(上接A21版)

财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级 证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货而市场基金、易 方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华阔元大保本流 合型证券投资基金、除驱对月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国国存业收债债券型证券投资 管型证券投资基金、东盛双月红一半期定期升版何券空证券投资基金、高国国有企业何应券空证券投资基金、富安信息信用主题论刘城值债券型证券投资基金、银本的长城户深2001档数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、加票长城最益货币市场基金、万家市政党债产期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、第实活期宝货币市场基金。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

(二)基金托官人批別中部从與近世時時度 16073 1、内部於明目标 严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作。 格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护 基金份额持有人的合法权益。 风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控

制工作进行进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业 务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。 3. 内部控制制度及措施 **国条玄统 完善的制度控制体玄 建立了管理制度 控制制度 岗位职责 业条操作资程 可以保证**和

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度,控制制度,岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核,审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管,存放,使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效。专门设置业务操作区,并实施封闭管理和音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整,独立。
(三)基金托管人对基金管理人还作基金进行监督的方法和程序基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统。每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等的数基金管理人的其他行为

的投资指令等監督基金管理人的其他行为。 当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理: 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰基金管理有限公	地址:上海浦东世纪大道100号上海环球金融中心39楼	
		电话:021-38561759	传真:021-68775881
		客户服务专线:400-888-8688,021-38569000	
		网址:www.gtfund.com	
2	国泰基金管理有限公司北京直销柜会	地址:中国北京市西城区金融大街7号第5层	
		电话:010-66553055	传真:010-66553082
		联系人:吉?青珂莫	
3	国泰基金电子交易平	网站:www.gtfund.com 登录网上交易页面	
	台	电话:021-38561841	联系人:沈茜
2 ## 4h	销售机构	•	

1)中国农业银行股份有限公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层 去定代表人: 蒋超良

2)其他销售机构:具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相

名於:国泰基金管理有限公司 住所:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 办公地址:上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼 法定代表人:陈勇胜

联系人:何晔 传真:021-38561800

客户服务专线:400-888-8688,021-38569000 (三)出具法律意见书的律师事务所

住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼 办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼 市青人:蚌畑

名称:上海市通力律师事务所

传 真:021-31359600 联系人:孙睿 经办律师:黎明,孙睿 (四)审计基金财产的会计师事务所 名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼 办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信 联系电话:(021)23238888

经办注册会计师:汪棣、屈斯洁 联系人:魏佳亭

(一)其全募集的依据

市企业日基立自建入区积、基本证价。(返下40次》、《时售90次》、基立咨问及其他有关规定,并完计证监会2014年1月6日证监许可【2014】33号文(《关于核准国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金募的出复》)注册募集。 (二) 基金类型和存续期限 1.基金类型,混合型证券投资基金。) 2、基金运作方式:契约型开放式 3、基金的存续期间:不定期

)募集方式 通过各销售机构公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的

問整销售机构的相关公告。

(四)募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。 万)募集对象

六,基金的墓集

h基金管理人依昭《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定、并经中

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及

《宏观以开国证品云元广约实证为实现都运出等的取取人。 (六) 為集股份 本基金的募集份额总额应不少于2亿分,基金募集金额应不少于2亿元人民币。 (七) 基金份额初始面值、纵约价格及计算公式、认购费用 1、本基金份额初始面值为人民币1.00元,按初始面值发售。

募集期内投资人可多次认购本基金,认购费率按每笔认购申请单独计算。 本基金认购采用金额认购的方式,认购费率如下

M<100∑ 0.60% 100万≤M<300 300万≤M<500万 按笔收取,1000元/

基金认购费用不列入基金财产, 主要用于基金的市场推广, 销售, 登记等募集期间发生的各项费用 3.募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息转份额以 登记机构的记录为准。 4.基金认购份额的计算 (1)认购费用适用比例费率时,认购份额的计算方法如下: 净认购金额=认购金额(1+认购费率) 认购费用=认购金额—净认购金额 认购份额=(净认购金额—补)购资金利息)/1.00元 (2)认购费用15间等金额14.10%的数分数分别。

