

[上接A07版]

## 二、管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素,而影响基金收益水平,这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上,例如资产配置、类型配置不能符合基金合同的要求,不能达到预期的收益目标;也可能表现在个别个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

## 三、流动性风险

由于开放式基金的特殊要求,本基金必须保持一定的比例以应对赎回的要求。由于我国证券市场整体流动性对市场对流动性的影响等原因可能会造成基金建仓困难,或建仓成本很高;基金资产不能及时变现或变现,或变现成本很高;不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险;证券投资基金的申购赎回行为将可能给基金带来重大损失。此外,交易所对股票交易的交易限制与规定会对基金投资股票的策略执行产生影响,从而对基金收益产生不利影响。

## 四、特定风险

## 1. 股指期货投资风险

本基金将与股指期货交易,股票期货交易用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利时,股指期货的指数微小的变动就可能使投资的权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时段内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。此外,交易所对股票交易的交易限制与规定会对基金投资股票的策略执行产生影响,从而对基金收益产生不利影响。

## 2. 投资于企业债券的风险

中小企业私募债是相对法律关系非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、市场风险等。信用风险指投资者所承担的风险,是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是指由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险,市场风险是未来市场价格、利率、汇率、股票价格、商品价格等的不确定性带来的风险,它影响债券的实现收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

## 五、其他风险

由于基金管理人的原因,本基金必须保持一定的比例以应对赎回的要求。由于我国证券

(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》及其补充协议、基金信息披露文件;

(2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自觉承担投资风险;

(3) 不向任何有损他人或其基金合同当事人合法利益的活动;

(4) 不从事任何有损基金持有人的合法权益的活动;

(5) 执行基金合同;

(6) 返还基金合同过程中因任何原因获得的不当得利;

(7) 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。

3. 基金份额持有人大会召集和出席

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人有权参加大会并表决。

4. 操作风险

基金管理人在业务各环节操作过程中,因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导致的风险,例如,越权交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

5. 技术风险

当计算机、通讯系统、交易系统等技术保障系统的信息网络出现异常情况,可能导致基金日常的申购赎回无法按正常期限完成,注册登记系统瘫痪,核算系统无法按正常期限显示净值、基金的交易指令无法按正常期限执行等风险。

6. 其他风险

由于法律法规方面的原因,某些市场行为受到限制或合同不能正常执行,导致基金资产的损失。

7. 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产遭受损失的风险,以及证券市场、基金管理人及基金销售代理人可能因不可抗力无法正常工作,从而有影响基金的申购和赎回按正常期限完成的风险。

## 第十七部分 基金的终止与清费

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会议通过,对于不可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通过之日起生效且方可执行,自决议生效后两个工作日内在指定媒体上公告。

3. 《基金合同》的终止

有下列情形之一的,基金合同即终止:

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,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

2. 基金财产清算小组可由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

3. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

4. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

5. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

6. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

7. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

8. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

9. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

10. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

11. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

12. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

13. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

14. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

15. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

16. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

17. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

18. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

19. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

20. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

21. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

22. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

23. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

24. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

25. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

26. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

27. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

28. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

29. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

30. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

31. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

32. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

33. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

34. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

35. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

36. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

37. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

38. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

39. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

40. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

41. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

42. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

43. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

44. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

45. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

46. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

47. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

48. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

49. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

50. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

51. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

52. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

53. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师或中国证监会认可的其他人员组成。

54. 基金财产清算小组,由基金管理人、新基金管理人、新基金托管人、会计师事务所、律师事务所、公证机关、审计机构等组成,基金管理人和基金托管人