（上接B67版）

九、基金份额持有人大会	（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表可在基金份额持有人大会中代表基金份额持有人行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。 （二）召开事由 （四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 1.基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒介公告。 2.采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由召集人决定召集人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。 （五）基金份额持有人出席会议的方式 1.会议方式 (1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。 (2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。 (3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式进行表决。 2.召开基金份额持有人大会的条件 (1)现场开会方式 在同时符合以下条件时，现场会议方可举行： 1）对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%，下同）； 2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。 (2)通讯开会方式 在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行： 1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告； 2）召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督； 3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力； 4)本人直接出具意见和授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上； 5)直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。 (七)决议形成的条件、表决方式、程序 3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并子以公告。 (九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式 1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会你法核准或者出具无异议意见之日起生效。 3. 基金份额持有人大会决议应按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。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。	（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表可在基金份额持有人大会中代表基金份额持有人行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。 本基金份额持有人大会不设立日常机构。 (二)召开事由 3.当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%，且基金管理人决定暂停接受所有赎回申请并终止基金合同，则基金合同将根据第二十部分的约定进行基金财产清算并终止，且无须召开基金份额持有人大会。 (四)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 1.基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒介公告。 2.采取通讯开会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及投票方式（包括但不限于以纸质表决票投票、网络投票及短信投票等）、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。 (五)基金份额持有人出席会议的方式 1.会议方式 (1)基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开。 (2) 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，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。 (3) 通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或公告载明的其他方式进行表决。 2.召开基金份额持有人大会的条件 (1)现场开会方式 在同时符合以下条件时，现场会议方可举行： 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总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额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三个月以后、六个月以内，就原定审议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有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有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低于前款规定比例，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，就原定审议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有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见； 4）上述第3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意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，并与持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。 3.在不违反法律法规规定的情况下，经会议通知载明，本基金的基金份额持有人亦可采用网络、电话、短信等其他方式向其授权代表进行授权。 4.在不违反法律法规规定的情况下，经会议通知载明，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。 (七)决议形成的条件、表决方式、程序 3.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，并子以公告。 (九)基金份额持有人大会决议报中国证监会备案后的公告时间、方式 1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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的决议自表决通过之日起生效。 3. 基金份额持有人大会决议应按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。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。
十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	（一）基金管理人的更换 (3)临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人； (4)备案：基金份额持有人大会更换基金管理人的决议自表决通过之日起生效，基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案； (7)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告； (二)基金托管人的更换 (3)核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行； (6)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后2日内公告； (二)基金托管人的更换 2.基金托管人的更换程序 (3)核准：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人，更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准生效后方可执行； (6)公告：基金管理人更换后，由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后2日内公告； (三)基金管理人与基金托管人同时更换 3.公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后2日内在指定媒体上联合公告	（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的授权代表可在基金份额持有人大会中代表基金份额持有人行使权利。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。 本基金份额持有人大会不设立日常机构。 (二)召开事由 3.当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%，且基金管理人决定暂停接受所有赎回申请并终止基金合同，则基金合同将根据第二十部分的约定进行基金财产清算并终止，且无须召开基金份额持有人大会。 (四)召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 1.基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒介公告。 2.采取通讯开会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及投票方式（包括但不限于以纸质表决票投票、网络投票及短信投票等）、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。 (五)基金份额持有人出席会议的方式 1.会议方式 (1)基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开。 (2) 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，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。 (3) 通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或公告载明的其他方式进行表决。 2.召开基金份额持有人大会的条件 (1)现场开会方式 在同时符合以下条件时，现场会议方可举行： 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总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额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三个月以后、六个月以内，就原定审议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有代表三分之一以上（含三分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额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）。 (2)通讯开会方式 在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行： 1）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； 2）召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督； 3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力； 4)本人直接出具意见和授权他人代表出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上； 5)直接出具意见的基金份额持有人或受托代表他人出具意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。 (七)决议形成的条件、表决方式、程序 3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并子以公告。 (九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式 1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会你法核准或者出具无异议意见之日起生效。 3. 基金份额持有人大会决议应按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。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。
十三、基金的投资	(二)投资范围 本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体如下： 1.现金； 2.通知存款； 3.短期融资券； 4.一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单； 5.期限在一年以内（含一年）的债券回购； 6.期限在一年以内（含一年）的中央银行票据； 7.剩余期限在397天以内（含397天）的债券； 8.剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券； 9.中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。 如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。 (六)投资限制 本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制： (1) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天； (2)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%；本基金与由本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%； (3)投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的30%,但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制;投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%。投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过5%； (4)同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过10%,国债、中央银行票据、政策性金融债券除外； (5) 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%，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； (6)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%，中国证监会规定的特殊品种除外； (7)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10%； (8) 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，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%； (9) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级,且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用级别。