

（上接A6版）

- (22) 从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
 - (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
 - (24) 法律法规、中国证监会及基金合同规定的其它义务。
- 基金份额持有人的权利与义务
- 根据《基金法》及其他有关法律、法规，基金份额持有人的权利包括但不限于：
- (1) 分享基金财产收益；
 - (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
 - (3) 依法按其所持基金份额的大小和招募说明书的规定申请赎回或转让其持有的基金份额；
 - (4) 按照有关规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
 - (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
 - (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
 - (7) 监督基金管理人、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；
 - (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构及其他有关当事人侵害其合法权益的行为依法提起诉讼；
 - (9) 法律法规和基金合同规定的其它权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律、法规，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、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 遵守基金合同、基金合同及其他有关规定；
- (3) 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，自行承担投资风险；
- (4) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (5) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (6) 在约定的基金投资范围内，对基金资产净值或者基金合同终止的有限责任；
- (7) 不得从事任何有损基金及其他基金当事人合法权益的活动；
- (8) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (9) 还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、销售机构、其他基金份额持有人处获得的不得得利；
- (10) 法律法规和基金合同规定的其它义务。

4、基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

（二）基金份额持有人的权利

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人为合法授权持有代表有权召集基金份额持有人大会会议并表决，基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

2. 召开事由

- (1) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或单独或合计持有基金份额10%以上(含10%)，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
 - 2) 转换基金运作方式；
 - 3) 变更基金类别；
 - 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外)；
 - 5) 变更基金份额持有人大会程序；
 - 6) 更换基金管理人、基金托管人；
 - 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
 - 8) 本基金与其他基金的合并；
 - 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
 - 10) 法律法规、基金合同和中国证监会规定的其情形。
- (3) 出现以下情形之一时，可由基金管理人、基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费费率，变更或增加收费方式；

- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3. 召开基金份额持有人大会的方式

- (1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未

按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集，并出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(3) 代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提议的基金份额持有人代表和基金管理人。基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(4) 代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

4. 召开基金份额持有人大会的通知、通知内容、通知方式

- (1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的日期、地点和出席方式；
 - 2) 会议拟审议的主要事项；
 - 3) 会议形式；
 - 4) 议事程序；
 - 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
 - 6) 代理投票的授权委托书证明的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)；
 - 7) 表决方式；
 - 8) 召集人需要联系的事项。
- 出席出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 1) 召集人需要通知的事项。
- (2) 采用通讯方式开会并举行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采用的具体通讯方式，委托人的凭证及其委托方式和授权关系，表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

5、基金份额持有人大会的方式

- 1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规和监管机构允许的其

他方式。

2) 现场开会由基金管理人或由基金人本人出席或由授权委托证明委派其代理人出席，现场开会时基金管理人、基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯方式召开的会议形式进行表决。

4) 在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话、短信或其他方式现场方式或与非现场方式与现场方式结合的方式进行表决，或者采用网络、电话、短信或其他方式授权他人代为出席并参与表决。会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

5) 会议的召开方式由召集人确定。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

1) 现场开会方式

如同时满足以下条件时，现场开会方可举行：

- 1) 到会者在权益登记日持有有效的基金份额统计数，全部有效凭证所对应的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%，下同)；
- 2) 到会者的基金份额持有身份证明文件、基金管理人身份证明文件、委托持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规、基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金资产净值中的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有权益登记日代表的有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的三分之一(含三分之一)。

1) 通讯开会方式

- 1) 召集人发出会议通知后，通讯开会方可举行；
- 2) 召集人必须按照通知公布会议通知后，在2个工作日内在指定媒介刊登提示性公告；
- 3) 召集人必须按照通知通知基金托管人和/或基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对表决意见的统计进行监督；

- 3) 召集人在监督人和/或基金托管人监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的表决意见，如监督人经通知后不参加监督的，不影响表决效力；
- 4) 本人直接出具表决意见和授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；

5) 直接出具表决意见的基金份额持有人或授权代表出具人出具表决意见人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构相符合。

若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额少于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表基金份额三分之二以上(含三分之二)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。

6. 议事内容与程序

- 1) 议事内容及提案权
- 1) 议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人有权向大会召集人发出会议通知或就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人权利职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议，如经大会决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上予以解释和说明。

