

(上接A19版)

基金清算的公告
清算过程中有关重大事项应及时公告。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6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文件由基金管理人保存15年以上。

第十七部分 风险提示

一、投资于本基金的主要风险有：
(一) 市场风险
本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：宏观经济波动、国家财政和货币政策、产业政策、地区及属政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2. 经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3. 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，利率直接影响着债券的价格和利息收入，从而影响着基金资产总值。基金投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

4. 上市公司经营风险。上市公司经营受多种因素影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格下跌，或者能够用于分配的利润减少，甚至造成投资亏损，上市公司还可出现无法偿还到期债务，使基金投资于该股票的价值受损，从而使基金资产价值下降。

5. 购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

(二) 信用风险
基金交易对手可能无法履约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而给基金资产造成损失。如在买入债券、买入股票、短期融资券、公司债、短期融资券等信用产品时可能面临发行人不能或不愿及时还本付息的风险，或发行信用评级下降的风险，从而导致基金资产损失。

(三) 管理风险
基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势的判断和决策，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理水平、风控管理和内部控制制度的健全、完善及基金的投资策略、基金持仓比例和基金其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

(四) 流动性风险
我国证券市场对于新兴转型类行业，市场整体流动性风险较高。基金投资组合中的股票、期货和商品合约因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度加大，买入成本或变现成本增加。此外，基金管理人可能面临大额赎回申请，基金管理人可能因此被迫以较低价格卖出投资组合内资产，造成基金资产净值波动。

为了防范流动性风险，本基金将在保持分散化投资和精选个股原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但基金管理人并不能完全避免流动性风险。

(五) 操作及技术风险
基金管理人业务人员在外汇市场的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误，给基金资产带来损失，如交易对手选择、交易品种选择、交易指令输入错误等。

此外，在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者系统升级而影响交易的正常进行甚至导致基金持有人利益受损。这种技术风险可能来自基金管理人、登记机构、销售机构、证券交易场所和证券登记结算机构等。

(六) 合规性风险
指在投资运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险。

(七) 模型风险
指在投资决策、估计资产价值、市场分析和风险估计中采用了错误的估计方法或选择了不恰当的模型而导致投资结果不确定风险。

(八) 本基金特有的风险
1. 物价波动风险
本基金将主要通过阿尔法对冲绝对收益策略，但不能确保策略能完全剥离基金的系统性风险，因而有可能因阿尔法策略失败导致收益损失。

2. 空仓风险
本基金主要采用股指期货构建空头，但不是完全对冲系统性风险，基金管理人根据合同可以持有净头寸或空头头寸，如果发生极端行情，基金管理人可能在某些行情下无法覆盖普遍通胀基金成本，也有可能在特殊情况下发生比普遍通胀型基金更大的损失。

3. 个股投资风险
本基金多采用分散多元基本面分析结合事件驱动策略进行选股，有可能在某些区域本基金买入的股票收益率低于大盘的指数收益率，从而导致基金资产损失。

4. 基金估值风险
在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的原因包括：
(1) 需要对冲的风险资产与股指期货标的指数风险特征存在明显差异；
(2) 因未知因素导致股指期货合约到期时基差严重偏离正常水平；
(3) 因存在基差风险，在合约股指期货合约交割的过程中，基金财产可能会承担股指期货合约之间的价差风险，从而发生变动导致预期展期风险。

1. 杠杆风险
因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

2. 到期日风险
股指期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，中金所将按照交割结算价将资产管理计划财产持有的合约进行交割，资产管理计划财产将继续按照到期合约，具有到期日风险。

3. 期货合约风险
资产管理人运用本基金财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力优良的期货公司作为经纪商，但不能杜绝其资信状况下降，所选择的期货公司资信状况下降，违反期货行业行为准则导致资产管理计划财产遭受重大损失。基金财产在交易过程中存在违约风险。

9. 平仓风险
股指期货采取保证金交易，保证金账户资产当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如如市场走势对本基金不利，期货经纪公司会按照股指期货经纪合同约定期限和时间方式通知资产管理人追加保证金，以便资产管理计划财产继续维持持仓平仓合约。如果出现追加保证金，市场持续不利于市场波动加剧保证金不足，又在规定的追加保证金时限内，未按规定补足保证金或强制平仓，甚至已缴付的所有保证金被强制平仓，从而导致预期内的损失。