(2)认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下: 认购费用 = 固定金额

净认购金额=认购金额 - 认购费用

按照四舍五人方法,保留到小数点后2位,由此误差产生的损失由基金资产承担,产生的收益归基金资产

、购份额数为: 净认购金额=50,000.00/(1+0.60%)=49,701.79元

人购费用=50,000.00-49,701.79=298.21元 人购份额=(49,701.79+10.50)/1.00=49,712.29份 即:该投资人投资50,000.00元认购本基金,假定募集期产生的利息为10.50元,可得49.712.29份基

(八)基金认购的安排

以次分别的 投资人认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金销售机构确定,请参见本基金的基

金份额发售公告或基金销售机构的相关公告。 2、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或基金销售机

及以八のペライル語が加速度とはフストで和タイドンル生ナタ、ドルイルを基立り都立て可能な自然では基金で開始的相关业务が理规则。 3. 基金份額的认购采用金額认购方式。投资人认购本基金时,需按照销售机构规定的方式全额缴款。 若资金未全额到账则认购无效,基金管理人将认购无效的款项退回。 投资人在募集期内可多次认购,认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。投资人的认购申请

4、02900m00 当日(T日)在规定时间内提交的认购申请,投资人通常应在T+2日到原销售机构查询认购申请的受 ick。 基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申

清。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。 Q资人单笔认购最低金额为100.00元(含认购费)。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差

及於人单笔认购最低金额为100.00元(百以购页/。三元/ 他规定的,以各销售机构的业务规定为准。 建金管理人可根据市场情况,则整本基金认购和追加认购的最低金额或累计认购金额。 (九)基金募集期间募集的资金应当存人专门账户,在基金募集结束前任何人不得动用。 七、基金合同的生效

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿

元人民币目基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止 基金发售,并在10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备 基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之 曰起,(基金合同) 生效;否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存人专门账户,在基金募集行为

基金合同不能生效时募集资金的处理方式 (二)基金合同不能生效时募集资金的处理方式 如果募集期限届满,未满足基金备案条件,基金管理人应当承担下列责任: 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用; 2.在基金募集期限届满后30日内返还投资人上缴纳的款项,并加计银行同期存款利息; 3.如基金募集失败,基金管理人,基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和 销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 (三)基金存续期内的基金份赖持有人数量和资产规模 。其金金用类期内的基金份赖持有人数量和资产规模

(三)基金行项明内的基金订配付有人数量和页广水原 《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理 \应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因 基金资产净值连续60个工作日低于5000万元,经与基金托管人协商一致,基金管理人有权直接终止

合同进行清算,无须召开基金份额持有人大会。 法律法规另有规定时,从其规定。 八、基金份额的申购与赎回

(一) 中與科與但地所 本基金的即身上赎回將通过销售机构进行。基金管理人可根据情况变更或增減销售机构,并予以公基金投资人应当按销售机构提供的方式办理基金份额的申购与赎回。 (二)申购和赎回的开放日及时间

基金份额时,申购生效。

E常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申

基金合同生效后,若出现新的证券/期货交易市场,证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况, 基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》 有关规定在指定媒体上公告 . 由购, 赎回开始日及业务办理时间 基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告

中规定。 在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人

赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。 1、"未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算; "金额申购,份额赎回"原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请:

公、並與中國、仍須吸亞」於20%,如中國以並被中項、第四級的源中項; 3、当日的申詢与與同申請可以在基金管理人規定的时间以内撤销; 4、赎回遵循"先进先出"原则、即按照投资人认购。申购的先后次序进行顺序赎回。 基金管理人一百在法律法规分许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施 照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项。投资人交付申购款项时,申购成立;登记机构确认

基金份额持有人递交赎回申请时,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。投资人赎回申请成功

基金份納得有人或交赎回申询时,赎回成立,登记机构确认赎回时,赎回生效。投资入赎回申询成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。
3.申购和赎回申请的确认
基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后包括该日及时到销售机构柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不申时,则申购验证明证公益的各

成功,则申购款项退还给投资人。 销售机构对申购,赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购,赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。 万)由购和赎回的数量限制

1、中國並經過7月2月 投资人单笔申购的最低金额为100.00元(含申购费)。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级

2.赎回份額的限制 投资人可将其全部政部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份数为100.00份,若某投资人赎回时在 销售机构保有的基金份额不足100.00份,则该次赎回时必须一起赎回。 3.本基金不对投资人每个基金交易帐户的废低基金份额余额进行限制,但各销售机构对交易账户最 低份额余额有其他规定的。以各销售机构的业务规定为准。 4.本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实 施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。 (六)申购与赎回的费率

