

—

第七部分 基金合同当事人及权利义务

第八部分 基金份额持有人大会

第十二部分 基金的投资

第十一部分 基金的投

	<p>（二）基金管理人的权利与义务</p> <p>2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集的资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>（二）基金管理人的权利与义务</p> <p>2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（24）根据相关市场规则，为基金开设证券账户，为基金办理证券交易资金清算；</p>
	<p>二、基金托管人</p> <p>（二）基金托管人的权利与义务</p> <p>1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户，为基金办理证券交易资金清算；</p> <p>2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户及投资所需的其他账户，按照《基金合同》及《托管协议》的约定，按照基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p> <p>（10）对基金财务会计报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》及《托管协议》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》及《托管协议》规定的行为，还应当说明基金管理人是否采取了适当的措施；</p> <p>（16）按照法律法规及《基金合同》及《托管协议》的规定监督基金管理人的投资运作；</p> <p>（20）按规定监督基金管理人按照法律法规及《基金合同》及《托管协议》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；</p>	<p>二、基金托管人</p> <p>（二）基金托管人的权利与义务</p> <p>1.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：</p> <p>（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户、期货清算账户等投资所需求的账户，为基金管理证券、期货交易资金清算；</p> <p>2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等其他账户，按照《基金合同》及《托管协议》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；</p> <p>（10）对基金财务会计报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行，还应当说明基金管理人是否采取了适当的措施；</p> <p>（16）按照法律法规及《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；</p> <p>（20）按规定监督基金管理人按照法律法规及《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；</p>
	<p>一、召开事由</p> <p>1.除法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>2.在违反法律法规、基金合同以及对基金份额持有人有利无害实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>（1）调低基金管理费、基金托管费及其他应当由基金承担的费用；</p> <p>（6）在对基金份额持有人有利无害实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；</p>	<p>一、召开事由</p> <p>1.除法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；</p> <p>2.在违反法律法规、基金合同以及对基金份额持有人有利无害实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>（1）调低基金管理费、基金托管费及其他应当由基金承担的费用；</p> <p>（6）在对基金份额持有人有利无害实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；</p>
	<p>一、投资目标</p> <p>本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及具备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会及相关规定）。</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不高于基金资产净值的90%，其中，中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日终在扣除股指期货合约的需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或现金等价物，在一年以内的政府债券。</p> <p>如果法律法规对比例要求有变更的，以变更后的要求为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金在严格控制投资组合的前提下，通过精选具有估值优势和成长优势的上市公司股票和债券进行投资，力争以较低的预期获得中高水平的收益，实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及具备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会及相关规定）。</p> <p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不高于基金资产净值的90%，其中，中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日终在扣除股指期货合约的需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或现金等价物，在一年以内的政府债券。</p> <p>如果法律法规对比例要求有变更的，以变更后的要求为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p>
	<p>三、投资策略</p> <p>本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证能源互联网主题指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况下导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围内。</p> <p>1.资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的90%，其中，中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日终在扣除股指期货合约的需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（或现金等价物）或现金等价物，在一年以内的政府债券，原则上本基金管理人将采用指数完全复制法，按指数编制方法中计算出的标的指数成份股权重重新构建组合，少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>2.股票投资策略</p> <p>本基金使用完全复制法进行被动式指数化投资，根据中证能源互联网主题指数的成份股及其编制方法创建一个投资组合，并根据指数的调整对组合进行相应的调整。</p> <p>本基金股票投资策略流程如下图所示：</p> <p>图：本基金股票投资流程具体如下：</p> <p>（1）投资目标的确定</p> <p>本基金的投资目标为追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>本基金采用跟踪偏离度来度量本基金的跟踪误差，即选取基金一年内每日的跟踪误差的时序数据列表的基准标准方差和来计算年度跟踪误差，再除以日均跟踪误差总数据计算日均跟踪误差。</p> <p>（2）投资组合的构建</p> <p>本基金投资组合的构建包含确定目标组合、建仓策略及构建组合三个步骤。首先是根据本基金的投资目标，采用完全复制法的指数成份股及其权重的方法确定目标组合；其次是根据对冲策略，结合对冲策略，建立对冲组合，从而构建本基金的投资组合。</p>	<p>三、投资策略</p> <p>本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证能源互联网主题指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况下导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围内。</p> <p>1.资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金投资于股票的资产不低于基金资产净值的90%，其中，中证能源互联网主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日终在扣除股指期货合约的需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（或现金等价物）或现金等价物，在一年以内的政府债券，原则上本基金管理人将采用指数完全复制法，按指数编制方法中计算出的标的指数成份股权重重新构建组合，少数特殊情况下本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>2.股票投资策略</p> <p>本基金使用完全复制法进行被动式指数化投资，根据中证能源互联网主题指数的成份股及其编制方法创建一个投资组合，并根据指数的调整对组合进行相应的调整。</p> <p>本基金股票投资策略流程如下图所示：</p> <p>图：本基金股票投资流程具体如下：</p> <p>（1）投资目标的确定</p> <p>本基金的投资目标为追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在0.35%以内，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>本基金采用跟踪偏离度来度量本基金的跟踪误差，即选取基金一年内每日的跟踪误差的时序数据列表的基准标准方差和来计算年度跟踪误差，再除以日均跟踪误差总数据计算日均跟踪误差。</p> <p>（2）投资组合的构建</p> <p>本基金投资组合的构建包含确定目标组合、建仓策略及构建组合三个步骤。首先是根据本基金的投资目标，采用完全复制法的指数成份股及其权重的方法确定目标组合；其次是根据对冲策略，结合对冲策略，建立对冲组合，从而构建本基金的投资组合。</p>