9. 平仓风险
在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法按持有的持仓平仓合约平仓，例如，某些行情可能在市场达到涨停跌停时出现。出现此类情况，基金财产缴纳的有保证金合约无法平仓全部损失，委托人或受托人必须自行承担由此导致的全部损失。期货经纪公司对于其保证不足，又在规定的时间内补足，或保证金账户资产被强制平仓，从而导致资产管理计划财产遭受重大损失。

10. 连带风险
为基金财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他结算会员出现保证金不足、又未能在规定的时限补足，因其其他结算会员导致本基金财产结算账户的经纪账户强行平仓时，基金财产的资产可能因被强制平仓而造成基金财产资产损失。

11. 基金资产投资受限资产对象的其他风险
如期货经纪公司违反法律法规或交易所交易、结算等规则，可能会对基金财产受到损失。由国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施出台的等原因，基金财产持有的持仓合约可能无法继续持仓，基金财产必须强制由此导致的风险。

12. 提前终止风险
(1) 基金财产投资受限资产对象，由此可能面临提前结束风险或支付风险。
13. 中小企业私募债券特殊风险
本基金可投资于中小企业私募债券，一般而言，由于中小企业私募债券的发行主体财务能力较弱，因此，中小企业私募债券的信用风险相对较高，信用增级措施有限，其投资风险较大。如果市场流动性收紧或市场对类似类债券估值不同，则投资价值可能面临大幅缩水。中小企业私募债券的转让方式较为特殊，流动性较差，流通受限较大，在实际的债券转让和交易中，由于流动性的匮乏可能给委托资产带来不利的影响。

14. 融资融券的特殊风险
待本基金参与融资融券业务的相关规则发布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金管理人协商一致，参与融资融券业务，可能面临以下风险：
(一) 杠杆风险：融资融券交易利用了一定的财务杠杆，放大了证券投资的盈亏比例，由于高杠杆特征，潜在损失可能成倍放大；
(二) 强制平仓风险：在从事融资融券交易期间，如果不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致担保比例低于从事融资融券业务之初约定的担保比例，且不能按约定时间补足，将会面临被强制平仓的风险；
(三) 信用风险：授信额度是否可用于融资融券的最高限额，如果证券价格波动，融资融券总额或证券品质融资融券交易受限，则存在在投资的标的证券的融资融券额度在某一时点上无法足额履约的可能。另外，如发生信用资质下降风险，证券公司会面临降低对其的授信额度，或者证券公司提高风控警戒线，平仓标的证券的风险，可能会给基金财产造成不利影响；
(四) 流动性风险：如果中国民生银行提供的融资融券合约均构成本基金利率贡献，证券公司将相应提高融资融券利率或调整融资融券业务增大的风险；
(五) 标的证券暂停交易或终止上市的风险：在从事融资融券交易期间，如果发生融资融券标的证券范围调整，可能会给基金财产造成经济损失。

1. 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；
2. 因金融市场危机、流动性紧张、压力测试而引发的风险；
3. 因利率、汇率波动、信用评级下降、违约等严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；
4. 其他意外导致的风险。

一、基金管理人投资于本基金，须自行承担投资风险；
二、基金管理人直接从事本基金的销售外，本基金还通过中国银行基金销售机构销售，基金管理人及基金销售机构均不能保证投资收益或本金安全。

