

（上接A22版）

（6）将先进的技术手段运用于风险控制中，在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为确定因素降低至最低，托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多轮论证，托管业务系统具有较严格的自动风险控制功能。

五、基金管理人及基金托管人运作基金进行监督的方法与程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及有关法律法规的规定，对基金的投资对价、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购赎回的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等进行监督和核算。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并反馈以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时向通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人拒不执行基金托管人通知的违规事项和未能如期纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人对基金管理人违反基金合同的行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

第五部分 相关服务机构

序号	机构名称	机构信息
1. 直销机构	国泰基金销售有限公司	地址：上海市虹口区四川路18号2号楼基盛大厦16层-19层 客户服务专线：400-888-8688（021-31089000） 传真：021-31081861 网址：www.guotai.com.cn
	国泰基金电子商务平台	智能手机APP客户端、iPhone交易客户端、Android交易客户端 “国泰基金”微信交易平台

序号	机构名称	机构信息
2. 其他销售机构	民生证券	地址：北京市西城区复兴门外大街2号 办公地址：北京市西城区复兴门外大街2号 法定代表人：洪涛 客服电话：95568

（2）其他销售机构：具体内容详见本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关公告。

二、登记机构

名称：国泰基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼
办公地址：上海市虹口区公平路10号8号楼基盛大厦16层-19层
法定代表人：陈锐
联系人：叶萍
联系电话：400-888-8688、021-31089000
客户服务专线：400-888-8688、021-31089000
名称：普华永道会计师事务所
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展博大厦17楼
办公地址：上海市银城中路68号19楼
负责人：南卫峰
联系电话：021-31256666
传真：021-31358600
联系人：孙蓉
经办律师：孙蓉、姜春
四、审计机构名称：会计师事务所
名称：普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展博大厦17楼
办公地址：上海市静安区路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨柏怡
联系电话：021-23238888
传真：021-23238888
联系人：魏佳佳
经办注册会计师：许江、魏佳佳

一、基金募集的依据

本基金募集依据《证券投资基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2015年6月4日证监许可[2015]1115号文《关于准予国泰生益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册募集。

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. 基金的存续期限：不定期

三、基金合同的生效时间、发售方式、发售对象

1. 发售时间
通过各销售机构公开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。

2. 发售方式
通过各销售机构公开发售，各销售机构的名称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关公告。

3. 发售对象
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、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规和中国证监会允许购买证券投资基金的合格投资人。

四、募集规模

本基金的首份份额总额不少于2亿份。

五、基金类型的认购

本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

六、认购费率

本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

七、募集费用

募集费用投资人可多次认购本基金，认购费用按每次认购申请单独计算。

八、基金申购赎回的费率

本基金的基金份额的认购费率如下：

认购金额(M)	认购费率
M<500元	1.5%
M≥500元	按笔收取,1,000元/笔

基金认购费用在投资者认购基金份额时收取，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、注册登记等募集期间发生的各项费用。

九、基金认购份额的计算

基金认购采用份额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。

计算公式为：
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+认购资金利息）/基金份额初始面值

认购费用为固定金额时，计算公式为：
认购费用=固定金额
净认购金额=认购金额-认购费用
认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

认购份额的计算保留小数点后两位，小数点后的第三位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假设投资人投资10,000.00元认购本基金，认购费率为1.50%，假定募集期间认购资金所得利息为3.00元，则认购计算如下：
净认购金额=10,000/（1+1.50%）=9,852.22元
认购费用=10,000-9,852.22=147.78元
认购份额=（9,852.22+3.00）/1.00=9,855.22份
即：投资人投资10,000.00元认购本基金，假定认购资金利息为3.00元，则可得9,855.22份基金份额。

六、认购安排

1. 认购时间
基金认购采取基金销售机构统一办理时间，基金管理人及基金销售机构确定，请参见本基金的基金份额发售公告及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构的相关公告。

3. 基金认购费用及基金认购方式的说明
投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。若资金未全额到账则视为无效，基金管理人将认购无效的款项退回。

投资人在基金募集期间可多次认购本基金份额，认购费用按每次认购申请单独计算。认购申请一经受理不得撤销。认购期间内不投资人的累计认购金额没有限制。

七、认购申请的确认

投资人应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理情况。

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请。申请的确认以注册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。

投资人单笔认购最低金额为1000.00元（含认购费）。各销售机构对本基金最低认购金额及交易起点有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

七、募集费用

募集费用投资人可多次认购本基金，利息将按持有基金份额的基金总额归基金持有人所有，其中利息利息的数额以基金募集期间登记为准。

八、基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

一、基金募集的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且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日内聘请会计师事务所验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

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后之日，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进行公告。基金管理人应将基金募集期间的基金资产归入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

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，基金管理人应当按下列规定：

1. 以退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息；

2. 在基金募集期限届满30日内退还投资者已缴纳的款项，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的一切费用应由各方自行承担。

三、基金存续期间内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，连续2个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续3个工作日出现前述情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规和中国证监会另有规定的，从其规定。

一、申购和赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人及相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更销售机构，并予以公告。若基金管理人或指定的销售机构变更时，将采取公告、更换等交易方式，投资人可通过上述方式申购和赎回基金，具体变更销售机构的相关公告，投资人应当在销售机构办理基金销售业务的场所或销售机构提供服务的其他方式办理基金申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及开放时间