四条用由投资人承担,不列人基金财产,主要用于本基金的市场推广,销售,登记等各项费用。 投资人一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算,申购费率如下

中购金额(M)	中购货单
M<100万	0.80%
100万≤M<300万	0.50%
300万≤M<500万	0.30%
500万≤M	按笔收取,1000元/笔
2、赎回费用	

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,全部或 部分归入基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费,将全额计入基金财产;对持续持有期长于30日且少于3个月的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3 个月但少于6个月的投资人收取的赎回费,将不低干赎回费总额的50%计人基金财产;对持续持有期长于 6个月的投资人,将不低于赎回费总额的25%归入基金财产 本基金的赎回费率随基金份额持有时间增加而递减,赎回费率如下:

1.50% 30 ∃ ≤ Y <6↑ 6个月≤Y<15 1年≤Y<2年 注·睦同份额持有时间的计算 以该份额在登记机构的登记日开始计算 1年为365天 2年为730天

、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式 实施目前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。 4. 基金管理人可以在不违反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,针对以特定交易方式(如风上交易,电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申

额,净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额,各计算结果均按照四舍五人方法,保留小数点后2位,由 此误差产生的损失由基金资产承担,产生的收益归基金资产所有。

(1)由购费用活用比例费家时 由购份额的计管方法加下。

(1) 申购發用追用比例致率时,申购份額的订算万法如 | 净申购金額、日中购免额(1 中申购登率 申购费用=申购金額一净申购金額 申购份額—申购金額「日基金份額净值 (2) 申购费用为固定金额时,申购份额的计算方法如下: 申购费用=固定金额

申购份额=净申购金额/T日基金份额净值 例:某投资人投资50,000.00元申购本基金,对应费率为0.80%,假设申购当日基金份额净值为1.128

元,则其可得到的申购份额为: 净申购金额=50,000.00/(1+0.80%)=49,603.17元 由购费用=50 000 00-49 603 17=396 83元

自购份数=49 603.17/1.128=43 974.44份 即投资人投资50,000.00元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.128元,则可得到43,974.44

基金份额。 4、縣田金額的计算 姚田金額的计算方法如下: 姚田金額 = 姚田份額 × 下日基金份額净值 姚田费用 - 姚田登和 《相应的姚田费率 净縣田金額=姚田金額 - 姚田费用 例:某投资人持有本基金50,000.00份基金份额,持有7个月时决定赎回,假设赎回当日基金份额净值

1.250元,则其获得的赎回金额计算如下: 赎回金额=50,000.00×1.250=62,500.00元 赎回费用=62,500.00×0.10%=62.50元 净赎回金额=62,500.00-62.50=62,437.50元

即投资人赎回持有7个月的50 00000份基金份额,假设赎回当日基金份额净值为1.250元,则其获得

是目录像为962.4373076。 5、本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五人,由此产生的收益或损失由 速防予承担,T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。 週特殊情况,经中国证监会同可以适当延迟计算或公告。) 拒绝或暂停申购的情形 下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请: 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。 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人的申购申请。

3、证券/期货交易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。 、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 从而损害现有基金份總持有人利益的情形。
6. 法律法规规定或中国证金公认定的其他情形。
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接受投资人申购申请时,基金管
从应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝、被拒绝的申购
原格担还给投资人,在暂停申购的情况消除的,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
发生下别情形付,基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:
1.因不可抗力导或基金管理人不能支付赎回款项。
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人的赎回申请或延缓
+被回数项。

3、证券/期货交易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。

3.证券/用质文参所交易的用单正吊停巾,寻致基金管理人况法订算自己基金资产停值。
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。
发生上述情形之一目基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日中国证监会备案,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。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部 予以撤销。在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并 , (十)巨麵睫回的情形及处理方式

1.巨额眼间的认定 若本基金单个开放日内的基金份额净眼回申请(駅间申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总 数后扣除申期申请份额总数及基金转换中转人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。 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