第十八部分 基金合同的内容摘要

(一) 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) 根据《基金合同》生效之日起，根据法律法规及《基金合同》独立运用并管理基金财产；
(3) 收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会许可的其他费用；
(4) 销售基金份额；
(5) 按照有关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》及国家有关法律法规，应及时向中国证监会和其他相关部门报告，并采取必要措施维护基金投资者的利益；
(7) 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管理；
(8) 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取《基金合同》规定的费用；
(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金估值机构，按照《基金合同》约定的估值方法进行基金资产估值，并有权对基金管理人的估值结果进行复核确认；
(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) 制定《基金合同》持有人服务规则，并据此对持有人进行服务；
(12) 依据法律法规及基金合同约定的基金财产使用、处分、质押、转让和受让基金份额的协议；
(13) 在法律法规允许的范围内，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
(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) 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；
(16) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整有关基金申购、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) 建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度，确保所托管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基金份额持有人、申购、赎回和转换价格符合《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) 编制季度、半年度和年度基金报告；
(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) 建立健全风险管理、内部控制、合规管理等制度，并确保符合《基金法》、《基金合同》及其他有关规定并定期或不定期开展基金合规自查；
(13) 依据法律法规及基金合同约定，为基金份额持有人提供基金估值、申购、赎回、转换和基金财产清算等服务；
(14) 按照有关规定与托管人签订托管协议，明确基金财产的保管、清理、移交、变现和分配；
(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、基金销售机构召开基金份额持有人大会；
(16) 按照有关规定保存基金财产管理活动的会计账目、报表、记录和其他相关资料15年以上；
(17) 确保投资者准确、及时、完整地了解基金投资的各项费用及其承担方式，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时限和方式查阅或复制其有关的所有公开资料，并在支付合理费用的条件下得到相关资料的复印件；
(18) 建立健全基金财产清算小组，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的，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
(21) 监督基金管理人投资法律法规及《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承担先行赔付责任；
(22) 当基金管理人将其委托第三方处理时，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满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，将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后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。

(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) 根据《基金合同》生效之日起，依法按照法律法规及《基金合同》独立运用并管理基金财产；
(3) 收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会许可的其他费用；
(4) 销售基金份额；
(5) 按照有关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》及国家有关法律法规，应及时向中国证监会和其他相关部门报告，并采取必要措施维护基金投资者的利益；
(7) 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管理；
(8) 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取《基金合同》规定的费用；
(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金估值机构，按照《基金合同》约定的估值方法进行基金资产估值，并有权对基金管理人的估值结果进行复核确认；
(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) 制定《基金合同》持有人服务规则，并据此对持有人进行服务；
(12) 依据法律法规及基金合同约定的基金财产使用、处分、质押、转让和受让基金份额的协议；
(13) 在法律法规允许的范围内，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
(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) 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；
(16) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整有关基金申购、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) 建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度，确保所托管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基金份额持有人、申购、赎回和转换价格符合《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) 编制季度、半年度和年度基金报告；
(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) 建立健全风险管理、内部控制、合规管理等制度，并确保符合《基金法》、《基金合同》及其他有关规定并定期或不定期开展基金合规自查；
(13) 依据法律法规及基金合同约定，为基金份额持有人提供基金估值、申购、赎回、转换和基金财产清算等服务；
(14) 按照有关规定与托管人签订托管协议，明确基金财产的保管、清理、移交、变现和分配；
(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、基金销售机构召开基金份额持有人大会；
(16) 按照有关规定保存基金财产管理活动的会计账目、报表、记录和其他相关资料15年以上；
(17) 确保投资者准确、及时、完整地了解基金投资的各项费用及其承担方式，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时限和方式查阅或复制其有关的所有公开资料，并在支付合理费用的条件下得到相关资料的复印件；
(18) 建立健全基金财产清算小组，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的，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
(21) 监督基金管理人投资法律法规及《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承担先行赔付责任；
(22) 当基金管理人将其委托第三方处理时，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满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，将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后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) 根据《基金合同》生效之日起，依法按照法律法规及《基金合同》独立运用并管理基金财产；
(3) 收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会许可的其他费用；
(4) 销售基金份额；
(5) 按照有关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》及国家有关法律法规，应及时向中国证监会和其他相关部门报告，并采取必要措施维护基金投资者的利益；
(7) 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管理；
(8) 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取《基金合同》规定的费用；
(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金估值机构，按照《基金合同》约定的估值方法进行基金资产估值，并有权对基金管理人的估值结果进行复核确认；
(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) 制定《基金合同》持有人服务规则，并据此对持有人进行服务；
(12) 依据法律法规及基金合同约定的基金财产使用、处分、质押、转让和受让基金份额的协议；
(13) 在法律法规允许的范围内，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
(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) 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；
(16) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整有关基金申购、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) 建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度，确保所托管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基金份额持有人、申购、赎回和转换价格符合《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) 编制季度、半年度和年度基金报告；
(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) 建立健全风险管理、内部控制、合规管理等制度，并确保符合《基金法》、《基金合同》及其他有关规定并定期或不定期开展基金合规自查；
(13) 依据法律法规及基金合同约定，为基金份额持有人提供基金估值、申购、赎回、转换和基金财产清算等服务；
(14) 按照有关规定与托管人签订托管协议，明确基金财产的保管、清理、移交、变现和分配；
(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、基金销售机构召开基金份额持有人大会；
(16) 按照有关规定保存基金财产管理活动的会计账目、报表、记录和其他相关资料15年以上；
(17) 确保投资者准确、及时、完整地了解基金投资的各项费用及其承担方式，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时限和方式查阅或复制其有关的所有公开资料，并在支付合理费用的条件下得到相关资料的复印件；
(18) 建立健全基金财产清算小组，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的，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
(21) 监督基金管理人投资法律法规及《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承担先行赔付责任；
(22) 当基金管理人将其委托第三方处理时，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满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，将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后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。

