东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告

1、开户

(1)开户时间：2016年7月11日至2016年8月5日9:00-15:00（节假日除外，业务办理安排以当地分行为准）；

(2)开户地点：农业银行指定的“东吴基金管理有限公司基金账户”开户网点；

(3)个人投资者申请开立基金账户必须提供以下资料：

a、本人有效身份证明原件(身份证、军人证、武警证、护照等)；

b、农业银行借记卡；

c、填妥的《开放式基金账户业务申请表》

开户申请接受后，投资者可于T+2日以后到农业银行指定的“东吴基金管理有限公司基金账户”业务网点办理开户业务确认手续。

2、认购

业务办理时间：2016年7月11日至2016年8月5日9:00-15:00（节假日除外，业务办理安排以当地分行为准)申请，该认购申请计入下一发售日；个人投资者携带以下材料到农业银行指定的代销“东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金”的网点提交认购申请：

（1）本人有效身份证明原件(身份证、军人证、武警证、护照等)；

（2）农业银行借记卡；

（3）填妥的《开放式基金交易业务申请表》。

农业银行代销网点接受认购申请后，当即向投资者提供缴款回执；投资者于发布本基金合同生效公告后到该行基金代销网点办理认购业务确认手续。

3、有关注意事项

(1)一个投资者只能开立一个基金账户；

(2)投资者必须本人亲自办理开户和认购手续；

(3)农业银行代销网点在个人投资者申请认购基金时不接受现金，投资者必须预先在用于认购基金的借记卡中存入足额的资金；

(4)募集期间，个人投资者首次最低认购金额为1,000元，追加认购最低金额为1000元；

(5)个人投资者认购基金申请须在公布的个人投资者认购时间内办理；

(6)个人投资者在农业银行进行开放式基金买卖时使用的资金账户必须是唯一的；

(二)、其他银行指定基金代销网点

个人投资者在交通银行、苏州银行等的开户及认购手续，以各代销银行的规定为准。

（四）通过证券公司办理开户及认购的程序

以下个人投资者开户及认购程序原则上在本基金的各代销证券公司均适用。

此程序仅供投资者参考，具体程序以各代销证券公司的规定和说明为准。

1、业务办理时间

2016年7月11日至2016年8月5日9:30—15:00（周六、周日和法定节假日不营业）。

2、办理开户及认购手续

（1）资金账户的开立

个人投资者申请在各代销证券公司开立资金账户应提供以下材料：

①填妥的资金账户开户申请表；

②本人有效身份证明原件及复印件。

（2）基金账户的开立

个人投资者在各代销证券公司开立基金账户须提供以下资料：

①基金账户开户申请表；

②本人有效身份证件原件及复印件，其中，使用未成年人身份证件开户的，必须同时提交符合规定的代理人身份证件资料；

③证券公司资金账户卡。

（3）已开立资金账户和东吴基金管理有限公司基金账户的投资者无需再开立资金账户和基金账户，可直接认购本基金（投资者须提供基金账号）。

（4）提出认购申请

个人投资者在各代销证券公司认购本基金须提交以下资料：

①认购申请表；

②认购人身份证件原件及复印件；

③授权委托书（加盖机构公章和法定代表人章）；

④证券公司资金账户卡。

（五）东吴基金管理有限公司直销中心

1、基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。认购资金冻结期间的资金利息转换成基金份额归投资人所有。利息的具体金额以本基金的注册登记机构的计算、确认为准。

2、本基金权益登记由基金注册登记机构（东吴基金管理有限公司）在募集结束后完成过户登记。

六、退款

1、投资者通过代销机构进行认购时产生的无效认购资金的退款时间和方式详见各代销机构业务规则。

2、基金募集期限届满，未达到基金合同生效条件，或募集期内发生使基金合同无法生效的不可抗力，则基金募集失败。如本基金募集失败，需在基金募集期限届满后30日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

七、基金的验资与基金合同的生效

（一）验资

本基金在募集期内，如基金募集金额超过2亿元人民币，总份额达到2亿份以上且基金份额持有人的人数不低于200人，则基金管理人可依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金招募说明书终止发售，并于10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（二）合同生效

基金管理人依法向中国证监会办理备案手续后，自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

八、本次募集有关当事人和中介机构

(一)基金管理人

名称：东吴基金管理有限公司

办公地址：上海市源深路279号

注册地址：上海市源深路279号

法定代表人：王炯

成立日期：2004年9月2日

客户服务电话：021-50509666

传真：021-50509884

联系人：钱巍

(二)基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

联系人：刘峰

电话：(010)85108226

传真：(010)85109219

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(三)销售机构

1、直销机构：

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路279号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路279号（200135）

法定代表人：王炯

联系人：钱巍

直销电话：(021)50509880

传真：(021)50509884

客户服务电话：400-821-0588、(021)50509666

网站：www.scfund.com.cn

2、代销机构：

1)农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

联系人：刘峰

电话：(010)85108226

传真：(010)85109219

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

2)苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市东吴北路143号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号

法定代表人：王兰凤

联系人：项瑜楠

电话：0512-69868389

传真：0512-69868370

客服热线：96067

公司网址：www.suzhoubank.com

3)交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锦明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

4)东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-33396288

公司网址：www.dwzq.com.cn

5)中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568536

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

6)申万宏源证券有限公司

注册地址：上海徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523或4008895523

公司网址：www.swhysc.com

7)中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝内大街188号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：(010)65183880