(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

一开放日基金总分额的70%的朋费,可对具余赎回申请处期办理。对于当日的赎回申请。应当校里个账户赎回申请是请收回申请总量的投户,在定当日受理的赎回的需,对于未能赎回部分,投资人在提之赎回申请时可以选择延期赎回成取消赎回。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按减销,延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在建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(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的原因申请。是经验的赔偿由请可以系统法处据问题。但不需提到中心人工作日土还以本货物经收益。 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,并应当在指定媒体上进 3.巨麵赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时 甚全管理人应当通过邮客 传真或者本甚全管理人网站在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 (十一)暫停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1、发生上述暫停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内在 聚体上刊登暂停公告。 、如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎

回公告,并公市最近1个开放目的基金份额净值。 3.如发生暂停的时间超过日,基金管理人口以根据暂停申购或赎回的时间,依照《信息披露办法》的有关规定。是迟于重新开放日在指定破床上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办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,并提前告知基金托管人与相关机构。 十三)基金的非交易讨户

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 及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法 以持有本基金基金份额的投资人。 继承星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 继承定律基金设计帧行有人次让,具好有的基金分额社具合法的继承人基本,排则自由基金财制的月 将其合法持有的基金份额捐赠给福利性成的基金会设在关闭体。请达强制执行是指司法机构依据生效司 法文书格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 须据供基金登记机构即实进供的相关资料,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。

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规定 的标准收取转托管费。 (十五)定期定额投资计划

上的元章。 基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理 定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额。每期申购金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新 的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)基金的废结和解陈 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的冻结与解冻。 九、基金的投资

)投资范围

板及其他終中国证监会核准上市的股票)、权证,股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工 具色括国债,央行票据。金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债,地方政府债券,中期票据、可 转换债券(合分离交易可转债),短期融资券,资产支持证券、债券回购、银行存款等,及法律法规或中国

证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定 证监会允许基金投资的具值金融且具(但观对合于国证监会的相关规定)。 法律法规或监管制规则后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳人 投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。 本基金投资组合资产配置比例,股票资产占基金资产的0%-95%;投资于债券、债券回购、货币市场 工具,银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的5%;中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于20%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易 保证金后,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

(三)投资策略 本基金采用积极灵活的投资策略,通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益,完成大类资产配置 在大类资产配置的基础上,精选个股,完成股票组合的构建,并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上,力争实现长期稳健的绝对收益。 1、大类资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资 本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,主动调整股票、债券类资产在给定时间区间内的动态配置,以使基金在保持总体风险水 与基础上,优化投资组合。 本基金股票投资以定性和定量分析为基础,选择估值合理、具有较高安全边际和盈利确定性的股票

17日间水平口建 基基金将根据公司所处的行业,采用包括市盈率法,市净率法、市销率、PEG,EV/EBITDA等方法 司股票价值进行评估,分析该公司的股价是否处于合理的估值区间,以规避股票价值被过分高估所 隐含的投资风险。 2)盈利具有确定性 本基金利用总资产报酬率、净资产收益率、盈利现金比率(经营现金净流量/净利润)指标来考量公

司的盈利能力和质量。此外,本基金还将关注公司盈利的构成、盈利的主要来源等,全面分析其盈利能力 3)未来增长潜力强 公司未来盈利增长的预期决定股票价格的变化。因此,在关注公司历史成长性的同时,本基金尤其) 注其未来盈利的增长潜力。本基金将对公司未来一至三年的主营业务收入增长率、净利润增长率进行预

注其未来盈利的增长潜力。本基金将对公司未来一至三年的主宫业务收入官区举、伊利明电区举瓜)」以测,并对其可能性进行判断。
(2) 定性分析
在定量分析的基础上,本基金结合定性分析筛选优质股票,定性分析主要判断公司的业务是否符合
经济发展规律,产业政策方向,是否具有较强的竞争力和良好的治理结构。
根据定性分析结果,选择具有以下转征的公司股票重点投资:
1) 符合经济结构调整,产业升级发展方向;

2) 具备一定竞争壁垒的核心竞争力: 规范的内部管理;

行投资,旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

基金的投资组合应遵循以下限制:

同关于股票投资比例的有关约定:

本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括:久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。 艮据国内外的宏观经济形势、经济周期、国家的货币政策、汇率政策等经济因素,对未来利率走势做