(四) 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) 根据《基金合同》生效之日起，依法按照法律法规及《基金合同》独立运用并管理基金财产；
(3) 收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会许可的其他费用；
(4) 销售基金份额；
(5) 按照有关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》及国家有关法律法规，应及时向中国证监会和其他相关部门报告，并采取必要措施维护基金投资者的利益；
(7) 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管理；
(8) 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取《基金合同》规定的费用；
(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金估值机构，按照《基金合同》约定的估值方法进行基金资产估值，并有权对基金管理人的估值结果进行复核确认；
(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) 制定《基金合同》持有人服务规则，并据此对持有人进行服务；
(12) 依据法律法规及基金合同约定的基金财产使用、处分、质押、转让和受让基金份额的协议；
(13) 在法律法规允许的范围内，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
(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) 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；
(16) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整有关基金申购、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) 建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度，确保所托管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基金份额持有人、申购、赎回和转换价格符合《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) 编制季度、半年度和年度基金报告；
(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) 建立健全风险管理、内部控制、合规管理等制度，并确保符合《基金法》、《基金合同》及其他有关规定并定期或不定期开展基金合规自查；
(13) 依据法律法规及基金合同约定，为基金份额持有人提供基金估值、申购、赎回、转换和基金财产清算等服务；
(14) 按照有关规定与托管人签订托管协议，明确基金财产的保管、清理、移交、变现和分配；
(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、基金销售机构召开基金份额持有人大会；
(16) 按照有关规定保存基金财产管理活动的会计账目、报表、记录和其他相关资料15年以上；
(17) 确保投资者准确、及时、完整地了解基金投资的各项费用及其承担方式，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时限和方式查阅或复制其有关的所有公开资料，并在支付合理费用的条件下得到相关资料的复印件；
(18) 建立健全基金财产清算小组，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的，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
(21) 监督基金管理人投资法律法规及《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承担先行赔付责任；
(22) 当基金管理人将其委托第三方处理时，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满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，将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后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。