传真：(010)65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

8)国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客户服务热线：400-8888-666

9)财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服电话：0731-84403350

公司网址：www.cfzq.com

10)中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

11)光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

12)渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

13)东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：刘化军

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：梁旭

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

14)天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701　邮编：100032

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层　邮编：100088

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045529

客服电话：010-66045678

传真：010-66045518

天相投顾网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

15)平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层（518048）

法定代表人：谢永林

联系人：吴琼

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

16)长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：027-68751860

传真：027-85481900

客服电话：95579或4008-888-999

公司网址：www.95579.com

17)信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

18)华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客服电话：0551-96518或者4008096518

公司网址：www.hazq.com

19)广州证券有限责任公司

注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

办公地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客服电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

20)中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服热线：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

21)五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层

办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49层

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客服热线：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

22)上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号　环球金融中心9楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号　环球金融中心9楼

法定代表人：罗浩

联系人：倪丹

电话：021-38784818

传真：021-68775878

客服热线：68777877

公司网址：www.cf-clsa.com

23)华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

注册资本：16亿元人民币

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

邮政编码：200030

联系人：杨莉娟

业务联系电话：021-54967202

传真电话：021-54967293

华鑫证券公司网站：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

24)国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服热线：4006600109

公司网址：www.gjzq.com.cn

25)中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：(0531)68889155

传真：(0531)68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

26)中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙翰来

联系人：刘毅

电话：0755-8202 3442

传真：0755-8202 6539

客服热线：400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

27)招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755)82943666

传真：(0755)82943636

联系人：林生迎

客服电话：95565、400-8888-111

公司网址：www.newone.com.cn

28)上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：021-53519888-1915

传真：021-33303353

客服电话：4008918918

公司网址：www.shzq.com

29)华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

电话：021-68778081

传真：021-68778117

客服电话：4008209898

公司网址：www.cnhbstock.com

30)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38600735

传真：021-38509777

客服热线：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

31)深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

联系人：张玉静

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn　及　www.jjmmw.com

32)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

电话：0571-88911818转8565

传真：0571-86800423

客服热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

33)上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

34)杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：张裕

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客服热线：4000 766 123

公司网址：www.fund123.cn

35)和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：于杨

电话：021-20835779

传真：021-20835885

客服热线：400-920-0022

公司网址：http://licaike.hexun.com/

36)上海长量基金销售投资有限公司

代销机构：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021—58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

37)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服热线：400-700-9665

公司网址：www.chowbuy.com

38)上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：021-333323830

客服热线：4008202819

公司网址：http://www.chinapnr.com/

39)申万宏源（西部）证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

联系人：王君

电话：010-88085858

传真：010-88085195

40)国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街8号6楼、7楼

办公地址：无锡市县前东街8号6楼、7楼

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：400 888 5288

公司网址：www.glsc.com.cn

41)浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：徐黎云

联系人：来舒凤

电话：0571-88337888

传真：0571-88337666

客服热线：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

42)上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

联系人邮箱：NINGBOYU@pingan.com.cn

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

43)上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583633

网址：http://a.leadfund.com.cn/

客户服务中心电话：400-067-6266

44)北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区月楼街月楼soho10层

办公地址：北京市海淀区月楼街月楼soho10层

法定代表人：赵荣春

联系人：翁海娟

电话：15311484311

传真：010-57569671

客服热线：4008936885

公司网址：www.qianjing.com

45)中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼一层

办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼一层

法定代表人：徐福星

联系人：李美

电话：18810595051

传真：010-68292964

客服热线：400-600-0030

公司网址：http://www.bzfunds.com/

46)上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服热线：4000-466-788

公司网址：http://www.66zichan.com

47)大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

电话：18616752315

传真：021-22268089

客服热线：021-22267943

公司网址：http://www.dtfortune.com/

48)珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路6号105室-3491

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1201-1203室（邮编：510308）

法定代表人：肖雯

联系人：吴俊浩

电话：020-89629021

传真：020-89629011

联系人邮箱：wuyuhao@yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

网址：http://www.yingmi.cn/

49)中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：韩钰

电话：010-60833754

传真：010-57762999

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.criscf.com

50)国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

51)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李荣鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：021-95553

公司网址：www.htsec.com

52)兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路268号证券大厦

办公地址：浦东新区民生路1199弄正大·五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

联系人：谢尚荷

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客服电话：400-8888-123

公司网址：www.xyzq.com

53)安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558305

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

东吴基金管理有限公司

二零一六年七月

东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金合同内容摘要

（18）本基金参与股指期货交易后，依据下列标准建构组合：

1）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%；

2）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；

3）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%；

4）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；

5）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%；

（19）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。

因证券、期货市场波动、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，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或按照调整后的规定执行。

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）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

（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）法律、行政法规和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，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的同意，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半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止行为，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

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、股指期货合约和银行存款本息、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选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值；

（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；估值日没有交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

（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。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、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，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（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、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、股指期货合约一般以估值当日结算价格进行估值，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。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。

6、如有确凿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管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，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维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，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，如经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净值的计算结果对外予以公布。

（四）、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人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托管人，经基金托管人复核无误后，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：

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，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的当事人（“受损方”）给予赔偿，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。

（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。

（2）估值错误的责任方对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返还或不全部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交付不当得利的权利。如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，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，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

（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，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（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；错误偏差达到基金份额净值的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、期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后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。

（八）、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力，证券、期货交易场所及其登记结算公司发送的数据错误或国家会计政策变更、市场规则变更等原因，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应免除赔偿责任。但基金管理人和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。

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，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（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花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）对基金剩余财产进行分配；

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。

八、争议的处理和适用的法律

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，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议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，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管