程序性。大会召集人对以基金份额持有人为提案人及/或程序性问题的提案进行审核。如将其提案进行并表决并表决，需征得提案人同意，原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决议的程序进行审议。

4) 基金份额持有人大会的召集人发出召开大会的通知后，如果需要对原提案进行修订、变更，应当经基金份额持有人大会召开前30日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

(2) 议事程序

- 1) 现场开会
- 1) 在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定宣读会议议程程序及注意事项，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，经合法授权的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人作为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金管理人授权代表主持；基金托管人作为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金管理人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和/或代理人所代表的基金份额50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的临时主持人。基金管理人、基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会做出的决议的效力。

召集人应当将出席会议的基金份额持有人、签署名单册和参加审议人姓名或单位名称、身份证号、持有或代表基金份额的份额数、签名、姓名或单位名称等事项。

2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的方式下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日后2个工作日内召集人公开相关提案并由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知后拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成决议并公告。

3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

7. 决议形成的条件、表决方式、程序
- (1) 基金份额持有人所持每一基金份额拥有平等的表决权。
- (2) 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的50%以上通过方为有效，除下列所列的事项须经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：

- 1) 特别决议
- 特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同、本基金与其他基金合并必须特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式进行；

- (3) 基金份额持有人大会决议的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非有充分证据表明在通讯方式表决过程中，否则提案符合法律法规和会议通知规定的表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入大会表决意见在内的基金份额持有人所持基金份额的总数。

- (5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行表决。

- (6) 基金份额持有人大会的各项提案内容一旦经充分表达并经过充分审议，逐条进行表决。

8. 计票

1) 现场开会

如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一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，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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一监督员共同担任监票人；但如果基金管理人、基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结束后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知后拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权其他计票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

9. 基金合同效力与大会决议效力及公告

- (1) 基金份额持有人大会决议的事项自公告之日起生效，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

(2) 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。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决议。

(3) 基金份额持有人大会决议自公告之日起5日内在指定媒介公告。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，必须同时公告全文、公证机关、公证员姓名等一通告。

4、本基金对基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规规定的，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分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) 基金份额的变更与终止

1. 基金份额的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

1) 转换基金运作方式；

- 2) 变更基金类别；
- 3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外)；
- 4) 变更基金份额持有人大会程序；
- 5) 更换基金管理人、基金托管人；
- 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的有关规定提高该等报酬标准的除外；
- 7) 本基金与其他基金的合并；

对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

9) 法律法规、基金合同和中国证监会规定的其情形。

但出现下列情形时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人、基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率，变更或增加收费方式；

- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议自表决通过后生效执行，并自决议生效之日起2日起2日内至少予以一次指定媒介公告。

2. 基金份额的终止

出现下列情形之一时，本基金合同应当终止：

- (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、基金份额持有人，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理人承接其权利义务；
- (3) 基金托管人、基金管理人、基金份额持有人，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的基金托管人承接其权利义务；

(4) 法律法规、中国证监会规定的其情形。

对于因基金份额持有人、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人之间的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用败诉方承担。

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。

本基金会受中国证监会监管

(五) 基金财产存放投资地、信息披露及中国内地基金合同和托管基金合同各持两份，基金管理人、基金托管人各持两份，均具有同等法律效力。

本基金会可制作成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构和注册登记机构办公场所查阅，但效力应以基金合同正本为准。

十九、托管协议的主要内容

(一) 托管协议当事人

1. 基金管理人名称：交银施罗德基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大厦二层(初)
办公地址：上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦二二—22楼
邮政编码：200120
法定代表人：李汉章
法定代表人：李汉章(代任)
成立日期：2006年08月4日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]128号
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元
存续期间：持续经营
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

2. 基金托管人名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区南口大街1号院1号楼
邮政编码：100033
法定代表人：王洪章
成立日期：2004年09月17日
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿仟零玖拾柒万肆仟肆百捌拾陆元整
存续期间：持续经营
经营范围：吸收存款、发放贷款、中期、长期贷款、办理国内外结算、办理票据承兑与贴现、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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；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；经中国银行业监督管理委员会等监管机构批准的其他业务。

