、投资心理和交易监管制度等的影响而引起波动,从 而导致基础收益水平变化、健本基金资产而随的风险。主要包括: (1)政策风险、货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化导致证券市场价格波动,影响基金收益而产生

八四號:
(2) 经济周期风险:经济运行具有周期性的特点,证券市场的收益水平受到宏观经济运行状况的影响,也呈现周期性变化,基金投资于债券与上市公司的股票,收益水平也会施定发生变化、从而产生风险;
(3) 利率取免。金融市场海中的波克含等更迟累市场及货券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券,收益水平会受到利率变化的影响,从而产生风险;

(4)购买力风险:基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配,如果发生通货膨胀,现金的购买力会下降,从而影响基

非系统性风险是指单个证券特有的风险。包括企业的信用风险、经营风险、财务风险等。上市公司的经营状况受到多种因素影响,如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等、都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资股票和债券的发行人经营不善、导致其股票价格下跌、股息、红利减少,或者存在所投资的企业债券发行人无法 按时偿付本息,从而使基金投资收益下降。

3、而必用以内容。 流动性风险是指因市场交易量不足,导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险,或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的连约风险。本基金是开放式基金 基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断变化。基金投资人的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现,而导致基金的投资组合流动性不足;或者投资组合持有的证 寿由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低,造成基金资产变现的损失,从而产生流动性风险。 基金的管理风险主要包括两个方面:一是在基金管理运作过程中,基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等,会影响

基金的台建四域包括以下几种共体风险: 1、交易风险 由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通,交易指令的执行产生偏差或错误;或者由于故意或重大过 能及时准确执行交易指令,事后也未能及时通知相关人员或部门;或者银行间债券市场交易对手未能履约导致基金利益

的直接损失。 2.系统故障风险 当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况、可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记 系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

在基金的投资交易中,因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失 会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误,通常是指基金管理人在计算、整理、制

证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中,由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失,从而对基金收益造成影响的 投资合规性风险是指因公司及员工违反法律法规、行业准则、职业操守和职业道德而可能引起法律制裁、重大财务损失

或者声誉损失的风险,主要合规风险包括如下具体风险

法律风险是指基金管理人违反法律法规、基金合同从而给基金份额持有人利益带来损失的风险。 首德风险是指员工违背职业道德, 注规和公司制度, 通过内墓信息, 利用工作程序中的凝漏或其他不注手的谋取不正当

(四)本基金特有的风险 (空)本基金粹有的以除 本基金采用特定的量化投资模型进行个股超额收益的预测,组合构建和调整、交易成本和风险控制,因此本基金投资过 程中的多个环节将依赖于投资模型,从而导致本基金所面临的模型风险高于传统混合型基金。 此外,本基金可投资工股指期货,股指期货是一种社会股票指数的金融行生工具,带有一定的投资杠杆,可放大指数的损益;同时,股指附价进行反向资空交易,因此,投投资风险高于传统证券。本基金将以套期保值为目的,严格遵守法律法规规定和基金合同约定的投资比例,控制股指期货的投资风险。

(一)基金合同的变更 。变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的。应召开基金份额持着 会决议通过。对于可不经基金份额特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,并取中

二)基金合同的终止事由 下列情形之一的,经履行适当程序后,基金合同应当终止:

、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;

、基金合同约定的其他情形: 、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

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 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 即可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

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;

(3)对基金财产进行估值和变现; (4)制作清源报告; (5)聘请会计师事务所对清源报告进行外部审计,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)对基金确宗财产进行分配。 5.基金财产清算的期限为个月。 (四)清算费用 清算费用是相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 冷财产中多价。

逐列34901产12月3。 (五)基金副余财产的分配 依据基金财产清算的分配方案,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。

清寫过程中的有关重大事項须及时公告;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

(七)基金财产清算账册及文件的保存

青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)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

、基金份额持有人的权利 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定、基金份额持有人的权利包括但不限于:

(2)参与分配清算后的剩余基金财产 (3)依法申捐赎回具符有的基金协测: (4)按照规定或召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会; (5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权; 6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(8)对基金管理人、基金杆管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁; (9)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。 及中国证益云河电产业27、1956年1977年 有人的义务 》、《运作功法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

2.基金份額特有人的又多 根据(基金法)、(运作办法)及其他有关规定,基金份额特有人的义务包 (1)认真阅读并遵守基金合同; (2)了解所投资基金产品, J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,及时行便权利和履行义务; (4)缴纳基金人限。申晚款项及法律法规和基金合同所规定的费用。 (5) 方生基金形本 公场签据则。 (5)在其持有的基金份额范围內,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等,合法权益的活动; (7)协会共始的社会的经验检查自己与公司

(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利 (9)遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则; (10)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。

(3)依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)按照规定召集基金价额特有人大会:
(6)依据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,应量报中 正盈全和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更知非,据名额的基金托管人;
(8)选择,更接基金销售制机,对基金销售制机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多并获得基金合同规定的费用;
(10)依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(11)在基金合同效宜的范围内,拒绝或暂停受理申则 规固和排税申请;
(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

(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,融券及转融通业务; (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应者实施其他法律行为; (15)选择,现验纳铜事务所,全计师事务所,证券经金值或某他为基金健保服务的外部机构; (16)在符合有关法律,法规的前据下,制订和调整有关基金认购,申购、赎回、转换、非交易过户,转托管和定期定额投资

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。

4.基金管理人的义务 推握《基金注》、《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。 (1)依法察集基金。为理观者委托绘中国证监会认定的其他机构代步办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(1)依在姊果愈愈。沙理或看委托全中国加监会公人定时其他机构了为少建愈位的侧方套,中则,则即利益比争宜; (2)均更基金偷塞手续; (3)自基金台阁生校之日起,以诚实信用,谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产; (4)配各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)除依据《基金法》、基金台阳发地信号关照定外、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

(6)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,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法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决购,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货产净值,确定基金份额申购,赎回的价格;
(9)进行基金会计核赛并编制基金财务会计报告;
(10)端制率度、半年度和年度基金报告;
(11)严格股限(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边下降密、不和仓人泄露;
(13)按基金合同的疗度可能基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按据定受理申购与赎回申请,及时、足额文付赎回款项;
(15)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人分配基金收益;

(15)]张照《基宽比4.6%在19426年

全管理人应为基金的银持有人种应用基金行管人追馈; (22)当基金管理人是从各联大等大程三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任; (23)以基金管理人名以代表基金价键特有人对起行管试论权利或支贴其他选律行为。 (24)基金管理人名以代表基金价值特有人对起行管试论权利或支贴其他选律行为。 (24)基金管理人在英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

金并加计量行即将专款机息在基金豪集即结束后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。 5.基金托管人的权利
根据(基金法)、(运作办法)及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于;
(1)自基金合同生农之日起,依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;
(2)依基金合同均定获得基金托管党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,加安基金管理人有违定基金合同及国家法律法规行为,对基金财产,其他
事人的利益造成重大组集的情形。有权显报中国证监全,并可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,为基金办理证券交易资金清算;
(5)提议召开或召集基金份副待有人大会;
(6)在基金管理人更独归,据名额的基金管理人;
(6)在基金管理人更知,据名额的基金管理人;
(6)在基金管理人更知,据名额的基金管理人;
(6)在基金管理人更知,据名额的基金管理人;
(6)在基金管理人的义务。
(6)在基金管理人的义务。
(6)在基金管理人的义务。
(6)在基金管理人的义务包括但不限于;
(1)以诚实信用。勤勉尽责的服则持有并安全保管基金财产。

別广江官事且:
(3)建立健企内部风险控制,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、资金划败、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、证券账户和投资所需的其他账户,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、交制事宜;

