

Disclosure 信息披露

2016年6月1日 星期三
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B16

(上接B15版)

第二部分 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。

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和基金份额为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数量乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全部基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代表的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，须先书面联接基金基金合同约定的召开联接基金的基金份额持有人大会。联接基金的基金份额持有人大会决议提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会。本基金联接基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

- 召开事由
- 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、基金合同、中国证监会另有规定的除外：
 - 修改《基金合同》；
 - 更换基金管理人；
 - 更换基金托管人；
 - 转换基金运作方式；
 - 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
 - 变更基金类别；
 - 本基金与其他基金的合并；
 - 变更基金投资目标、范围或策略；
 - 变更基金份额持有人大会程序；
 - 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形；
 - 修改基金合同关于基金管理人要求召开基金份额持有人大会；
 - 修改基金合同关于基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则；
 - 对基金份额持有人权利和义务产生重大影响的其他事项；
 - 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他方式召开基金份额持有人大会的事项。
- 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：
 - 调低基金管理费、基金托管费和由基金申购费产生的费用；
 - 法律法规要求增加的基金费用的收取；
 - 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整与基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下调整本基金的申购费、赎回费率等费率或变更收费方式；
 - 在不违反法律法规规定和《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情况下，增加、减少基金份额类别定义、变更收费方式；
 - 因对标的资产的法律发生变动而应当对《基金合同》进行修订；
 - 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；
 - 在不违反法律法规规定和《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情况下，基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、基金交易、非交易过户、定期定额投资业务规则；
 - 在不违反法律法规规定和《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情况下，本基金新增或取消服务措施；
 - 在不违反法律法规的情况下，调整基金份额的申购赎回方式或申购计价、赎回计价规则；
 - 在不违反法律法规的情况下，调整基金份额净值，申购赎回价格的计算和公告的时间和频率；
- 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其他情形。

- 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。
- 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。
- 基金管理人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。基金管理人应当就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，基金托管人认为有必要召集的，应当向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。
- 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管理人。基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。
- 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，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日报中国证监会备案。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。
- 基金份额持有人会议的召集人负贵选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三、召开基金份额持有人大会的会议通知、通讯方式

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载明以下内容：

- 会议召开的日期、地点和会议形式；
- 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 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；
- 授权委托证明的内容要求（包括但不限干代理人身份、授权范围和有效期限等），送达时间和地点；
- 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 召集人需要通知的其他事项。

2.采取通讯开会方式并征集表决的情况下，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、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配合代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

四、基金份额持有人大会的召开方式

- 基金份额持有人大会可通过现场开会、通讯开会或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由召集人确定。
- 现场开会。由基金份额持有人本人出席或由代理人代表出席并由授权代表出席。现场开会时基金管理人和基金托管人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未派代表列席的，不影响开会效力。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会议：
 - 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持有基金份额的凭证及授权人的代理授权委托书经公证机关公证、《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；
 - 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总份额的二分之一（含二分之一）；若基金份额持有人提交代理他人代表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，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，就原定召集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在权益登记日的基金份额不少于本基金在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）。
- 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或大会公告载明的其他方式进行表决并在权益登记日送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面形式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 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；
- 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），由基金管理人授权代表负责召集基金份额持有人大会，并由基金托管人授权代表负责监督《信息披露管理办法》规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金管理人或基金托管人无正当理由未接收表决意见的，不影响计票效力；
- 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金份额的二分之一，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，就原定召集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在权益登记日的基金份额不少于本基金在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）。
- 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或大会公告载明的其他方式进行表决并在权益登记日送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面形式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件下，通讯开会的方式视为有效：

- 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；
- 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），由基金管理人授权代表负责召集基金份额持有人大会，并由基金托管人授权代表负责监督《信息披露管理办法》规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金管理人或基金托管人无正当理由未接收表决意见的，不影响计票效力；
- 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金份额的二分之一，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，就原定召集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在权益登记日的基金份额不少于本基金在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）。

5.议事程序及提案权

议事程序内容主要涉及基金份额持有人的重大利益事项，如《基金合同》的重大修改、终止续会、基金合同更换基金管理人、更换基金托管人、与本基金基金合并、法律法规规定和《基金合同》约定的其他事项以及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终止公告。

- 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议题内容进行表决。
- 议事程序
- 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基金份额持有人，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，则由出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权三分之二（含三分之二）以上（含三分之二）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。

五、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。

基金份额持有人所持的每一基金份额享有一票表决权。

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。

- 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）通过方做出。除《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，除非有计票方面的相反证据，否则按符合会议通知中规定的确认投资者身份的方式进行有效表决；有效的表决意见、投票截止时间以公告为准。重要事项须有三分之二以上同意并经书面确认投票有效。监事应当进行重新清点，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。
- 计票
- 现场开会

1. 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前宣布出席大会的基金份额持有人和代理人、自行召集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；大会由基金份额持有人自行召集或虽由基金管理人、基金托管人召集，但基金管理人、基金托管人不出席大会的，基金份额持有人大会的召集人应当在会议召开后宣布出席大会的基金份额持有人和召集人姓名及其在大会中担任的角色。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 计票规则

