

(上接A18版)

(2)银行定期存款、大额存单的剩余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;允许投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至回售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为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;

(8)短期融资券的剩余期限以计算日至短期融资券到期日所剩余的天数计算。

(9)对其它金融工具,基金管理人将基于审慎原则,根据法律法规或中国证监会的规定,或参照行业公认的方法计算其剩余期限。

平均剩余期限的计算结果保留至整数位,小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限计算方法另有规定的从其规定。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款税后利率。

根据基金的投资目标、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场上出现更加适合于本基金业绩基准时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

七、风险收益特征

本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

八、基金的融资、融券和转融通

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券和转融通业务。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定发布后,基金管理人可以在不改变本基金既存投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、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项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的规定执行,无需召开基金份额持有人大会。

九、在不违反法律法规规定的情况下,本基金可与基金管理人管理的其他资产以公平的市场价格进行相互交易。

十、基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金资产的账户

基金管理人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金管理机构各自的自有财产账户及其他基金财产账户相独立。

四、基金资产的保管和处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金管理机构和基金销售机构以其自身的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法法律法规和《基金合同》的约定处分外,基金财产不得被处分。

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,基金财产不归于清算财产;基金管理人管理运用基金财产所产生的债权债务不得与其固有财产的债务相互抵销;基金管理人管理运用不同基金的基金财产所产生的债权债务不得互相抵销。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

十一、基金资产的估值

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资产净值、每份基金已实现收益及7日年化收益率的非交易日。

二、估值日

基金管理人应于每一个交易日对基金资产估值,并在每份基金已实现收益及7日年化收益率的非交易日。

三、估值对象

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,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金不采用市价法对投资的证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市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏差,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偏离幅度或超过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,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

3.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。

4.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。

5.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。

6.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;

7.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;

8.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;

9.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;

10.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;

11.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;

12.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;

13.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;

14.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;

15.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;

16.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;

17.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;

18.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;

19.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;

20.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;

21.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;

22.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;

23.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;

24.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;

25.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;

26.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;

27.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;

28.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;

29.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;

30.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;

31.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;

32.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;

33.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;

34.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;

35.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;

36.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;

37.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;

38.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;

39.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;

40.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;

41.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;

42.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;

43.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;

44.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;

45.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;

46.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;

47.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;

48.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;

49.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;

50.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;

51.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;

52.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;

53.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;

54.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;

55.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;

56.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;

57.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;

58.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;

59.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;

60.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;

61.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;

62.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;

63.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;

64.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;

65.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;

66.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;

67.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;

68.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;

69.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;

70.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;

71.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;

72.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;

73.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;

74.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;

75.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;

76.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;

77.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;

78.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;

79.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;

80.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;

81.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;

82.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;

83.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;

84.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;

85.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;

86.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;

87.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;

88.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;

89.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;

90.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;

91.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;

92.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;

93.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;

94.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;

95.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;

96.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;

97.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;

98.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;

99.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;