他人避緊。
(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) 办理与基金任管业务活动有关价信息披露事项;
(10) 对基金储务会计程信。考度,半年度单中度基金根告出具意见,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) 保存基金社管业务活态的记录,账册,报表和其他相关资料15年以上;
(12) 建业计保存基金份额特有人名册;
(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
(14) 依据基金管理人相关或者是实现核对;
(15) 依据基金管理人的专家有关规定,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) 依据基金管理人的协定或者关键定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人,基金份额持有人大会;
(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) 而证额解析。依法按据的成或者被决定分配,企业现分形定;
(19) 因违压基金合同导致基金财产损失时,应承担赔偿责任、其赔偿责任不因其违任而免除;
(20) 按键定监督基金管理人结准法提取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,应承基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
(21) 执行重效的基金份额特有人大会的决议;
(22) 法律年规股中国证金规定的和基金合同等企业的企业分别。
(22) 法律年规股中国证金全规定的和基金管理人追偿;
(21) 指示性表规及中国证金规定的和基金合同的定的其他义务。
(二) 基金份额持有人人会召集、汉事及基决的程序和规则。
(22) 法律年规股中国证金全理人对策会各层的资产的其他义务。
(二) 基金份额持有人大会召集、汉事及基决的程序和规则

(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;

1、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)基金托管入认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面 据议之日起10日次定是否召解,并节由告诉退金托管人,基金管理人决定任税的。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,基金托管人仍认为有必要召开的。应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召

开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。 一人举业自建入,委员自注入应当配合。 (4)代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理 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,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表 印基金托管人。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 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管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具

书商决定之日起60日内召开。
(5)代基金份额的以上(含10%)的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%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日根中国证 监会条案,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。
2.召开基金份额持有人大会的通知时间,通知均容,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,在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少裁明以下均然。

(1)台州基金財御时用八八天,口采八匹,公元八匹。 (1)会议召开的时间,地点和会议形式; 2)会议报审议的事项,这事程序和表决方式; 3)有权出账基金份额持有人失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)采收额出开全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,书面表决意见考交的截止时间和收取方式。 (3)如召集人为基金管理人等处。这些另个专面通知基金行客人到指定地点对表总意见的计票进行监督。如召集人为基金托 信人则应另行下面通知基金管理人到指定也对表决意见的计票进行监督。如召集人为基金托 管理人有基金柱管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人成基金份额持有人则仍有行市面通知基金管理人有基金社管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人成基金化管人到指定地点对表决意见的计算进行监督。基金管理人或基金任管人到指定地点对表决意见的计算进行监督。基金管理人或基金任管人到指定地点对表决意见的计算进行监督。基金管理人或基金任管人到指定地点对表决意见的计算进行监督。基金管理人或基金任管人到指定地点对表决意见的计算进行监督。基金管理人或基金任管人到指定地点对表决意见的计算进行监督。基金管理人或基金任管人到指定地点对表决意见的计算进行监督。

(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,基金管理人或托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会 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,汇总到会者出示的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

3) 若到全者在权益登记日所持有的有效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

, 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50%(含50%); 4)若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额帐于上述规定比例的,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召集。 开时间的三个月以后、六个月以内。就既定时议事项重新召集法金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会,到会者 所持有的有效基金份额应不少于在重新确定的权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一); 5)上述第3)、4)项中直接出具中面意见的基金份额持有,成变活代表他人出具中面意见的代理人,同时提交的持有基

金份额的凭证、受托出具书面宽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; (3)在不与法律法规冲突的前提下,基金份额持有人大会可通讨网络、电话或其他方式召开,基金份额持有人可以采用 书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式进行表决,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。 (4)基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,授权方式可以采用书面、网络、电话或其他监管机构允许的方式,

(1)议事内容及提案权 为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

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

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6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,并形成大会块以、大会主持人为基金管理人授权比席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情 况下,由基金柱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柱管人授权代表均未能主持大会,则由租 依关给总基金份额持有人所谓。从所持表块权的500以上(含800),这举产些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块议的效

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 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。