1. 开放日及开放时间
投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正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可暂停申购、赎回等业务。

基金管理人有权根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定暂停申购、赎回等业务。基金管理人将在指定媒介上公告暂停申购、赎回的开始时间，并在指定媒介上公告暂停申购、赎回的开始时间。

基金管理人有权根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定暂停申购、赎回等业务。基金管理人将在指定媒介上公告暂停申购、赎回的开始时间，并在指定媒介上公告暂停申购、赎回的开始时间。

三、申购和赎回的费率

1. “申购”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础进行计算；

2. “赎回”原则，即赎回、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基础进行计算；

3. 当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销；

4. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后顺序进行赎回处理。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述申购和赎回进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前公告（信息披露办法）的有关规定在指定媒介上公告。

四、申购和赎回的最低金额

1. 申购金额的限制
投资人单笔申购最低金额为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起点有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

2. 赎回的限制
基金管理人可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回申请最低份额为100.00份，若某基金份额持有人赎回时其持有基金份额的基金份额不足100.00份，则其赎回份额一并赎回。

3. 本基金不投资投资人每个交易账户的最低基金份额设置限制，但各销售机构对交易账户最低份额有其他规定的，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，调整上列投资品种占基金资产的比例的数量限制。基金管理人必须按照实施前（信息披露办法）的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、申购和赎回的费用

1. 申购费用
本基金基金份额的申购费率如下：

认购金额(M)	申购费率
M<500元	1.50%
M≥500元	按笔收取,1000元/笔

申购费用由基金份额的申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的推广、销售、登记结算等费用。

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。本基金对持续持有期少于30日的投资人收取赎回费，对持续持有期长于30日但少于90日的投资人收取赎回费，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90日但少于180日的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于180日的投资人，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

七、基金赎回的费率

本基金基金份额的赎回费率如下：

赎回时间	赎回费率
T<7日	1.50%
7日<T<30日	0.75%
30日<T<180日	0.50%
180日<T<365日	0.10%
365日<T<730日	0.05%
T≥730日	0.00%

（注：赎回的持有时间以计算，以赎回在注册登记机构的登记日为准，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。）

八、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持续营销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金持续营销活动。在基金持续营销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适度调低基金申购费率和基金赎回费率。

七、申购和赎回的价格、费用及其使用

1. 申购份额的计算
基金申购采用金额申购方式。基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

（1）本基金基金申购的申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：
净申购金额=申购金额/（1+申购费率）
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

（2）本基金基金申购的申购费为固定金额时，申购份额的计算方法如下：申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

上述计算结果按照四舍五入方法保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假设投资人投资10,000.00元申购本基金，对应申购费率为1.50%，假设申购当日本基金的基金份额净值为1.040元，则其可得申购的基金份额为：

净申购金额=10,000/（1+1.50%）=9,852.22元
申购费用=10,000-9,852.22=147.78元
申购份额=9,852.22/1.040=9,473.29份
即投资人投资10,000.00元认购本基金，对应申购费率为1.50%，假设申购当日基金份额净值为1.040元，则可得9,473.29份基金份额。

2. 赎回金额的计算
如果基金份额持有人的赎回基金份额，则赎回金额的计算方法如下：
赎回费用=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率
赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回费用

上述计算结果按照四舍五入方法保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：假设投资人赎回10,000份基金份额，假设该基金份额的持有时间为40日，对应的赎回费率为0.50%，假设T日基金份额净值为1.020元，则其可得赎回金额为：

赎回费用=10,000×1.020×0.50%=510.00元
赎回金额=10,000×1.020-510.00=10,140.00元
即投资人赎回10,000份基金份额，假设该基金份额的持有时间为40日，对应的赎回费率为0.50%，假设T日基金份额净值为1.020元，则其可得赎回金额为10,140.00元。

3. 本基金基金份额净值
本基金基金份额净值的计算公式如下：本基金基金份额净值=（基金资产净值÷基金份额总数）×基金份额净值，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，遇特殊情形，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

八、申购和赎回的费率

1. 申购和赎回的费率

2. 发生基金合同约定的赎回费率时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3. 证券/期货交易场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. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

5. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

6. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

7. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

8. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

9. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

10. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

11. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

12. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

13. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

14. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

15. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

16. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

17. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

18. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

19. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

20. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

21. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

22. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

23. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

24. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

25. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

26. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

27. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

28. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

29. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

30. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

31. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

32. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

33. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

34. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

35. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

36. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

37. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

38. 基金管理人有权接受某些申购申请或暂停接受某些基金份额持有人的赎回申请。

（12）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；

（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净资产的10%；

（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净资产的10%；

（15）本基金投资于股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金净资产的10%；

（16）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（17）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（18）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（19）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（20）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（21）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（22）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（23）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（24）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（25）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（26）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（27）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（28）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（29）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（30）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（31）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（32）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（33）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（34）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（35）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（36）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（37）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（38）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（39）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（40）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（41）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（42）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（43）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

（44）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金净资产的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金净资产的90%，其中，有价证券指股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、买入返售金融资产等不含质押回购的资产；

（45）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过