第十二部分 基金的 投资	（4）投资组合的平衡	
	本基金将定期对投资组合进行调整，以使基金的投资组合情况符合本基金投资策略所规定的各项比例。本基金将通过投资组合的调整，以使得投资组合能够合理配置资产，保持同步变动，另一方面，通过减少投资组合中对投资对象的系统性风险。	
	（5）投资组合的业绩评价	
	本基金将根据指数的涨跌数来参考基准，对投资组合进行绩效评估，以衡量指数在投资过程中投资组合的跟踪误差，从而通过控制跟踪误差来进行风险管理。	
	3. 债券投资策略	
	本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析，国内财政政策、货币市场政策等因素对债券投资进行分析，从而判断债券市场的走势，制定合理的投资组合和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构策略、市场转换、信用利差和绝对定价策略、信用风险评估、投资组合风险管理手段等个别选择。	
	本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。	
	4. 金融衍生工具投资策略	
	在法律法规许可时，本基金基于谨慎原则运用权证、股指期货等衍生工具对本基金投资组合进行风险管理，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。	
	本基金投资资产支持证券将在综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳健收益。	
第十一部分 基金的 投资	（1）权证投资策略	
	本基金的投资是严格按照投资组合风险，有利于实现资产保值增值和锁定收益的前提下进行的。	
	本基金将通过对权证的股票基本面的研究，并结合对宏观经济、有效控制风险的分析，对权证的买卖时机进行选择，从而实现资产保值增值。	
	（2）股指期货投资策略	
	本基金将通过股指期货投资于香港股票市场，不使用境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。	
	本基金将通过港股机制投资香港联合交易所上市的股票，在上述行业配置和个股选择的基础上，根据股票的股息率、市盈率、市净率等指标，选择具有投资价值的股票进行投资，从而实现资产保值增值。	
	（3）资产支持证券投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风控，通过对于证券市场的场内和场外市场进行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求合理的估值水平，与现货资产进行对比，通过多头或空头套期保值进行套期保值操作。基金经理人将通过建立国债期货空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过国债期货空头套期保值，降低国债期货多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（4）国债期货的投资策略	
	本基金通过对国债期货的分析，对国债市场的走势做出判断，以作为判定国债期货的头寸方向和额度的依据。在国债期货价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立国债期货空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过国债期货空头套期保值，降低国债期货多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
第十二部分 基金的 投资	（5）股票期权投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，参与股票期权的投资，将根据风险偏好，通过控制风险的判断，选择流动性好、交易活跃的期权合约，利用期权衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（6）股指期权投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，以期保值为目的，采用流动好、交易活跃的期权合约，通过对证券市场的场内和场外市场进行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求合理的估值水平，与现货资产进行对比，通过多头或空头套期保值进行套期保值操作。基金经理人将通过建立国债期货空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过国债期货空头套期保值，降低国债期货多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（7）商品期货投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，以期保值为目的，通过对于商品期货的分析，对商品期货的走势做出判断，以作为判定商品期货的头寸方向和额度的依据。在商品期货价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立商品期货空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过商品期货空头套期保值，降低商品期货多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（8）商品期权投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，以期保值为目的，通过对于商品期权的分析，对商品期权的走势做出判断，以作为判定商品期权的头寸方向和额度的依据。