出准确预测,并确定本基金投资组合久期的长短。 考虑到收益率变动对久期的影响,若预期利率将持续下行,则增加信用投资组合的久期;相反,则缩 短信用投资组合的久期。组合久期选定之后,要根据各相关经济因素的实时变化,及时调整组合久期。 考虑信用溢价对久期的影响,若经济下行,预期利率将持续下行的同时,长久期产品比短久期产品将 面临更多的信用风险,信用溢价要求更高。因此应缩短久期,并尽量配置更多的信用级别较高的产品。

初欧红色凤帽 到际国内经济形势 国家的货币政策 汇索政策 货币市场的供需关系 投资人对去来利率的预 体般国际国内经历70岁,国家的员门取来。几率取来,员门印加印铁市大东、农政人对木 民国素。对政益率曲线的变动趋势包变动幅度做出预测,收益率电线的变动趋势包括:向1 、平行移动、曲线趋缓转折、曲线陡峭转折、曲线正螺式移动、曲线反螺式移动,并根据变动 死预测火决定信用投资产品组合的期限结构,然后选择采取相应期限结构策略:子弹策略、、

特式集吧。 若预期收益曲线平行移动,且幅度较大,宜采用杠铃策略;若幅度较小,宜采用子弹策略,具体的幅度 临界点运用测算模型进行测算。若预期收益曲线做趋缓转折,宜采用杠铃策略。若预期收益曲线做陡峭转 折,且幅度较大,宜采用杠铃策略;若幅度较小宜采用子弹策略;用做判断依据的具体正向及负向变动幅 度临界点,需要运用测算模型进行测算。

(3)个券选择策略 1)特定跟踪策略 1.74% 定联场采记 结定具指基类或基个信用产品且有基种特别的结占 这种结占会造成此类信用产品的价值被高估成

特定是指某类或某个信用产品具有某种特别的特点,这种特点会造成此类信用产品的价值被高估或 者低估。特定跟踪填贴,就是塑粗熔存定信用产品的特定特点,进行强踪和选择。在所有的信用产品中,身 技在持有铜内级别上调可能性比较大的产品,并进行和置,对在专有铜内级别广调可能性比较大的产品, 要进行规避。判断的基础就是对信用产品进行持续内部跟踪评级及对信用评级要素进行持续跟踪与判 断,简单的做法就是跟踪特定事件。国家特定政策及特定事件变动态势,行业特定政策及特定事件变动态 为,公司特定事件变动态势,并对特定政策及事件对于信用产品的级别变化影响程度进行评估,从而决定 对于特定信用产品的取舍。 2)相对价值策略 本策略的宗旨是要找到价值被低估的信用产品。属于同一个行业、类属同一个信用级别且具有相近 期限的不同债券,由于息票因素,流动性因素及其他因素的影响程度不同。可能具有不同的收益水平和收 起变动趋势,对同类债券的利差收益进行分析,找到影响利差的因素,并对利差水平的未走势做出判 断,找到价值被低估的个券,进而相应地进行债券置换。本策略实际上是某种形式上的债券互换,也是寻 求相对价值的一种投资选择策略。 这种投资策略的一个切实可行的操作方法是:在一级市场上,寻找并配置在同等行业、同等期限。同

这种投资策略的一个切实可行的操作方法是:在一级市场上,寻找并配置在同等行业、同等期限、同 等信用级别下拥有较高票面利率的信用产品;在二级市场上,寻找并配置同等行业、同等信用级别、同等票面利率下具有较低二级市场信用溢价(价值低估)的信用产品并进行配置。

票面利率下具有较低二级市场信用鑑价(价值低估)的信用产品开进行配置。 (4)中小企业私募债投资策略 利用自下而上的公司、行业层面定性分析,结合Z-Score、KMV等数量分析模型,测算中小企业私募 债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异、根据自上而下的宏观经济及 行业特性分析、从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与 通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异,结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。 4、股指期货投资策略 本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进

(1)套保时机选择策略 (17会深的机态)异深阳 根据本基金对经济周期运行不同阶段的预测和对市场情绪、估值指标的跟踪分析,决定是否对投资 组合进行套期保值以及套期保值的现货标的及其比例。 (2)期货合约选择和头寸选择策略 在套期保值的现货标的确认之后,根据期货合约的基差水平,流动性等因素选择合适的期货合约;运用多

