

(上接A22版)

申购、转换等原因导致其单个基金账户内剩余的基金份额低于前述最低限制时,登记机构可对被申购的基金份额自动进行强制赎回处理。C类基金份额持有人个人交易账户中的最低持有份额为5,000份,不得低于C类基金份额最低持有要求时,登记机构对C类基金份额投资者在该基金账户保留的C类基金份额全部降级为A类基金份额。

4.本基金对单个基金份额持有人持有基金份额的数量不设上限。
5.基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

六、申购费用和赎回金额的计算方式
本基金的基金份额净值保持为人民币1.00元,且不收取申购费和赎回费。
本基金申购份额、赎回金额的计算方式如下:

1.申购份额的计算
本基金申购份额的计算方式如下:
申购份额=申购金额/1.00元
申购份额四舍五入方式保留到小数点后两位,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例:假定T日申购金额为710,000元,则投资者可获得基金份额计算如下:
申购份额=10,0001.00/1.00=0.000份

赎回金额的计算
本基金赎回金额的计算方式如下:

全部赎回:
赎回金额=赎回份额×1.00元+待结转的未支付收益
部分赎回:

①投资者部分赎回基金份额时,如其账户中的累计未支付收益为正或该赎回完成后剩余的基金份额按照每份1.00元为基准计算的价值足以弥补其累计至该日的未付收益时,赎回金额按如下公式计算:

赎回金额=赎回份额×1.00
赎回金额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

②投资者部分赎回基金份额时,如其该笔赎回完成后剩余的基金份额按照每份1.00元为基准计算的价值不足以弥补其账户中累计至该日的未付收益值时,则将自动按部分赎回份额占投资者账户总份额的比例结转前未付收益,赎回金额按如下公式计算:
赎回金额=赎回份额×1.00+赎回份额按比例结转的未付收益

其中,赎回份额按比例结转的未付收益=申请赎回的基金份额/基金总份额×账户当前累计未付收益

赎回金额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

七、赎回费用
投资者在T日赎回基金份额时,其赎回费用按照其持有的10,000份基金份额,且假设该10,000份基金份额按照结转的未支付收益为15.00元,则赎回金额的计算如下:

赎回金额=10000×1.00+15.00=10015.00元

3.基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定交易方式(如网上交易、电话交易等)进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。

七、申购与赎回的原则
1.投资者在T日申购基金成功后,正常情况下,登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理登记手续,投资者在T+2日有权赎回部分基金份额。

2.基金管理人可在法律法规允许的范围内,在不影响投资者利益的前提下,调整申购赎回原则并公告。

八、拒绝或暂停申购的情形
发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

1.因不可抗力导致基金无法支付赎回款;
2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资者的申购申请;

3.证券交易场所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
4.基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时;

5.基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形;
6.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购时,基金管理人应当发布有关暂停申购的公告并暂停接受投资者的申购申请。如果投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理
发生下列情况时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1.因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款;
2.发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项;

3.证券交易场所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
4.连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回;

5.法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述情形时,基金管理人应在当日中国证监会指定媒体上,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人可在申请赎回时事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式
1.巨额赎回的认定
若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换转出中赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数及基金转换转入中申购申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%,即认为是发生了巨额赎回。

2.巨额赎回的处理方式
当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

①全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。
②部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人会在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下,对当日未获受理的赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

③暂停赎回:连续2日以上(含)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个工作日,并应当在规定媒体上公告。

3.巨额赎回的公告
当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式(在3个交易日)内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告
1.暂停申购或赎回的公告
基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。
2.暂停赎回:基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应依照《信息披露办法》的规定在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

3.转换公告
基金管理人应以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开始本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,提前告知基金托管人与相关机构。

十三、基金的非交易过户
基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及按继承过户、符合法律法规的其他非交易过户。无论在任何种情况下,接收过户的主体均须出示持有本基金基金份额的合法证明。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

十四、基金份额的转托管
基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照原办理赎回申请的方式办理。

十五、定期定额投资计划
基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十六、基金份额的冻结和解冻
基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下冻结和解冻。

第十节 基金的投资

一、投资目标
在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的现金收益。

二、投资方向
本基金投资于以下金融工具,包括:

1.通知存款;
2.短期融资券;
3.中期票据;
4.剩余期限在397天以内(含397天)的债券;
5.央行票据;
6.期限在1年以内(含1年)的债券回购;
7.剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、中期票据;
8.期限在1年以内(含1年)的央行票据;
9.中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

三、投资策略
积极选择具有信用等级、高流动性的短期金融工具,合理安排组合期限,在保证资产安全性的基础上,追求取得稳定的超额收益,从而为投资者提供低风险、收益稳定,可以随到随用的现金管理工具。