在商品期权价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立商品期权空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过商品期权空头套期保值，降低商品期权多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（9）金融衍生工具投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，通过对于金融衍生工具的分析，对金融衍生工具的走势做出判断，以作为判定金融衍生工具的头寸方向和额度的依据。在金融衍生工具价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立金融衍生工具空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过金融衍生工具空头套期保值，降低金融衍生工具多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
第十三部分 基金的 财产	（10）权证投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，通过对于权证的分析，对权证的走势做出判断，以作为判定权证的头寸方向和额度的依据。在权证价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立权证空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过权证空头套期保值，降低权证多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（11）股指期货投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，通过对于股指期货的分析，对股指期货的走势做出判断，以作为判定股指期货的头寸方向和额度的依据。在股指期货价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立股指期货空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过股指期货空头套期保值，降低股指期货多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（12）商品期货投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，通过对于商品期货的分析，对商品期货的走势做出判断，以作为判定商品期货的头寸方向和额度的依据。在商品期货价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立商品期货空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过商品期货空头套期保值，降低商品期货多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（13）商品期权投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，通过对于商品期权的分析，对商品期权的走势做出判断，以作为判定商品期权的头寸方向和额度的依据。在商品期权价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立商品期权空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过商品期权空头套期保值，降低商品期权多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
	（14）金融衍生工具投资策略	
	本基金将严格按照投资组合的风险控制原则，通过对于金融衍生工具的分析，对金融衍生工具的走势做出判断，以作为判定金融衍生工具的头寸方向和额度的依据。在金融衍生工具价格不断增长，通胀预期强烈的情况下，本基金将建立金融衍生工具空头套期保值，从而在经济增长趋弱时，通过金融衍生工具空头套期保值，降低金融衍生工具多头，以达到降低投资组合的敞口头寸的目的。	
第十四部分 基金资产 估值	（15）基金投资流通受限证券	
	本基金投资于股票的资产，不低于基金资产净值的90%，其中，中证能源互联网主题指数成分股和备选成分股的股票比例不低于非限制性资产的90%。	
	（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约保证金后，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的20%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的30%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的40%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的50%。	
	（3）本基金持有的全部股票资产，其市值不得超过基金总资产的3%；	
	（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该权证的10%；	
	（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过买入权证的10%；	
	（6）本基金持有的全部股票资产，其市值不得超过基金总资产的10%；	
	（7）本基金持有的全部股票资产，其市值不得超过基金总资产的2%；	
	（8）本基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
	（9）本基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