量化模型计算套期保值所需的期货合约头寸;对套期保值的现货标的Beta值进行动态的跟踪,动态的

调整套期保值的期货头寸。 网面经另所帐间的别页交叉。 (3)展讲策略 当套期保值的时间较长时,需要对期货合约进行展期。理论上,不同交割时间的期货合约价差是一个 确定值,现实中,价差是不断波动的。本基金将动态的跟踪不同交割时间的期货合约的价差,选择合适的

足被迫平仓导致的套保失败。 (5)流动性管理策略 利用股指期货的现货替代功能和其金融衍生品交易成本低廉的特占 可以作为管理现货流动性风险 的工具,降低现货市场流动性不足导致的交易成本过高的风险。在基金建仓期或面临大规模赎回 模的股票现货买进或卖出交易会造成市场的剧烈动荡产生较大的冲击成本,此时基金管理人将考虑运用 股指期货来化解冲击成本的风险

本基金将根据套期保值的时间、现货标的的波动性动态地计算所需的结算准备金,避免因保证金不

5. 核证投资策略 校证为本基金輔助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值。本基金在权证投资方面将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,立足于无风险套利,尽量减少组合净值波动 (四)投资限制 1、组合限制

(1)股票资产占基金资产的0%-95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法 中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的5%;

, (11)本基金管理人管理的全部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

(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券,基金持有资产支持证券明 间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准。应产评级报告发布之日起3个月内乡以全部类出; (13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股 票数量不超过和发行股票公司本次发行股票的总量; (14)本基金进入全期银行间同业中部进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债 券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展明; (15)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;在 任何之原日日处。核有防卫、组股金分份价值与有价证验书值之和、不稳超过基金资产净值的10%。社口

(16)本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20% (17)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合

金资产净值的20%;
(19) 本基金投资于中小企业私募债的比例不超过基金资产净值的20%,本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(20)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。因证券/明货市场波动。上市公司合并,基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的。基金管理人应当年10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。基金管理人应当自基金合同生效之已起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金管理人应当自基金合同生效之已起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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已起开始。
法法共规则监管部门设置的企业下水规制。加雪用于本基金、基金管理人在履行适当程序后,则本基 法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基

金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

2) 违反规定向他人贷款或者提供担保:

(2) 违反规定问他人贷款或者提供担保; (3) 从事项目无限责任的投资; (4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外; (5) 向其基金管理人,基金托管人出资; (6) 从事内等交易,操纵正转交易价格及其他不正当的证券交易活动; (7) 法律法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,本基金 无重器相关阻碍或形义每重后的相常为难 投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

本基金的业绩比较基准为:五年期银行定期存款利率(税后)+1% 其中,五年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构五年期人民币存款基准利 本基金以享和發展的機動的表情为投資目标。 在目前国内的金融市场环境下 银行完组友款可以近

本基金以实现稳健的绝对收益作为投资目标。在目前国内附金融市场水填下,银行定期存款可以达 使理解分稳健定息产品。因此、本基金采用五年期银行定期存款税后利率,1%作为业绩比较基准,与本 基金追求稳定增值的特点相符,有助于投资人理性衡量本基金的风险收益特征。 如果今后法律法规发生变化、或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布,或证券市场中有其 他代表性里强或者更科学客观的业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金价额持 有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人 同意,并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前在指定媒体上予以公告,而无需召开基金份额持有人

本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。 七)基金的融资、融券、转融通 (C) 基立印刷页、服务、存配型 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、转融通。待基金参与融资融

券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资目标、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金融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、 自息披露 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要求执行 无需召开 十、基金的财产

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 (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。

基金托管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、期货账户以及投资所 需的其他专用帐户 开立的基金专用帐户与基金管理人 基金托管人 基金销售机构和基金登记机构自有 的财产账户以及其他基金财产账户相独立。 (四)基金财产的保管和处分 水基金财产独立于基金管理人,基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金管理

本確立對「「「」」「以下のは、「以下的ない」、「不知的、「我会管理人、基金管理人、基金任管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权、不得与其固有资产产生的债务相互抵销。 十一、基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。 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

基金所拥有的股票。权证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 (三)估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 1、证券交易所工用的对印证券付出信值 (1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价) 估值,估值日元交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格 的重大事件的,以最近交易目的市价、收益价)估值,如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发 行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交 目标。

净值的非交易日。

按最能反映公允价值的价格估值。

济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格; (3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得 到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收 盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