本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起3个月内对其予以全部卖出； (10)本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的140%； (11)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； (12)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%； (13)本基金主动投资于流动性受限资产投资的市值合计不得超过基金资产净值的10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； (14) 除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形,债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过20%； (15)本基金基金管理人的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%； (16)本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具（包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种）占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%； 本基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。 (17)根据基金份额持有人集中度情况，本基金投资组合应符合下列规定： 1）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%； 2）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%； (18)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。 因证券市场波动、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，除第(9)、(10)、(11)、(12)和(16)项外，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。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。 2.本基金不得投资于以下金融工具： (1)股票； (2)可转换债券； (3)剩余期限超过397天的债券； (4)信用等级在AAA级以下的企业债券； (5)以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的,从其规定； (6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券； (7)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。 如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。 3.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)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,但法律法规或中国证监会另有规定的除外； (5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券； (6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有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； (7)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动； (8)与基金管理人的股东进行交易,通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的该交天数； (9)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。 如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。 (七)投资组合平均剩余期限计算方法 1.计算公式 其中:投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、期限在一年以内(含一年)的逆回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。 投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。 2.各类资产和负债剩余期限的确定方法 (1)银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为0天；证券清算款的剩余期限为1天；证券承销期内承销的证券的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算。 (2)银行定期存款、大额存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算。有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算。 (3) 组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外： 允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。 (4)回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。 (5) 中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。 (6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限。 (7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。	(二)投资范围 本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、回业存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券及以中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。 如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 (六)投资限制 本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制： (1) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天； (2)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%；本基金与由本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%； (3)投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的30%,但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制;投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%。投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过5%； (4)同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过10%,国债、中央银行票据、政策性金融债券除外； (5) 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%，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； (6)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%，中国证监会规定的特殊品种除外； (7)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10%； (8) 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，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%； (9) 本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级,且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的信用级别。本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起3个月内对其予以全部卖出； (10)本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的140%； (11)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等； (12)现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%； (13)本基金主动投资于流动性受限资产投资的市值合计不得超过基金资产净值的10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。 (14)根据基金份额持有人集中度情况，本基金投资组合应符合下列规定： 1）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%； 2）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%； (15)本基金基金管理人的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%； (16)本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具（包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种）占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%； 本基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。 (17)根据基金份额持有人集中度情况，本基金投资组合应符合下列规定： 1）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%； 2）当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%； (18)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。 因证券市场波动、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，除第(9)、(10)、(11)、(12)和(16)项外，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。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。 2.本基金不得投资于以下金融工具： (1)股票； (2)可转换债券、可交换债券； (3) 信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具； (4) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外； (5)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。 如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。 3.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)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,但法律法规或中国证监会另有规定的除外； (5)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动； (6)向其基金管理人、基金托管人出资； (7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，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调整后的规定执行，无需经基金份额持有人大会审议。 4.关联交易原则 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，形经过半分之一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。 法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行，无需经基金份额持有人大会审议。 (七)投资组合平均剩余期限计算方法 1.计算公式 其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、银行定期存款、大额存单、债券、逆回购、中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。 投资于金融工具产生的负债包括正回购、买断式回购产生的待返售债券等。 2.各类资产和负债剩余期限的确定方法 (1)银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算。 (2)银行定期存款、大额存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算。有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算。 (3) 组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外： 允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。 允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。 (4)回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。 (5) 中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。 (6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限分该基础债券的剩余期限。 (7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。
十五、基金资产的估值	(二)估值方法 1.本基金估值采用“摊余成本法”,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用“摊余成本法”估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。 2.为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的偏离达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,其中,对于偏离程度达到或超过0.5%的情形,基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估。 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。 (七)基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值、每万份基金已实现收益和七日年化收益率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。	(二)估值方法 1.本基金估值采用“摊余成本法”,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。
2.为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值的偏离达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,其中,对于偏离程度达到或超过0.5%的情形,基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估。 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。 (七)基金净值的确认 基金资产净值、每万份基金已实现收益和七日年化收益率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。
十六、基金的费用与税收	(一)基金费用的种类 5.基金合同生效后的基金信息披露费用； (5)基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率,无须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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。 (六)基金税收 基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。	(一)基金费用的种类 5.除法律法规、中国证监会另有规定外,基金合同生效后的基金信息披露费用； (5)基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须于