(五) 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) 根据《基金合同》生效之日起，依法按照法律法规及《基金合同》独立运用并管理基金财产；
(3) 收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会许可的其他费用；
(4) 销售基金份额；
(5) 按照有关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》及国家有关法律法规，应及时向中国证监会和其他相关部门报告，并采取必要措施维护基金投资者的利益；
(7) 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管理；
(8) 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取《基金合同》规定的费用；
(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金估值机构，按照《基金合同》约定的估值方法进行基金资产估值，并有权对基金管理人的估值结果进行复核确认；
(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) 制定《基金合同》持有人服务规则，并据此对持有人进行服务；
(12) 依据法律法规及基金合同约定的基金财产使用、处分、质押、转让和受让基金份额的协议；
(13) 在法律法规允许的范围内，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
(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) 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；
(16) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整有关基金申购、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) 建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度，确保所托管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基金份额持有人、申购、赎回和转换价格符合《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) 编制季度、半年度和年度基金报告；
(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) 建立健全风险管理、内部控制、合规管理等制度，并确保符合《基金法》、《基金合同》及其他有关规定并定期或不定期开展基金合规自查；
(13) 依据法律法规及基金合同约定，为基金份额持有人提供基金估值、申购、赎回、转换和基金财产清算等服务；
(14) 按照有关规定与托管人签订托管协议，明确基金财产的保管、清理、移交、变现和分配；
(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、基金销售机构召开基金份额持有人大会；
(16) 按照有关规定保存基金财产管理活动的会计账目、报表、记录和其他相关资料15年以上；
(17) 确保投资者准确、及时、完整地了解基金投资的各项费用及其承担方式，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时限和方式查阅或复制其有关的所有公开资料，并在支付合理费用的条件下得到相关资料的复印件；
(18) 建立健全基金财产清算小组，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的，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
(21) 监督基金管理人投资法律法规及《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承担先行赔付责任；
(22) 当基金管理人将其委托第三方处理时，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满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，将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后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。

(六) 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) 根据《基金合同》生效之日起，依法按照法律法规及《基金合同》独立运用并管理基金财产；
(3) 收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会许可的其他费用；
(4) 销售基金份额；
(5) 按照有关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》及国家有关法律法规，应及时向中国证监会和其他相关部门报告，并采取必要措施维护基金投资者的利益；
(7) 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管理；
(8) 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取《基金合同》规定的费用；
(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金估值机构，按照《基金合同》约定的估值方法进行基金资产估值，并有权对基金管理人的估值结果进行复核确认；
(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) 制定《基金合同》持有人服务规则，并据此对持有人进行服务；
(12) 依据法律法规及基金合同约定的基金财产使用、处分、质押、转让和受让基金份额的协议；
(13) 在法律法规允许的范围内，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
(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) 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；
(16) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整有关基金申购、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) 建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度，确保所托管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基金份额持有人、申购、赎回和转换价格符合《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) 编制季度、半年度和年度基金报告；
(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) 建立健全风险管理、内部控制、合规管理等制度，并确保符合《基金法》、《基金合同》及其他有关规定并定期或不定期开展基金合规自查；
(13) 依据法律法规及基金合同约定，为基金份额持有人提供基金估值、申购、赎回、转换和基金财产清算等服务；
(14) 按照有关规定与托管人签订托管协议，明确基金财产的保管、清理、移交、变现和分配；
(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、基金销售机构召开基金份额持有人大会；
(16) 按照有关规定保存基金财产管理活动的会计账目、报表、记录和其他相关资料15年以上；
(17) 确保投资者准确、及时、完整地了解基金投资的各项费用及其承担方式，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时限和方式查阅或复制其有关的所有公开资料，并在支付合理费用的条件下得到相关资料的复印件；
(18) 建立健全基金财产清算小组，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的，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
(21) 监督基金管理人投资法律法规及《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承担先行赔付责任；
(22) 当基金管理人将其委托第三方处理时，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满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，将已募集资金加计银行同期存款利息在募集期结束后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。

(七) 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) 根据《基金合同》生效之日起，依法按照法律法规及《基金合同》独立运用并管理基金财产；
(3) 收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会许可的其他费用；
(4) 销售基金份额；
(5) 按照有关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》及国家有关法律法规，应及时向中国证监会和其他相关部门报告，并采取必要措施维护基金投资者的利益；
(7) 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管理；
(8) 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取《基金合同》规定的费用；
(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金估值机构，按照《基金合同》约定的估值方法进行基金资产估值，并有权对基金管理人的估值结果进行复核确认；
(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) 制定《基金合同》持有人服务规则，并据此对持有人进行服务；
(12) 依据法律法规及基金合同约定的基金财产使用、处分、质押、转让和受让基金份额的协议；
(13) 在法律法规允许的范围内，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
(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) 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；
(16) 在符合有关法律、法规和《基金合同》的前提下，制订和调整有关基金申购、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) 建立健全内部控制、监察稽核、财务管理和人事管理等制度，确保所托管的基金财产和基金管理人的财产