四、投资管理
本基金投资决策将综合考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,力求将各类风险控制在最低,在控制投资风险良好流动性的前提下,为投资者获取稳定的收益。主要投资策略包括:

①短期利率水平预期策略
深入分析国家货币政策、短期资金利率波动、资本市场资金面的情况和流动性的变化,研判利率走势形成合理预期,并据此调整配置货币资产的配置策略。

②收益率曲线分析策略
根据收益率曲线的变化趋势,采取相应的投资管理策略。货币市场收益率曲线的形状反映当时短期利率水平之间的关系,反映市场对较短期限经济状况的判断及对未来短期经济走势的判断。当预期收益率曲线将变陡峭时,买入期限相对较短的货币资产卖出期限相对较长的货币资产;当预期收益率曲线将变平坦时,则买入期限相对较长的货币资产卖出期限相对较短的货币资产。

③组合剩余期限策略
通过对组合资产期限的设计、跟踪、调整,达到保持预期的现金流,锁定组合剩余期限,以满足组合的、突发的现金流需求,同时保持组合的稳定收益;特别在债券投资中,根据收益预期的情况,设定一定期限的持仓,锁定收益,防范风险,满足组合目标期限。

④流动性品种配置策略
在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的资产配置比例;再通过评估各类资产的流动性与收益性差异,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

⑤动态投资策略
根据货币投资品种的市场特性,采用持续滚动投资的方法,以提高基金资产的整体持续变现能力。如,对7天以内期限的资产进行每天等量配置,提高基金资产的流动性;在公开市场发行利率与央行每周的协议发行,持续滚动配置资产,达到利率期限的匹配分布。

六、流动性管理
本基金紧密关注申购赎回现金流情况,于季性资金流动、日均交易等,建立组合流动性预期指标,实现对基金资产的动态化管理。在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下,通过基金资产安排(包括现金库存、资产变现、剩余期限管理以及其他措施),确保基金资产的整体变现能力。

五、投资决策
1.决策依据
①投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;
②投资决策须符合宏观经济形势、微观经济运行状况、货币政策和财政政策执行状况、货币市场和证券市场运行状况及市场走势;
③投资决策须符合各独立完成相应的研究报告,为投资决策提供依据。

六、决策程序
本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理制。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中密切配合,又责任明确,在各岗位职责按照业务程序独立工作并合理相互制衡。具体的决策流程

如下:

①投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规,决定公司针对市场或市场重大变化所采取的措施;决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整;根据基金投资目标和市场的判断决定基金的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案等重大投资决策;
②分析师根据宏观经济走势主要是走势等进行分析,提出分析报告;

③定期不定期召开投资决策委员会,基金经理人在充分听取各分析师意见的基础上,确立公司在宏观经济走势下的投资观点;
④基金经理根据投资决策委员会的决议,参考研究员提出的报告和基金经理例会观点,并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险,制定具体资产配置和调整计划,进行投资组合的构建和日常管理。

⑤基金经理下达交易指令到交易所进行交易,交易部依据基金经理的指令,制定交易策略并执行交易;

⑥定量分析师负责完成投资组合事前、事中、事后的风险评估与控制;
⑦投资决策分析师负责完成内部基金业绩评价,并编写有关评价报告;

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序做出调整。

六、业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有期限灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资目标、投资目标及流动性特征,本基金选取通知七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

如今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经与托管人协商一致,一致后,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,平均剩余期限控制在120天以内,属于低风险、高流动性、预期收益稳定的基金产品。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

八、投资管理
1.组合限制
①本基金不得投资于以下金融工具:

②股票、股指期货;
③可转换债券;
④剩余期限超过397天的债券;

⑤信用等级在AAA级以下的企业债券;
⑥非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;

⑦中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制时,履行适当程序后,基金投资不受上述限制。

2.投资组合比例限制
①本基金投资组合比例限制
②本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过该证券的10%;

③本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的30%,根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款,可不受此限制;

④本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余期限超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;本基金不得投资于以定期存款利率为基础的浮动利率债券,但市场条件发生变化后有规定的,从其规定;

⑤本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑥本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑦本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑧本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑨本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑩本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑪本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑫本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑬本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑭本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑮本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑯本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑰本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑱本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑲本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

⑳本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉑本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉒本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉓本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉔本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉕本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉖本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉗本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉘本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉙本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉚本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉛本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉜本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉝本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉞本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㉟本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊱本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊲本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊳本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊴本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊵本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊶本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊷本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊸本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊹本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊺本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊻本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊼本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊽本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊾本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

㊿本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券总量的10%;

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方为基金管理人,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人(基金资产净值、每万份基金已实现收益和7日年化收益率的计算结果对外予以公布)。

四、估值程序
①每万份基金已实现收益是按照相关法规计算的每万份基金份额的日实现收益,精确到小数点后