受化的,可参考实识投资品种的现分市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格; (4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术施定允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。 2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理; (1)送股,转增股,危股和公开增发的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价、收盈价,估值; (2)已发行未上市的股票,债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的特担方、按时本任值。 (21) C21 (不上1141) (2023年18月27年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18年18月18 估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值

能及映公元57°11目的57°16°161目。 3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。 1、因持有股票而享有的配股权,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的 下,仅以本心但。 。 同一倍券同时在两个戓两个以上市场交易的 按倍券所外的市场分别估值。 票指数期货合约估值方法: 吗要指数期货合约以结算价格进行估值。 (1) 放票/南欧明过管59以5年的Y的证付的值。 (2) 在任何情况下,基金管理人如果用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的。

基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,调整对处于未上市期间的有价证券的估值方法

(3)国家有最新规定的,按其规定进行估值。 与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

9.相天法律法规以及监管部门有强闸规定的,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形管人及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。根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的父务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就步本基金有关的会计问题,如必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,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

(四)估值程序

(四)估值程序
1.基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第4位四舍五人。国家另有规定的,从其规定。基金管理人每个工作日时算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。
2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

(五)估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基

金份额净值小数点后3位以内含第3位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。 基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1. 估值错误类型

、口息相关关望 **基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人,或登记机构,或销售机构,或投资人自身的

· 全華並紀日近世中,如宋田丁華並自是人及華並打自人、弘皇に700年。 《政府首句记》,就及成人自另前 过精造成估值错误。导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人 ("受损方")的直接损失按下述"估值错误处理原则"给予赔偿,承担赔偿责任。 上述估值错误的主要类型包括但不限于,资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差

公门国国际定型原则 (1)估值销误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值销误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协 调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而表更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责

任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正 (2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有 关直接当事人负责,不对第三方负责。 (3)因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应求

(3) 区估值前误而获得一等得利的当事人贝有及的返处不当得利的义务。但估值前误责任万分应对估值销误责责,如果由于获得不当得利的自事人不适应或不全都及近还不当得利益成其他当事人的利益损失("受损方"),则估值销误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利,如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损力,应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误前整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。
3. 给值错规处理程度。

3、估值错误处理程序 3.恰值销误处理程序 估值销误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下: (1)查明估值销误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责

, (2)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

(3)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失: (4)根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基金登记机构进行更正,并就 的更正向有关当事人讲行确认

基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的

、基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时; 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八)特殊情况的处理 1.基金管理人或基金托管人按基金合同规定的估值方法的第8项进行估值时,所造成的误差不作为 基金资产估值错误处理。 2.由于不可抗力原因,或由于证券、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变 更、市场规则变更等,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要,适当合理的措施进行检查,但未能发 现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金 经营工的基础及对金融经验的基金管理人和基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金

实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。 一)基金可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰任数。

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位 基金份额收益分配金额后不能低于面值; 4、每一基金份额享有同等分配权;

(一)基金费用的种类 1、基金管理人的管理费:

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费相诉讼费; 5.基金份额持有人大会费用; 6.基金的证券、期货交易费用; 7.基金的银行汇划费用; 8.基金的开户费用,账户维护费用; 9.按照国家有关规定和(基金合同)约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 (二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1基金费用计提方法、计提标准和支付方式

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×1.00% - 当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值

一、基金费用的种类中第3-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额 列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

感逝吉思人州感逝打自人的木施打鬼术汽车施订又对寻戏的政府又由或感逝 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; 《基金合同》生效前的相关费用; 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列人基金费用的项目。

3 其全核管以人民币为记账本位币 以人民币元为记账单位 4、会计制度执行国家有关会计制度; ,本基金独立建账,独立核算

二)基金的年度审计 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注 册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。 2、会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。 、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个T

关规定。 (二)信息披露义务人 (二)信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。 本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏; 2、对证券投资业绩进行预测; 3、违规承诺收益或者承担损失

3. 违规承诺收益或者承担损失;
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;
6. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。
(四) 本基金公开按照的信息成果用中文文本、如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。
本基金公开按照的直息采用则拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。
(五)公开按照的基金信息
公开按照的基金信息
公开按照的基金信息包括;
1. 基本规章的组束。《基本全局》基本基础的以

