(上接A31版)

资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商一致,本基金将暂停基金估值;⑥摆动定价。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时,可能对投资者具有一定的潜在影响,包括但不限于不能申购本基金、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于7日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

5)变现风险:投资组合的变现能力较弱所导致基金收益变动的风险。当持有的部分债券品种的交投不活跃、成交量不足时,资产变现的难度可能会加大。同时,由于基金持有的某种资产集中度过高,导致难以在短时间内迅速变现,有可能导致基金的净值出现损失。

(3)信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,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,信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

2、操作风险

在基金运作过程中,因基金管理人内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等会导致操作风险,主要包括人为错失、违法行为、未授权活动、人员流失等营运风险、技术风险和决策及程序风险等。

3、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、获取的信息不全、投资决策操作出现失误,都会影响基金的收益水平。

4、合规性风险

投资的合规性风险是指本基金的投资运作不符合相关法律、法规的规定和基金合同的要求而带来的风险。

5、投资股指期货的风险

本基金可投资于股指期货,股指期货作为一种金融衍生品,具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。具体为:

(1)市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险;

(2)流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险;

(3)基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险,以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险;

(4)保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险;

(5)信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险;

(6)操作风险是指由于内部流程的不完善、业务人员出现差错或者疏漏,或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

6、资产支持证券的风险

本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券,基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资,但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险,可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。

7、本基金的特有风险

本基金采用量化模型构建投资组合,其主要工作流程包括采集数据、分析数据、计算结果等几个部分,分别蕴含了数据风险、模型风险等。

(1)数据风险

建立量化模型需要上市公司基本财务数据、卖方分析师预期及评级数据、二级市场交易行情数据以及各类宏观数据,这些数据规模庞大,在搜集、采集、预处理等过程中均可能出现错误,从而对最终结果造成影响。

(2)模型风险

1)本基金采用量化模型仅用于选股操作,不基于量化策略进行程序化交易;

2)短期内存在单一量化模型失效的风险。不论何种模型,都是建立某些假设前提下、根据一定的理论和工具得出的结果,随着市场的变化,假设前提有可能改变,理论和工具也有可能存在适用性的问题。

8、其他风险

(1)因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险;

(2)对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;

(3)因业务竞争压力可能产生的风险;

(4)战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失,影响基金收益水平,从而带来风险;

(5)其他意外导致的风险。

二、声明

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金,须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过基金销售机构代理销售,但是,基金资产并不是销售机构的存款或负债,也没有经基金销售机构担保收益,销售机构并不能保证其收益或本金安全。

第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

一、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和《基金合同》约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案,决议自表决通过之日起生效,并自生效后方可执行,自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

二、《基金合同》的终止

有下列情形之一的,在履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;

2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

3、《基金合同》约定的其他情形;

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序:

(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

(3)对基金财产进行估值和变现;

(4)制作清算报告;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7)对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。

6、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

7、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

8、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

9、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

第十八部分 基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金管理人简况

名称:农银汇理基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层

法定代表人:于进

设立日期:2008年3月18日

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2008]307号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1,750,000,001元人民币

存续期限:持续经营

联系电话:021-61095588

(二)基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)按照规定召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;

(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;

(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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:

(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制基金定期报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(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;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三)基金托管人简况

名称:中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号(100032)

法定代表人:易会满

成立时间:1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号:国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号)

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币35,640,625.71万元

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3号

(四)基金托管人的权利与义务

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:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、期货账户及投资所需其他账户,为基金办理证券、期货交易资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(5)依法接受基金托管人的监督;

(6)按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户及投资所需的其他账户,按照《基金合同》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;

(7)保守基金商业秘密,除《基法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不向他人泄露;

(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

(10)对基金财务会计报告、基金定期报告出具意见,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》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

(11)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

(12)建立并保存基金份额持有人名册;

(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

(14)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《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;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(五)基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

(1)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;

(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(7)监督基金管理人的投资运作;

(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1)认真阅读并遵守《基金合同》;

(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;

(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

(4)缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;