4.1 计票规则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（若由召集人召集，则为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不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决效力。

基金份额持有人大会的决议自公告之日起生效，召集人应于公告通过之日起3日内向中国证监会备案。

基金份额持有人大会决议自生效之日起按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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前，必须将公证证书全文、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，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容取消或变更的，基金管理人经与基金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。

第三部分 基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

- 《基金合同》的变更
- 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同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。对于法律法规规定或基金合同约定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。
- 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须经中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
- 《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：
 - 基金份额持有人大会决定终止的；
 - 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。

三、基金财产清算小组

- 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。
- 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组由基金管理人、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其他人员组成。基金财产清算小组可以聘请必要的工作人员。
- 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。
- 基金财产清算程序：
 - 《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；
 - 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
 - 对基金财产进行估值和变现；
 - 制作清算报告；
 - 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；
 - 将清算报告报中国证监会备案并公告；
 - 对基金剩余财产进行分配；

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。

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。

第四部分 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会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，对各方当事人均有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理规则，基金合同当事人应恪守各自的职责，忠实履行义务，勤勉尽责地履行基金合同约定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》由中国法律管辖。

第五部分 基金合同存放处和投资者取得基金合同的方式

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。

附件二：托管协议主要内容

一、基金管理人

基金管理人：中国建设银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层

邮政编码：200120

法定代表人：朱鹤军

成立日期：1998年6月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.15亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

二、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京西城区西便门大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册地：北京

注册资本：贰仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外汇兑、理财和托管业务；与财政、金融、证券、信托、保险、期货、征信、资产管理、证券投资基金、代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国证监会核准的其他业务。

三、基金合同当事人对基金托管人的业务资格和核查

《基金合同》当事人应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》当事人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的要求，以格式化和电子化的形式向对方提供基金投资范围、投资对象及投资限制的书面材料，并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，存在不符的情况应及时核查。

本基金的投资范围如：
本基金将投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行并上市的股票、权证、股指期货、国债期货、其他股票、股指期货、创业板及其他中国证监会核准上市的交易品种，股指期货、国债期货、融资融券、银行承兑、中期票据、企业债、次级债、地方政府债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购、银行存款等，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。

本基金将严格遵守法律法规的规定参与融资融券及转融通证券出借业务。

如法律法规监管部门以后允许基金投资其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，投资于创业板50指数成份股及其备选股的比例不低于非现金基金资产的80%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的相关规定执行。

如果法律法规或监管部门以后有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会相应调整。

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，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人按下列比例限制基金投资监督：

- 组合限制

- 本基金投资组合应遵循以下限制：
 - 01 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，投资标的的构成股和债造成的股的比例不低于非现金基金资产的80%；
 - 02 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%；
 - 03 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%；
 - 04 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%；
 - 05 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%；
 - 06 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%；
 - 07 本基金持有的同一指向一信用等级资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
 - 08 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，不得超过其各类资产支持证券规模的10%；
 - 09 本基金投资于同一信用评级级别为BBB（以上含BBB）的资产支持证券，基金投资于资产支持证券总额，如其信用等级下降，不再符合投资比例，应在评级报告发布之日起3个工作日内全部卖出；
 - 10 本基金参与与股票发行申购，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；

01 本基金在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%；本基金在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

02 本基金仅在投资股指期货时遵守下列要求：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100%，其中，任何一日债券股票、债券（不含国债期货、债券（不含国债期货）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；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%；在任何交易日内交易买入的不含国债期货的股指期货合约成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；在任何交易日日终在股指期货合约持仓限额和交易保证金总额方面，应当保持不低于交易保证金一倍的余额；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；

03 本基金资产不得有参与中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%；

04 本基金总资产不得超过基金资产净值的140%；

05 本基金在任何交易日日终，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金；

06 本基金在参与融资融券交易时遵守下列要求：本基金参与转融通证券出借业务，在任何交易日日终，参与转融通出借交易的余额不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照加权平均计算；

07 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的8%；

08 法律法规和中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

三、基金合同当事人对基金托管人的业务资格和核查

《基金合同》当事人应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中严格遵守基金合同约定的投资品种和交易标准，谨慎选择投资标的，进行充分的投资前尽职调查，并自觉履行信息披露义务。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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。期间，本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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，对本基金协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督事宜如下：
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他重大利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时，应当符合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的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

（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中严格遵守基金合同约定的投资品种和交易标准，谨慎选择投资标的，进行充分的投资前尽职调查，并自觉履行信息披露义务。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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。期间，本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

五、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本基金协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督事宜如下：
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他重大利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时，应当符合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的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

（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中严格遵守基金合同约定的投资品种和交易标准，谨慎选择投资标的，进行充分的投资前尽职调查，并自觉履行信息披露义务。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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。期间，本基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

易时在基金管理人及基金管理人确定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。基金托管人则根据基金资产净值变动情况对合同跟踪履行情况进行监督。如基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手交易方式进行交易管理时，基金管理人应及时通知基金管理人，基金管理人不予承担由此造成的任何损失和责任。