2)基並的時於明十於三眼入院退地级路影門基並以與八代採印土由中深り即引き越 4005、1平2010年 更安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效 后,基金管理人在每6个月结束之日起46日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书 摘要登载在指定媒体上;基金管理人在公告的16日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送 更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明

价,确定公允价格; (2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登

> 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。 1、基金资产净值、基金份额净值 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金

基金管理人应当在上半年结束之日起60日内。编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载 基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载

(1) 建亚切纳伊国门外口地市经时,建亚自建八处当止和"几少时正规实业工的人"开采取占建的 防止损失进一步扩大。 (2) 错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当通根基金托管人并报中国证监会备案; 偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告。 (3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。 (六)暂停估值的情形

而了基础后远级邮记选证员厂产信机经证则顺行信由基金资产净值和基金资产物价单值并发送给基金托管基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金资理外源产值大步运给基金托管基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

(元) 签述伊旭的網絡 用于其全信息披露的其全资产净值和其全份额净值由其全管理人负责计管 其全托管人负责讲行复

托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除的 十二、基金的收益与分配 一)基金利润的构成 基金利润指基金利息收入 投资收益 公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的金额 基金已

基金管理人放在季度设置。 基金管理人放在季度设置。并中度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况。包括投资政策、持仓情况、规益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是名符合既定的投资政策和投资目标。 行收益分配; 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。投资人可选择现金红利或将现金红利自动 转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

七)基金净值的确认

配数额及比例、分配方式等内容 (2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后,保持不低于基金资产净值5%的现 (2)每个交易日日终在印除股指明货合约需缴纳的保证金以后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
(3)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(6)本基金管理人管理的全部基金持有作的一人权证,不得超过该权证的10%;
(7)本基金在任何交易日买人权证的总金缴,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;
(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的0.6%;
(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(10)本基金持有的同一指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 F) 收益分配方案的确定 公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2个工作日内在指定媒体公告并报

资产支持证券合计规模的10%; (12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券,基金持有资产支持证券期 2、基金托管人的托管费: 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

(19) / 特祖的法人期货合约的值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买人返售金融资产

18) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费 划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中

划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
2.基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H = E × 0.25% + 当年天数
出为每日应计据的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费
划款指令,基金杆管为费6日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管负发送基金托管费

(三)不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用: 、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;

十四、基金的会计和审计 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方; 2、基金的单尺分外基础的建设公司正分; 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则;如果 《基金合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度披露;

盛並去日祝祝, 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案 アドロコロ 大阪 (一) 大国 (上国) 大国 (上国) 大国 (一) 本基金的信息披露 (一) 本基金的信息披露が行る(基金法)。(近年办法)、(信息披露办法》、(基金合同》及其他有

人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有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。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不得

基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的机 利,义务关系的法律文件 利、スタアスRIII/GRI+PATF。 基金募集申请经中頃证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基 金合同》摘要登载在指定媒体上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站

信利率以为建金並可納中與吳成自然出力,基金自建入起当任率了开放口的公司,通过內站、基並可納明 信利率以及其他原子,按源于放日的基金份鄉會作用基金份鄉對计净值。 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人 应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定 地址社。

7、临时报告 本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2个工作日内编制临时报告书,予以公告,并在公

| 其今||佐谷公町||同|| . 二/至至权皿/JEDRYI 在符合有关其全分红冬性的前提下 木其全每年收益分配次数昌多为6次 每份其全份额每次收益 不得低于收益分配基准日该次单位可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。 (四)收益分配方案 基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分

划款指令,基金托管人复核后干次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日

、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定

性、准确性和完整性。 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定 的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称"网站")等媒介披露,并保证基金投资人能 够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。 三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

公开政聯的基立自愿包括: 1.基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议 1)《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的 规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资人重大利益的事项的法律文件。 2)基金招募说明书应当最大限度地按腐胀响基金投资人决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎

载于指定媒体上。 3、《基金合同》生效公告

在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在每个开放目的次日,通过网站、基金份额能

5.基金可和中期。原但即位 基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算 方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金份额销售机构查阅或者复制前述信息资料。 6、基金定期报告。包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站 上,将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计

育正察体上。 《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。 基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别找中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中 证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

1)基金份额持有人大会的召开; 2)终止《基金合同》: 3)转换基金运作方式:

)基金管理人股东及其出资比例发生变更

(下转A23版)

)更换基金管理人、基金托管人;)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

9、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

在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上