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庆议分为一般庆议和特别庆议;
(1)—般庆议、一般庆议、和庆议、任业人的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;除下列第(2)到纳建定的领以特种庆议通过事现以外的其他事项均以一般庆议的方式通过。
(2)特别庆议、特别庆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、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。 \$\$\$\$\times\

基金管理人授权代表)的监督下进行计票,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。

(三)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1.基验官自时变要 (1)变更基金合同涉及法律法规规定或基金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 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 证监会各案。

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须报中国证监会备案,并自决议生效后2日内在指定媒介公告。 2.基金合同的终止事由 有下列情形之一的,怎履行适当程序后,基金合同应当终止; (1)基金份额持令人大会决定终止的; (2)基金管理人,基金任管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的; (3)社会与部份生物好物时被

(2) 基金自强介、维索比目人内似乎。(北61个河内设有新维金自强人、新维金打自人外依明);
(3)基金自营为论的技术情况。
3.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存在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给指定的人员组成,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排作必要的国际虽活动。

(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)对基金剩余财产进行分配。 (5)基金财产洁算的期限为6个月。 4、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

網索財产中交付。
3.基金財产清算剩余资产的分配
依据基金财产清算的分配方案,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 后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。
6.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;基金财产清算报告报会会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报 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3个工作日内由基金财产清算小组进行

。 7、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。 金級別广信辦學研及科大文件出途號在日八年行日中以上。 (四)争议線決方式 各方当事人同意,因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议,如经一方提出协商解决争议之日起60日内争议未 能以协商方式解决的,应提交中国国际经济贸易中裁委员会按照当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京、仲裁裁决 是终局的,对仲裁各方当事人与具有约束力,仲裁费和律师费由破诈方承担。 争议处理期间,各方当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉,尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额特有人 价合计和24

基金合同可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

十九 基金托管协议的内容摘要 (一)托管协议当事人 1、基金管理人 名称:华泰柏瑞基金基金管理有限公司 在於:十零市/中國海遊遊遊遊遊遊遊遊遊遊遊遊遊遊遊遊 住所:上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号17层(200135) 法定代表,: 齐亮 成立时间:2004年11月18日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字【2004】178号 至营范围:发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

联系人:赵会军 批准设立机关和设立文号:国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号)

(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

定)。

特基金参与融资融资和转融通业多的相关规定颁布后、基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征 并在控制风险的崩境下,经与基金任管人协商一致后。参与融资服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。届时基金参与融资服券。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宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求按行、无需召开基金份额持有人大会审议。
2)基金任管人根据有方法律法规的规定及(基金合同)的约定,不基金投融资比例进行监督: 1. 按法律法规的规定及(基金合同)的约定,本基金的投资资产配置比例为; 本基金股票资产的投资化内基金资产净值的5%。 因基金规模或市场变化等因素等安设资组合不符合上法规定的,基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合、以 符合;1岁化则原定;法律法律具有银密计人连接原。

:上述比例限定。法律法规另有规定时,从其规定。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳人投资范围,并可依

a、本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%; b、在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值

3.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、通讯开会方式及法律法规、中国证监会允许的其他方式召开、会议的召开方 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货会约的成交金额不得招付上一交易日基金资产净值的20%; 、基金总资产不得超过基金净资产的140%

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。并按照审慎的风险控制原则有 该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人 应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新,名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人,基金托管人于2个工作日内回函确认收到后,对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后,被 确认调整的名单开始生效,新名单生效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

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提

7)基金托管人对基金投资流通受限证券的监督 7)基金社官人对选金投资流通受限证券。应遵守(关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券。有关问题的通知)等有关法律法规规定。 II.流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行 时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易

(3)基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时,应及 以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发

经营范围: 埃起设立基金. 基金管理及中国证监会 存续期间,持续经营 电话: (021)38601777 传真: (021)50103016 联系人,陈龄 2. 基金任管人 名称: 中国工商银行股份有限公司 住所: 北京市西越区复兴门内大街55号(100032) 法定代表人,姜迪青 电话: (010)6015799

