

(上接A15版)

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金管理人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人授权代表不出席大会视为默认基金管理人有大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

(七)通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日2日后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

(六)表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

1、一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行表决。

采取通讯方式方式进行表决时,除非有充分相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(七)计票

1.现场开会

(1)如大会由基金份额持有人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始前宣布出席大会的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3)如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所提要求要求进行重新清点,监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限,重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4)计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

2.通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监票人在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人授权代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

(八)生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九)本部分关于基金份额持有人大会召集、议事规则、表决程序等规定,凡是直接引用法律法规规定的部分,如将来法律法规修改导致相关内容取消或变更的,基金管理人及基金托管人应协商一致并提前公告,可根据法律法规修改相关内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本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决议通过。对于可不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后变更并公告,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自生效后方可执行,并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

(二)、基金合同的终止事由

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

- 1.基金份额持有人大会决定终止;
- 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;
- 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:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2.基金财产清算小组组成:基金财产清算小组由基金管理人、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指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3.基金财产清算小组职责: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。

4.基金财产清算程序:

- (1)基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;
- (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- (3)对基金财产进行估值和变现;
- (4)制作清算报告;
- (5)聘请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;
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7)对基金剩余财产进行分配;
- 5.基金财产清算的期限为6个月。

(四)、清算费用

清算费用是指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,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五)、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,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、交纳所欠税费并清偿基金债务后,按照基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六)、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项及时公告;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5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有关文件由基金托管人保存15年以上。

(八)基金合并

本基金与其他基金的合并应当按照法律法规规定的程序进行。

四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,任何一方均有权将争议提交华南国际经济贸易仲裁委员会,根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为深圳,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

五、基金合同受中国法律管辖

五、基金合同的存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

第十九部分基金托管协议的主要内容

一、托管协议当事人

(一)基金管理人(或简称“管理人”)

名称:博时基金管理有限公司

住所:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行股份有限公司大厦20层
邮政编码:518040

法定代表人:洪小源

成立时间:1998年7月13日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基字[1998]26号

组织形式:有限责任公司

注册资本:2.6亿元人民币

存续期间:持续经营

经营范围:基金募集;基金销售;资产管理以及中国证监会许可的其它业务

(二)基金托管人

名称:招商银行股份有限公司(简称:招商银行)

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码:518040

法定代表人:李建强

成立时间:1987年4月8日

基金业务批准文号:证监基金字[2002]83号

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理结算;办理票据承兑;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;提供信用证服务及担保;代收代付款项及代理保险业务;提供保管箱服务;外汇存款;外汇贷款;外汇汇兑;外币兑换;国际结算;转贴、汇兑;同业拆借;外汇票据的承兑和贴现;中小企业私募债券;中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行承兑、货币市场工具等)及法律法规和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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入基金投资范围。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

2.基金投资品种的投资比例、投资策略为:

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%—95%;中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货的保证金以后,本基金保留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%;权证投资占基金资产净值的0—3%。

基金的投资组合应遵循以下限制:

- (1)本基金股票投资比例为基金资产的0%—95%;
- (2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,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发行的证券,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上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;
- (5)基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(6)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%;

(7)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(8)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的50.5%;

(9)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,不得超过该资产支持证券净值的10%;

(10)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%;

(11)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10%;

(12)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,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(13)本基金投资于信用评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券,基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(14)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拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(15)本基金参与股指期货交易后,需遵守下列规定:

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%;本基金在任何交易日日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的96%,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、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;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该交易日股票交易市值的20%;本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;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)应当符合基金合同中关于股票投资比例的有关限制;

(16)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,其市值不得超过该基金资产净值的10%;

(17)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、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权结构变更或支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资限制规定的,基金管理人应在10个工作日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应在基金投资组合生效之日起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。期间,基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。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日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,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按调整后的规定执行。

3.本基金财产不得用于以下投资或者活动:

- (1)承销证券;
- (2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3)从事承担无限责任的投资;
- (4)买卖其他基金份额,但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)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7)法律、行政法规及中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规及监管部门取消或调整上述禁止性规定,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。

4.基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会至少每半年对关联交易事项进行审查。

(三)基金管理人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金管理人选择存款银行进行监督。基金投资银行定期存款的,基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,确定符合条件的所有存款银行名单,并及时提供基金托管人。基金托管人应对以该基金投资银行定期存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。对于不符合规定的银行存款,基金托管人有权拒绝执行,并通知基金管理人。

本基金投资银行存款应符合如下规定:

- 1.本基金的存款银行应是具有证券投资基金托管资格、证券投资基金销售业务资格或合格境外基金投资入资格的商业银行。
- 2.本基金投资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,不受此限制,存放在具有基金托管资格同一银行存单不得超过基金资产净值的30%。
- 有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策,基金公司履行适当程序后,可相应调整投资组合的期限。
- 3.基金管理人应对本基金存款银行的评估与研究,建立健全基金定期存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和内部控制机制,切实防范有关风险。基金托管人负责对基金定期存款业务活动的监督与核查,复核、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件,切实履行托管职责。