(二) 基金管理人对于基金托管人的业务监督和核查

1. 基金管理人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或投资选择的，基金管理人应严格按照基金合同约定的投资风格或投资选择进行监督，以基金托管人运用相关技术或系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于投资选择约定的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的监督范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以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，基金管理人在履行适当程序后，可以将纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的80%—95%，其中投资于消费服务类行业公司股票不低于非现金基金资产的80%；其余资产投资于债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的交易性金融工具的比例合计不低于基金资产净值的5%。

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，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人对下述比例和投资限制进行监督：

- (1) 股票资产占基金资产的80%—95%，其中投资于消费服务类行业的公司股票不低于非现金基金资产的90%；其资产投资于债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他品种；
- (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证券，其市值不得超过基金资产净值的10%；
- (4) 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%；
- (5) 本基金在任何交易日买入权证的总额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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净值的10%；

(9) 本基金应投资于信用评级不低于BBB(以中债信用评级)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；

(10) 基金总资产不得超过基金净资产的140%。本基金在全国银行间债券市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，本基金在全国银行间市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期前不得展期；

(11) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的15%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的2%；

(12) 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%；

(13) 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10%。其中，有价证券指股票、债券(不含到期1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；

(14) 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基金持有的股票总市值的20%；

(15) 本基金持有的全部买入合约和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧算后)应当符合基金合同关于投资比例的有关约定，即占基金资产的90%—95%；

(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，不得超过基金资产净值的20%；

(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。

本基金在开始进行股指期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就股指期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署协议。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行修订，以变更后的规定为准。但法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人可在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金资产人合并、基金规模变动、股权分置改革支付对价等基金管理人以外的因素导致基金投资组合比例不符合上述规定比例限制的，基金管理人应当在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。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效日起每个工作日使基金投资组合符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当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。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金管理人通过事后监督方式为基金管理人提供基金投资行为与关联交易的监督等。

基金管理人、基金托管人应当相互提供与本基金所有相关关系的股东、与机构有其他重大利害关系的公司及其关联方持有的证券名单。基金管理人、基金托管人应负责确保关联交易事项的其真实性、准确性、完整性，并及时将更新后的名单发送给对方。

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有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事项，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，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进行，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。重大关联交易必须经基金管理人、基金托管人、并经三分之二以上的独立董事同意。基金管理人应当至少每半年对关联交易事项进行披露。

易对手进行尚未完结的交易，仍应按照协议进行交易。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式时，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手名单变更前1个工作日内与基金托管人协商一致，基金管理人、基金托管人完成确认后，确认调整后的名单开始生效，新名单生效日将与下次调整的交易日对手名单开始结算的交易，仍应按照协议进行交易。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行约定而造成违约及损失。基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人、基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易，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。

6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制定严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(1) 本基金投资流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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、回购期中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资流通受限证券须由经中国证监会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，并在证券交易场所全国银行间债券市场交易。

基金管理人投资流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管基金资产的，基金管理人应承担相应责任，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全及损失，由基金管理人承担。

基金管理人投资流通受限证券，不得预付任何形式保证金。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案包括但不限于因投资流通受限证券导致流动性风险处置预案失效时，基金管理人应采取何种措施以相关损失，并应明确决策流程，以及有异常情况的应对措施。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票流动性风险处置预案。

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，在合理时间内有效解决基金资产的流动性问题。如因基金仓位限制或市场发生剧烈变动等原因导致基金仓位调整困难时，基金管理人应保证提供足额流动性确保基金资产的支付结算，并依法依规规定承担所有损失。对本基金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。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应于至少投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 1) 中国证监会批准发行非公开发行的股票的批准文件。
- 1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的相关文件、发行公告、锁定期等发行资料。
- 2) 非公开发行股票有关基金管理人参与中国证监会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签订的证券登记服务协议。
- 4) 基金认购的数量、价格、总成本、账面价值。
- 4) 基金管理人应当在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的数量、价格、总成本、账面价值、相关信息披露、基金管理人应提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

基金管理人投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告予以公告。

- (5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：
- 1) 基金投资流通受限证券的法律法规遵守情况。
- 2) 在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
- 3) 有关比例限制的执行情况。