（五）基金管理人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金基金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，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，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、法律风险和合规风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关规定、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行证券、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，不包括用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限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通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负责登记存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金管理人能够充分审查清楚。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金的资产与损失，及因流通受限证券登记存管直接导致本基金安全基金的责任及损失，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. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会审批。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要调整的基金投资组合限制条款、基金流动性风险以及相关损失的应对解决措施，以及有关风险控制的处置。基金管理人应在每次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人应对基金投资流通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流动性风险。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现金流出现紧张时，基金管理人应保证提供足额流动性确保基金的投资结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金管理人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现流动性风险致使基金托管人承担连带清偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资受限证券，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证所提供基金资产数据真实、准确、完整，有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 01 中国证监会批准发行非公开发行的批准文件；
- 02 中国证监会发行有关发行公告、发行价格、锁定期等发行资料；
- 03 非公开发行股票发行人与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签订的证券登记结算协议；
- 04 基金托管人提供的银行、中国结算、账面资料；
- 05 基金管理人和本基金投资非公开发行股票前三个交易日内，在中国证监会指定信息披露网站非公开发行股票的公告名称、数量、总额、期间等信息，以及总成本账面价值和基金资产净值的比例、锁定期等信息。

基金有效投资流通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，基金管理人应在每个工作日内编制限制报告予以公告。

5.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. 对基金投资流通受限证券的事时法律法规遵守情况；

2. 在基金投资流通受限证券的工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况；

3. 有关信息披露的情况；

6.相关法律法规对基金投资受限证券有更新的，从其规定。

（六）基金托管人对中小企业私募债券，基金管理人应根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

基金托管人对基金托管人中小企业私募债券是否符合同内限制进行监督，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基金托管人的监督和核查。基金投资中小企业私募债券导致的信用风险、流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致基金出现损失或基金托管人承担连带清偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

（七）基金管理人应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、基金份额净值计算、应收投资到账数据、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、基金份额信息披露、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复核。

（八）基金管理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约定，应及时以电话通知或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向基金托管人发出纠正通知。基金管理人对基金托管人的通知持有异议时，应及时说明原因和纠正期限。在上述规定期限内，基金管理人有义务对相关事项进行解释，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人的通知持有异议时，应及时向中国证监会备案。基金管理人应向基金托管人提供纠正违规行为的专项说明。基金管理人应依据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收投资到账数据、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、基金份额信息披露、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复核。

（九）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、行政法规及其他有关规定的，或者在基金合同约定的，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。

（十）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并及时向监管机构报告中国证监会。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，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金托管人有权报告中国证监会。

第三部分 基金管理人对于基金托管人的业务监督

（一）基金管理人对于基金托管人履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、开设基金财产的基金账户、证券账户及交易所资金账户，复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，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资产运作等事宜。

（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别管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拔指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定的行为，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及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定的期限内改正，并承担相应责任。基金管理人有权不时对违规行为进行复核，督促基金管理人改正。基金管理人应向基金托管人提供纠正违规行为的专项说明。

（三）基金管理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，同时通知基金托管人限期纠正，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，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金托管人有权报告中国证监会。

第四部分 基金财产的保管

（一）基金财产的保管

- 1.基金财产应存放在基金管理人、基金托管人的固有财产中；
- 2.基金财产的安全保管基金财产；
- 3.基金托管人按照规定开设基金财产的基金账户、证券账户、期货账户、期货账户、期货账户、期货账户；
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分别管理，确保基金财产的完整与独立。

基金托管人按照基金合同和托管协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人同意，不得擅自运用、处分、分配本基金的任何财产（不含基金财产依据中国结算公司清算数据完成场内资金划付，银行汇划支付结算机构收取结算费用和账户管理费等等费用）。

6. 对于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，到期日基金托管人应对应收资产进行逐笔核对，确保基金财产的安全。基金管理人应及时通知基金托管人提供准确到账的数据和到账的日期，由基金托管人负责向基金管理人提供准确到账的数据。

7. 除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。

（二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1.基金募集期间募集的基金资产应存于基金管理人或基金托管人的营业机构开立的 基金募集专户。该账户由基金管理人开立并管理；
- 2.基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《暂行办法》等有关规定的，基金管理人应将属于本基金的完整资产划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时限内，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。

3. 验资报告的编制与复核期间及复核方式

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。

（三）基金银行账户的开立和管理

1.基金托管人以基金的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令办理资金划收付。本基金的银行账户预留印鉴为基金管理人保管和使用。

2.基金银行账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金银行账户的开立和管理应符合银行间债券市场的有关规定。

4.在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通過基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

（四）基金证券账户和债券托管账户的开设和管理

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、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户；

2.基金证券账户的开立和使用，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同意擅将账户提供给任何第三方使用，亦不得将基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金证券账户的开立和证券账户的开立由基金托管人负责，资产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费用由基金财产承担。此开户费用由基金管理人先行垫付，待证券资产初始确认后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将开户费用从本基金托管资金账户中归还基金管理人。账户开立后，基金托管人应及时将证券账户开户信息通知基金托管人。