基金管理人负责控制存款信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。

(2)基金管理人负责控制流动性风险。流动性风险主要包括基金管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取与存款银行未能及时兑付的风险、基金投资银行存款不能满足正常结算业务的风险、因提前支取或到期支取而提前支取而导致的利息损失影响估值等涉及到基金流动性方面的风险。

(3)基金管理人须加强内部风险控制制度的建设。

(4)基金管理人投资银行存款时,应对相关责任在更新招股说明书予以披露,进行风险提示。

(5)基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时,应严格遵循《基金合同》、《运作办法》等有关法律法规,以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

(四)基金管理人应依据银行协议约定的账户、账户开户资料、投资指令与资金划拨、账目核对、到期兑付、提前支取和文件保管

1.基金投资银行存款协议的签订

(1)符合存款银行条件的,基金管理人应与存款银行总行或其授权分行签订《基金存款业务总体合作协议》(以下简称《总体合作协议》),确定《存款协议书》的格式文本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式文本由基金托管人与基金管理人共同确定。

(2)基金管理人应在《存款协议书》中明确存款证实书或其他有效存款凭证的办理方式、邮寄地址、联系人和联系电话,以及存款证实书或其他有效凭证在邮寄过程中遗失后,存款余额的确认及兑付办法。

(3)由存款银行提供的存放在存款银行的分支机构的(以下简称“存款分支机构”)需存款证实书或其他有效存款凭证的,基金管理人应在《存款协议书》中约定基金管理人可向存款分支机构的上级行发送存款余额询证函,存款分支机构及其上级行应予以配合。

(4)基金管理人应在《存款协议书》中规定,基金存款到期或提前兑付的资金应全部划转到指定的基金托管账户,并在《存款协议书》写明账户名称和账号,未列入指定账户的,由存款银行承担一切责任。

(5)基金托管人依据相关法律法规《总体合作协议》和《存款证实书》的内容进行复核,审查存款银行资格等。

2.基金投资银行存款的账户开设与管理

(1)基金管理人投资银行存款时,基金管理人应当依据基金管理人于存款银行签订的《总体合作协议》,以基金的名义在存款银行总行或授权分行指定的分支机构开立银行账户。

(2)银行存款的预留印鉴由基金托管人保管和使用。

3.存款投资指令的发送与执行

(1)基金管理人发送投资指令应采用书面方式及双方约定的其他方式。

存款投资指令包括存款资金划拨指令、提前支取存款指令等。

基金管理人应依据法律法规和基金合同及托管协议的约定向基金托管人发送存款投资指令,对于基金管理人依约定程序发出的指令,基金管理人不得否认其效力。

指令发出后,基金管理人应及时以电话方式与基金托管人确认。

基金托管人在发送投资指令时,应为基金托管人执行投资指令留出执行指令所必需的时间。投资指令传输不及时,未能留出足够的时间,导致资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。

(2)投资指令的确认

基金托管人应对指令予以接收基金管理人的指令,预先通知基金管理人其名单,并与基金管理人商定指令发送和接收方式。投资指令到达基金托管人后,基金托管人应指令专门人员审核指令有关内容及印章和签名的真实性。

(3)投资指令的执行

基金托管人验证投资指令后,应及时执行。

若因基金管理人发送错误投资指令及及时撤销或投资指令执行差错所造成的损失由基金托管人承担,投资指令执行错误,基金托管人应及时通知基金管理人。

若基金管理人发送投资指令可部分执行投资指令(无论因基金托管人原因还是基金管理人原因),基金托管人应及时通知基金管理人。

4.资金划拨、账目核对及到期兑付

(1)资金划拨

基金管理人向基金托管人发送指令,经基金托管人审核无误后应在规定期限内执行。存款资金只能存放于存款银行总行或者其授权分行指定的分支机构。

(2)存款证实书等存款凭证领取

存款银行分支机构应为基金开具存款证实书或其他有效存款凭证名称,该存款证实书为基金托管人存款确认或到期支取的有效凭证。资金到账后,由存款银行分支机构指定的会计主管将一份存款证实书复印件并加盖基金托管人电话确认收妥后,用特快专递将存款证实书原件寄送基金托管人指定联系人,若开户行代为保管存单的,由存款行分支机构指定会计主管将一份存款证实书复印件并与基金托管人电话确认后。

(3)存款证实书等存款凭证的遗失补办

存款证实书在邮寄过程中遗失的,由基金托管人向存款银行提出补办申请,基金管理人应督促存款银行尽快补办存款证实书或基金托管人招商银行股份有限公司对“存款证实书”的询证,并在询证上加盖办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