第十五部分 基金限制	（10）本基金投资于股票的资产，净额不得超过基金总资产的140%；	
	（11）本基金总资产不得超过全国银行间同业拆借市场、全国银行间债券市场回购交易的金额，不得超过基金总资产的40%，债券回购期限不得超过一年，债券回购到期后不得持有到期。	
	（12）本基金总资产不得超过基金净资产的10%；	
	（13）本基金每个交易日日终在扣除国债期货、国债期货和股票期权合约保证金后，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的20%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的30%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的40%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的50%。	
	（14）在任何交易日日终，持有的股票资产，不得超过基金总资产的10%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的30%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的40%；在任何交易日日终，持有的股票资产净值比例不低于基金资产净值的50%。	
	（15）本基金投资流通受限证券时，遵循关于基金投资非公开发行股票和基金投资有关的通常做法，即基金投资非公开发行股票的，其投资比例不得超过基金资产净值的10%；	
	（16）根据法律法规和中国证监会规定的其他限制。	
	（17）法律法规及中国证监会规定的其他限制。	
	（18）法律法规及中国证监会规定的其他限制。	
	除上述第（2）、（10）、（11）、（12）、（13）、（14）、（15）项所列限制外，基金管理人和托管人可以基于对股票、债券、基金等金融产品的具体投资情况，进行适当的调整，法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。	
第十六部分 基金的 投资	2. 禁止行为	
	（1）法律法规有关规定，由基金管理人和托管人共同决定的其他禁止行为。	
	（2）依照法律法规有关规定，由基金管理人和托管人共同决定的其他禁止行为。	
	（3）法律法规及中国证监会规定的其他禁止行为。	
	（4）法律法规及中国证监会规定的其他禁止行为。	
	（5）法律法规及中国证监会规定的其他禁止行为。	
	（6）法律法规及中国证监会规定的其他禁止行为。	
	（7）法律法规及中国证监会规定的其他禁止行为。	
	（8）法律法规及中国证监会规定的其他禁止行为。	
	（9）法律法规及中国证监会规定的其他禁止行为。	
第十七部分 基金的 投资	3. 信息披露	
	（1）基金的资产净值	
	（2）基金的份额净值	
	（3）基金份额的申购、赎回价格	
	（4）基金的总资产、净资产和负债	
	（5）基金的经营情况和投资组合情况	
	（6）基金的未弥补亏损达实收基金总额的5%以上时，基金的净值	
	（7）基金的分配情况	
	（8）基金的季度报告、半年度报告和年度报告	
	（9）基金的临时报告	
第十八部分 基金的 信息披 露	4. 基金的季度报告	
	（1）基金持有人与一家公司发行的证券（同一公司在国内和香港同时上市的A+H股合称），其市值不得超过基金总资产的10%；本基金与基金管理人管理的其他基金持有的同一公司发行的证券，不高于该证券的10%。	
	（2）股票资产的投资比例为基金总资产的95%，其中，股票资产中投资于股票的资产比例不低于非限制性资产的90%。	
	（3）基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
	（4）基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
	（5）基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
	（6）基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
	（7）基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
	（8）基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
	（9）基金管理人管理的全部基金持有的同一股票，不得超过该股票的10%；	
第十九部分 基金的 投资	5. 基金的半年度报告	
	（1）基金的资产净值	
	（2）基金的份额净值	
	（3）基金份额的申购、赎回价格	
	（4）基金的总资产、净资产和负债	
	（5）基金的经营情况和投资组合情况	
	（6）基金的未弥补亏损达实收基金总额的5%以上时，基金的净值	
	（7）基金的分配情况	
	（8）基金的季度报告、半年度报告和年度报告	
	（9）基金的临时报告	
第二十部分 基金的 投资	6. 基金的年度报告	
	（1）基金的资产净值	
	（2）基金的份额净值	
	（3）基金份额的申购、赎回价格	
	（4）基金的总资产、净资产和负债	
	（5）基金的经营情况和投资组合情况	
	（6）基金的未弥补亏损达实收基金总额的5%以上时，基金的净值	
	（7）基金的分配情况	
	（8）基金的季度报告、半年度报告和年度报告	
	（9）基金的临时报告	
第二十一部分 基金的 投资	7. 基金的临时报告	
	（1）基金的资产净值	
	（2）基金的份额净值	
	（3）基金份额的申购、赎回价格	
	（4）基金的总资产、净资产和负债	
	（5）基金的经营情况和投资组合情况	
	（6）基金的未弥补亏损达实收基金总额的5%以上时，基金的净值	
	（7）基金的分配情况	
	（8）基金的季度报告、半年度报告和年度报告	
	（9）基金的临时报告	
第二十二部分 基金的 投资	8. 基金的停牌、复牌及暂停上市、恢复上市	