

(上接A19版)

基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(16) 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；

(17) 法律法规及中国证监会规定的其他基金合同约定的其他投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起10日内将基金的组合投资比例符合基金合同的约定。期间，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基金合同生效之日起开始。

除上述第(2)、(11)、(15)、(16)项外，因证券市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例规定的，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。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受限于相关限制或按调整后的规定执行。

3.基金管理人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。

基金管理人不得低于下限的投资者或活动：

(1) 承销证券；

(2) 违规向不向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 卖卖其持有的基金份额，但中国证监会另有规定的除外；

(5) 向本基金管理人、基金托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券市场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禁止的其他活动。

基金管理人因使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重大利益冲突的公司的证券的，从事或者委托他人买卖关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，按照公平交易的原则定价，优先利用关联交易，建立健全内部审批机制和评估机制，按照公平交易的原则定价，优先利用关联交易，建立健全内部审批机制和评估机制。

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。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人参与银行间债券交易进行监督。

基金管理人因向基金托管人提供有关法律法规及行业标准的银行间市场交易对手名单的基金托管人，在收到名单后两个工作日内电话或书面函件确认，名单由基金管理人确认后，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金托管人应依据有关法律法规的规定及基金合同的约定对于基金管理人参与银行间债券交易引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金管理人因定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合条件的存款银行，基金托管人应根据协议约定的条件对基金托管人选择的存款银行是否符合有关的规定进行监督。

6. 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交易的名单进行监督，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(2) 流通受限证券，包括由上市公司证券发行管理办法规范的非公开发行股票、公开发行证券网下配售部分等在发行时明确一定限售期的证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行上市证券在证券交易所交易中的质押券等受限证券。

(3) 基金管理人应在首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会通过的有关基金投资流通受限证券的授权书。

基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合基金合同的授权人，由基金管理人董事会通过后向基金托管人出具书面授权。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应与基金托管人签署符合法律法规的规定及基金合同的有关书面协议。

6. 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交易的名单进行监督，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(2) 流通受限证券，包括由上市公司证券发行管理办法规范的非公开发行股票、公开发行证券网下配售部分等在发行时明确一定限售期的证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行上市证券在证券交易所交易中的质押券等受限证券。

(3) 基金管理人应在首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会通过的有关基金投资流通受限证券的授权书。

基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合基金合同的授权人，由基金管理人董事会通过后向基金托管人出具书面授权。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应与基金托管人签署符合法律法规的规定及基金合同的有关书面协议。

7. 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交易的名单进行监督，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(2) 流通受限证券，包括由上市公司证券发行管理办法规范的非公开发行股票、公开发行证券网下配售部分等在发行时明确一定限售期的证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行上市证券在证券交易所交易中的质押券等受限证券。

(3) 基金管理人应在首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会通过的有关基金投资流通受限证券的授权书。

基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合基金合同的授权人，由基金管理人董事会通过后向基金托管人出具书面授权。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应与基金托管人签署符合法律法规的规定及基金合同的有关书面协议。

8. 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交易的名单进行监督，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(2) 流通受限证券，包括由上市公司证券发行管理办法规范的非公开发行股票、公开发行证券网下配售部分等在发行时明确一定限售期的证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行上市证券在证券交易所交易中的质押券等受限证券。

(3) 基金管理人应在首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会通过的有关基金投资流通受限证券的授权书。

基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合基金合同的授权人，由基金管理人董事会通过后向基金托管人出具书面授权。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应与基金托管人签署符合法律法规的规定及基金合同的有关书面协议。

9. 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交易的名单进行监督，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(2) 流通受限证券，包括由上市公司证券发行管理办法规范的非公开发行股票、公开发行证券网下配售部分等在发行时明确一定限售期的证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行上市证券在证券交易所交易中的质押券等受限证券。

(3) 基金管理人应在首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会通过的有关基金投资流通受限证券的授权书。

基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合基金合同的授权人，由基金管理人董事会通过后向基金托管人出具书面授权。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应与基金托管人签署符合法律法规的规定及基金合同的有关书面协议。

10. 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交易的名单进行监督，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(2) 流通受限证券，包括由上市公司证券发行管理办法规范的非公开发行股票、公开发行证券网下配售部分等在发行时明确一定限售期的证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行上市证券在证券交易所交易中的质押券等受限证券。

(3) 基金管理人应在首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会通过的有关基金投资流通受限证券的授权书。

基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合基金合同的授权人，由基金管理人董事会通过后向基金托管人出具书面授权。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应与基金托管人签署符合法律法规的规定及基金合同的有关书面协议。

11. 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交易的名单进行监督，基金管理人应书面确认。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按协议约定进行结算。

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规的规定。

(2) 流通受限证券，包括由上市公司证券发行管理办法规范的非公开发行股票、公开发行证券网下配售部分等在发行时明确一定限售期的证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券，已发行上市证券在证券交易所交易中的质押券等受限证券。

(3) 基金管理人应在首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会通过的有关基金投资流通受限证券的授权书。

基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合基金合同的授权人，由基金管理人董事会通过后向基金托管人出具书面授权。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应与基金托管人签署符合法律法规的规定及基金合同的有关书面协议。

12. 基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的金额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，债券回购到期不得展期；

(13) 本基金资产不得投资于股票；

(14) 本基金托管人管理的全部开放式基金及封闭式基金以及处于开放期的定期开放式基金持有同一上市公司发行的流通股股票，不得超出该上市公司可流通股票的15%；本基金托管人管理的全部股权投资组合持有的同一上市公司发行的流通股股票，不得超出该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种以及中国证监会认定的其他投资组合不受此比例限制；

(15) 本基金托管人管理的基金财产不得向他人提供担保，但基金托管人根据法律法规或基金合同的规定为基金财产提供担保的除外；

(16) 本基金托管人管理的基金财产不得从事承担无限责任的投资；

(17) 本基金托管人管理的基金财产不得从事向他人贷款或者提供担保；

(18) 本基金托管人管理的基金财产不得从事从事内幕交易、操纵证券市场价格及其他不正当的证券交易活动；

(19) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(20) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(21) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(22) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(23) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(24) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(25) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(26) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(27) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(28) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(29) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(30) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(31) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(32) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(33) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(34) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(35) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(36) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(37) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(38) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(39) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(40) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(41) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(42) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(43) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(44) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(45) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(46) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(47) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(48) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(49) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(50) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(51) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(52) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(53) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(54) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(55) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(56) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(57) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(58) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(59) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(60) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(61) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(62) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(63) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(64) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(65) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(66) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(67) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(68) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(69) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(70) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(71) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(72) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(73) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(74) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(75) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(76) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(77) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(78) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。

(79) 本基金托管人管理的基金财产不得从事中国证监会禁止的其他投资行为。