定期存款行公章寄还基金托管人指定联系人。

定期存款行负责于每个月的最后一个工作日提供加盖存款行公章的本基金存放在该机构的存款余额明细寄送至基金托管人指定联系人,并配合基金托管人招商银行股份有限公司对“存款证实书”的询证,并在询证上加盖存款行公章后寄还至基金托管人指定联系人。

(4)到期兑付

基金管理人提前通知基金托管人通过特快专递将存款证实书原件或其他存款证明原件寄给存款银行分支机构指定的主管。存款银行收到存款证实书原件的,应与基金托管人电话沟通,将存款到期前基金管理人于存款银行领取存款证实书到到期日支付到账本息事宜。

基金托管人在存款到期日未收到存款本息或存款本息金额不正确时,通知基金管理人,与存款银行接洽存款到账时间及利息付事宜。基金管理人应将接洽结果告知基金托管人,基金托管人负责接收存款本息的当日通知基金管理人。

存款证实书在邮寄过程中遗失的,存单行应立即通知基金托管人,基金托管人在原存款证实书复印件上加盖公章并出具相关证明文书,与存款行指定会计主管电话确认后,存款行分支机构应在到期时将存款本息划至指定基金的基金账户。

如果存款到期日为法定节假日,存款行顺延至到期后第一个工作日支付,存款行需按当期利率和实际延期天数支付延期利息。

5.提前支取

如提前支取,应在存款期限内,由于基金规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要等原因,经向存款行说明理由,基金管理人可提前支取全部或部分资金,但应继续按原有利算计提利息,因提前支取导致的利息损失应由基金管理人承担。

提前支取的具体事项按照基金管理人于存款银行签订的《存款协议书》执行。

6.基金投资银行存款的相关文件保管

(1)基金管理人负责存款银行当日,存款银行分支机构将存款证实书或其他有效存款凭证,同时传真复印件给基金托管人和基金管理人,并寄送原件给基金托管人代为保管;存款银行代为保管存单原件,存款行复印件给基金托管人和基金管理人。

(2)存款证实书或其他有效存款凭证由基金托管人保管。基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及《基金合同》的约定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人,在10个工作日内予以纠正。基金管理人对于基金托管人通知的投资事项未采纳前10个工作日内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应立即报告中国证监会,并同时通知基金管理人,在10个工作日内纠正或拒绝执行,若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失,基金托管人不承担任何责任。

(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业自律规范,并经市场独立验证的投资策略,基金托管人应对基金管理人参与银行间债券市场交易对手进行审慎调查,并对由此造成的交易损失由基金管理人负责承担。基金管理人应定期按照交易对手名单的期限在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否事前提供经核实的银行间债券市场交易对手名单进行执行。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单,但调整结果最迟提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本期剔除的交易对手所进行尚未结清的交易,仍应继续执行并通知基金管理人。基金管理人应根据市场实际情况调整银行间债券交易对手名单及结算方式,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前3个交易日

内与基金托管人协商确认。

基金管理人管理的全部基金对交易对手的资信控制,按照银行间债券市场的交易规则进行执行,并负责解决因交易对手不履行合约而造成违约的损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内未承担违约责任的,基金管理人应根据相关法律法规,基金管理人应对相关损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则按照银行间债券市场交易对手合同进行跟踪进行监督,如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(六)本基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行股票行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

1.本协议所称的流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本基金可以投资于中国证监会批准的非公开发行股票,且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的,并可在证券交易所全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行股票。

基金参与非公开发行股票认购,不得预付任何形式的保证金,法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资于有锁定期但锁定期不明确的可转债,但法律法规或中国证监会另有规定的除外。

2.基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金托管人应参与基金公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度及投资比例控制指标。

基金管理人应于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对于本基金投资流通受限证券的流动性风险负责,确保对相关风险采取积极有效的措施,在合理的时间内有效解决基金运作中的流动性问题,如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时,基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算,并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险,基金托管人不承担任何责任。

3.基金投资流通受限证券前,基金管理人应指令基金托管人提供符合法律法规规定的有关书面材料,包括但不限于拟执行证券业务的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期、基金认购确认的数量、价格、总成本、应付的认购款、资金交付时间等,基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及時提供有关证券的具体必要的信息,致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的,基金托管人免于承担责任。

4.基金托管人依照法律法规、《基金合同》、《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定,应及时通知基金管理人,并呈报中国证监会,同时采取合理措施保护基金投资者的利益,基金托管人有对基金管理人

的违法、违规及违反《基金合同》、《托管协议》的投资指令不予执行,并立即通知基金管理人纠正,基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得执行的,基金托管人应向中国证监会报告。