(6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;

(7)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;

(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金基金份额持有人大会不设立日常机构。

(一)召开事由

1、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,但法律法规、中国证监会和本基金合同另有规定的除外:

(1)终止《基金合同》;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)变更基金投资目标、范围或策略;

(9)变更基金份额持有人大会程序;

(10)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

(11)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(12)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(13)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在不违反法律法规规定和基金合同约定,且对基金份额持有人利益无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:

(1)调低应由基金承担的费用(基金管理费、基金托管费除外);

(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3)调整本基金的申购费率、调低赎回费率、增加、取消或调整基金份额类别设置或变更收费方式;

(4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(5)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化;

(6)基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则;

(7)基金推出新业务或服务;

(8)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二)会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集,并自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人,基金管理人应当配合。

4、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。

5、代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,单独或合计代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三)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、召开基金份额持有人大会,召集人应于会议召开前30日,在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:

(1)会议召开的时间、地点和会议形式;

(2)会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;

(3)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;

(4)授权委托证明的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

(5)会务常设联系人姓名及联系电话;

(6)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7)召集人需要通知的其他事项。

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、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。

3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

(四)基金份额持有人出席会议的方式

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及监管机关允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。

1、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。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

(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50%(含50%)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他形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大会公告载明的其他形式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(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)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3)本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50%(含50%);

(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,并与基金登记机构记录相符;

(5)会议通知公布前报中国证监会备案。

3、重新召集基金份额持有人大会的条件

若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第1款第(2)项或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在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第2款第(3)项规定比例的,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,到会者所持有的有效基金份额或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有效基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

4、在不与法律法规冲突的前提下,基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开,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。

5、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式,具体方式在会议通知中列明。

(五)议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项(法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外)。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1)现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(2)通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

(六)表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

1、一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并(法律法规、中国证监会另有规定或《基金合同》另有约定的除外)应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(七)计票

1、现场开会

(1)如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

(八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。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。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九)本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和《基金合同》约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案,决议自表决通过之日起生效,并自生效后方可执行,自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

(二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,在履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;

2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

3、《基金合同》约定的其他情形;

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序:

(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;

(3)对基金财产进行估值和变现;

(4)制作清算报告;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7)对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限相应顺延。

(四)清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

(五)基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六)基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七)基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用等由败诉方承担。

争议处理期间,相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

第十九部分 托管协议摘要

一、基金托管协议当事人

(一)基金管理人

名称:农银汇理基金管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区银城路9号50层

法定代表人:于进

成立时间:2008年3月18日

批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会证监许可[2008]307号

注册资本:1,750,000,001元人民币

组织形式:有限责任公司

经营范围:基金募集;基金销售;资产管理;中国证监会许可的其他业务(涉及行政许可的凭许可证经营)

存续期间:持续经营

电话:021-61095588

传真:021-61095556

联系人:翟爱东

(二)基金托管人

名称:中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号(100032)

法定代表人:易会满

电话:(010)66105799

传真:(010)66105798

联系人:郭明

成立时间:1984年1月1日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币35,640,625.71万元

批准设立机关和设立文号:国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号)

存续期间:持续经营

经营范围:办理人民币存款、贷款、同业拆借业务;国内外结算;办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务;代理资金清算;提供信用证服务及担保;代理销售业务;代理发行、代理承销、代理兑付政府债券;代收代付业务;代理证券投资基金清算业务(银证转账);保险代理业务;代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务;保管箱服务;发行金融债券;买卖政府债券、金融债券;证券投资基金、企业年金托管业务;企业年金受托管理服务;年金账户管理服务;开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务;资信调查、咨询、见证业务;贷款承诺;企业、个人财务顾问服务;组织或参加银团贷款;外汇存款;外汇贷款;外币兑换;出口托收及进口代收;外汇票据承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券;自营、代客外汇买卖;外汇金融衍生业务;银行卡业务;电话银行、网上银行、手机银行业务;办理结汇、售汇业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一)基金托管人对基金管理人的投资行为