

生跟踪偏离度和跟踪误差;

(4) 由于基金管理费过程中产生的证券交易成本,以及托管费的存在,使基金投资组合与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差;

(5) 在本基金指数化投资过程中, 跟踪管理人的管理能力, 影响跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机等对基金投资业绩的影响;

(6) 其他影响跟踪指数的因素, 从最低到最高, 分别是: 对标的指数、基金投资组合中各个行业持有的比例; 对该指数的股债配置的完全相合; 避免交叉卖空、对冲机制; 及其他工具造成的影响;

4. 目标指数更佳的风险

尽管可能有风险, 但根据基金合同的规定, 如出现变更目标指数的情形, 基金将变更新的指数。基于原目标指数的投向将改变, 投资组合将随之调整, 基金收益与风险也将与新的目标指数保持一致, 投资者将承担由此而带来的风险变动; 因指数组织机构指数组制错误等, 由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

5. 主动增减投资的风险

在主动增减投资的情况下, 为了获得超越指数的回报而可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整, 调整幅度较小或减少成份股的权重, 替换或者增加一些非成份股。这种基于基本面的深度研究对优化主动投资组合的决策, 最终结果仍然存在一定的不确定性, 其投资收益率可能高于指数收益但也有可能低于指数收益率。

(八) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现, 将会严重影响证券市场的运行, 导致基金投资组合的损失。金融市场运行、交易、竞争、代理、违约等行为也会给基金带来损失。

十九、基金合同的终止、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或本合同约定经基金份额持有人大会决议通过的事宜, 应召开基金份额持有人大会决议通过, 对于不可不经基金份额持有人大会决议通过的事宜, 由基金管理人和基金托管人共同后向更正并公告, 并在中国证监会备案。

2. 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行, 并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

(二) 《基金合同》的终止

1. 基金合同因《基金合同》的终止而终止;

2. 基金管理人及其托管人不得终止, 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》规定的其他情形;

4. 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三) 基金财产清算

1. 基金财产清算小组: 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。

2. 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核准的其他人员组成。

3. 基金财产清算小组组织: 基金财产清算小组由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

4. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

5. 基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金管理人财产清算小组优先从基金财产支付。

6. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

7. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

8. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

9. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

10. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

11. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

12. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

13. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

14. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

15. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

16. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

17. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

18. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

19. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

20. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

21. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

22. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

23. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

24. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

25. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

26. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

27. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

28. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

29. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

30. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

31. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

32. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

33. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

34. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

35. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

36. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

37. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

38. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

39. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

40. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

41. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

42. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

43. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

44. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

45. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

46. 基金财产清算小组的分摊方法: 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、交纳所欠税款和应付基金合同条款中规定由基金财产承担的费用后的余额部分进行分摊。

47. 基金财产清算小组成员由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

48. 基金财产清算小组的组成: 由基金管理人和基金托管人共同召集并主持, 基金管理人和基金托管人不派代表参加。

49. 基金财产清算小组的职责:

(1) 基金合同终止情形出现时, 由基金管理人清算小组负责清算工作;

(2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对基金资产进行估值和变现;

(4) 委托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;

(5) 将清算财产交付给中国证监会备案并公告。

50.