行实期间:1798年曾 经营范围:办理人民币存款、贷款、同业拆借业务;国内外结算;办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务;代理资金清

c、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

n、本基金进入全国银行即间建口+例以1,以7万元2777人。 券回购到期后不得展期; 。一只基金特有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之一;一只基金特有的所有流通受 限证券,其市值不得超过基基金资产净值的百分之十;经基金管理人和托管人协商。可以以上比例进行调整; p、本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约的值,不得超过基金资产净值的10%。 q、本基金在任何交易日日终,持有的买入则货合约价值与有价证券市位之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价 "工业长"用册(任他)了企业制即口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;

总页厂个符起20基金建页厂的140%; 维法规对上述投资比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。加法维法规或监管部门取消上述限制。加活用于 本基金,基金管理人在履行活当程序后,则本基金投资不再受相关限制

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下,至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动 69年日 6年八年江田中7月87年以 / 60度人而要公司刊日7、下主少规则27 上下日止八円基金托官人交货权公司应对特施。便于长管人实施交易监督 Ⅳ 本基金可以按照国家的有关规定进行监资器券及转融通。 3)基金杆管人服有者关注律法规的规定及 《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督;根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金禁止从事下列行为;

易必须事先得到接金任管人同意。符合中国正监会的规定,并履行信息披露义务。 3)基金任信人依据有关法律法规的规定和(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。 基金任信人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手党信风险控制措施进行监督。

 Π .基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,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流通受

规规定或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。 对于必须于招信完成后方可获的监控指标或依据交易随时汇经成交的投资指令。基金托管人发现该投资指令违反法 律法规或者追攻 【基金合同》实验的,通当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

II. 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金投资组合遵循以下投资限制;

(本基金特有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%; d.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金特有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%; d.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有的10%; f.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%; g.本基金在任何交易目束人权证的总金做,不得超过一次多月出金资产净值的30%; h.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%; i.本基金持有的信一信用级则资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%; i.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各资产产营产营产营产营产,使原则01%; k.本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各资资产产营产营产,增加资的10%; l.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。

n、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%;债券回购最长期限为1年,债

r、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%; s、本基金所持有的股票市值和买人、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

资资产配置外,基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。 3. Tim券、期货市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比 不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规

II.违反规定问他人营资或提供担保;
II.从事可能性基金承担无限费样在的投资;
IV.向基金管理人、基金托管人出资;
IV.向基金管理人、基金托管人出资;
如法律法规或监管部厂取消上达禁止性规定、基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。
4)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 或养鲜即仍承销的证券。或者从事让他重大关联交易的、应当遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,相关交 经营业务规划的人经营、目录。公人中国汇证及人种国主义

出回函。就基金托管人的合理账义进行解释或举证。 在职期内基金托管人有权随时刘维知事项进行复查。督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的连规事项 未能在规期内进印。基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反(基金合同)而致使 对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反关法律法

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;

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。相关法律法规关 于信息披露的规定发生变化时,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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应于披露的基金信息通过中国证监会指定的姚介(以下简称 "定媒介")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)本基金信息披露义务人寿诺公开披露的基金信息,不得有下列行为: 1.虚假记载,读导性陈述或者重大遗漏; 2.对证券投资业绩准行预测;

公开披露的基金信息包括。 1.基金绍敦说明书、基金合同、基金托管协议 (1)基金信息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,说用基

基金募集申请在中国证监会注册后,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

3. 违规承诺收益或者承担损失;
4. 诋毁其他基金管理人,基金托管人或者基金销售机构;
5. 登载任何自然人,甚人或者其他组织的较微性,恭维性或推荐性的文字;
6. 中国证监会整, 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数。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。
本基金公开披露的信息采用时拉伯数字,除特别说明外,货币单位为人民币元。
(五) 公开披露的信息采用时拉伯数字,除特别说明外,货币单位为人民币元。

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说明。 (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、义务关系的法律

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:

(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

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

7.主从一名日 基金价额持有人大会的决议自表决通过之日起生效.召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。 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介上公告。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