

上接B7版

四、基金财产净值、基金份额净值公告

基金管理人应在开始在定期报告中披露基金的份额净值或单位净值。

在开始披露基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露上一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年度和半年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值。

基金管理人应当在最近一个市场交易日的次日，将基金份额净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊网站上。

五、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金管理信息披露内容与格式的有关文件的规定编制，由基金管理人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。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。

基金年度报告，基金管理人应当在每年结束之日起45个工作日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文全文披露于网站，将年度报告的摘要登载于报纸。

基金半年度报告，基金管理人应当在上半年结束之日起2个月内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文全文披露于网站，将半年度报告的摘要登载于报纸。

基金季度报告，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报刊和网站。

基金管理人可以不披露当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

法律法规和中国证监会另有规定的，从其规定。

六、临时报告与公告

基金管理人有义务披露信息的，应当在两个日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别向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。

前款所称临时报告，是指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事件，包括：

1、基金份额持有人大会的召集、召开及权益变动；

2、终止基金合同；

3、转换基金运作方式；

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；

6、基金管理人及其股东发生变化；

7、基金管理人董事长、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；

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50%；

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30%；

11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管人的诉讼；

12、涉及基金管理人、基金托管人受到监管当局的调查；

13、涉及基金管理人、基金托管人及其从业人员受到其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其从业人员受到严重行政处罚；

14、重大关联交易事项；

15、基金收益分配事项；

16、管理费、托管费、委托费等费用计提方式、费率发生变更；

17、基金份额净值计算方法、计算公式、基金资产净值或基金份额净值0.5%；

18、基金改聘会计师事务所；

19、基金变更、增加、减少基金份额持有人；

20、基金变更登记事项；

21、基金开放的临时申购、赎回、转换、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换；

22、基金申购、赎回费率及收费方式发生变更；

23、基金发生巨额赎回后延期支付；

24、基金连续两个工作日暂停接受申购、赎回申请；

25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26、基金份额持有人大会的决议；

27、中国证监会规定的其他事项。

七、公开澄清

在基金合同期限内，任何公共媒体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市场价格波动的，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，并将有关情况即刻报告中国证监会。

八、信息披露文件的存放与查阅

信息披露文件应自公布后，分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

基金份额定期报告公告后，分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

九、基金的费用提示

本基金运作过程中面临的主要风险有：市场风险、信用风险、量化基金特有的风险、管理风险、操作风险、风险厌恶及其他风险。量化投资管理直接相关的风险是市场风险、信用风险、操作风险、量化基金风险，这四种风险可以使用数量指标加以度量及控制，而操作风险及其流动性可以建立相应的内部系统加以管理。

1、市场风险

证券市场价格因各种因素的影响而引起的波动，将使本基金资产面临潜在的风险。本基金的市场风险主要基于基金资产对证券市场价格的波动、影响股票与债券市场价格波动的风险，包括但不限于以下多类风险因素：政策风险、经济周期风险、利率风险、通货膨胀风险、汇率风险和上市公司经营风险等。

2、信用风险

债券发行人出现违约、支付能力受到限制，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也是证券交易所对债券违约而产生的证券交割风险。

3、流动性风险

因交易市场交易不足，导致证券不能迅速、低成本地转化为现金的风险。流动性风险包括但不限于以下多类风险因素：市场风险、信用风险、量化基金特有的风险、管理风险、操作风险、风险厌恶及其他风险。这四种风险可以使用数量指标加以度量及控制，而操作风险及其流动性可以建立相应的内部系统加以管理。

4、管理风险

本基金在基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

5、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

6、信用风险

指基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

7、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

8、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

9、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

10、信用风险

指基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

11、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

12、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

13、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

14、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

15、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

16、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

17、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

18、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

19、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

20、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

21、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

22、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

23、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

24、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

25、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

26、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

27、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

28、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

29、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

30、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

31、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

32、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

33、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

34、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

35、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

36、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

37、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

38、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

39、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

40、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

41、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

42、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

43、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

44、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

45、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

46、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

47、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

48、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

49、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

50、量化基金特有的风险

本基金是量化基金，采用自主研发的量化数据投资管理，进行选股和相关操作，存在其特有的风险，如股票选股模型不当，参数设置错误和系统运行所产生的风险。

51、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确，使本基金不能够准确地把握基金的投资方向，将会影响基金的收益水平。

52、操作风险

指本基金的投资者在基金的投资运作中，违反法律法规、规章制度或合同约定，从而导致基金财产损失的风险。

53、