

信息披露

(上接A23版)

当基金申购赎回出现巨额赎回时,基金管理人可以对本基金的价值采用摆动定价机制,即将本基金因大额申购赎回而需要大幅调整仓位所导致的市成本摊薄调整基金的价值和基金份额的价值,并将该调整申购赎回份额持有人,以保护其他持有人的利益。在实施摆动定价的情况下,在总体大额申购赎回导致基金净值产生不利影响,对申购的投资者不利;在总体大额赎回导致基金净值产生不利影响,对赎回的投资者产生不利影响。

(四)特定风险

1.股指期货投资风险

本基金为投资股指期货,股指期货作为一种金融衍生工具,具备一特定的风险点。股指期货期货合约的卖方主要面临合约流动性风险、合约展期风险、保证金风险等。具体为:

(1)市场流动性风险是指由于股指期货价格波动而给投资者带来的风险,市场流动性是股指期货投资中主要的风险。

(2)流动性风险是指由于市场流动性差或合约交易活跃性差,交易参与各方,买卖意愿不高,期货交割难以迅速、及时,方便地交易所产生的风险。

(3)基差风险是指股指期货合约的价格和指数合约之间的价格差波动所造成的风险,以及不同股指期货合约价格之间的价格差波动所造成的市场风险。

股指期货合约的价格波动主要取决于股指期货合约的持仓量,当出现不利行情时,持仓量数较小的变动就可能会使持仓者权益遭受重大损失。而且股指期货合约存在无风险结算风险,如果没在规定的时间内补足保证金,按约定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

2.股指期货套利策略的风险

本基金为股指期货套利策略,股指期货套利由市场中小型企业采用非公开方式发行的债券,由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发生信用事件而流动性不足,受市场流动性影响,本基金可能无法及时支付所有持有中小企业债券,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

3.股指期货期货投资风险

股指期货投资面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是指期货市场价格波动而给投资者带来的价值发生变化的风险。基差风险是指期货市场的价格与一股指于一期货与现货间的价差波动,影响期货保值效果,发生之外意外损失的风险。流动性风险可分为两类:一类为流通性风险,是指期货合约无法及时以所期望的价格建立或平仓的风险,此类风险往往是由市场流动性不足所致;另一类为资金流动性风险,是指资金无法及时满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

4.投资资产支持证券的风险

本基金投资于资产支持证券,资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、再投资风险和估值风险等。

(1)信用风险是指为违约风险,是指资产支持证券支持资产与主体对其所附融资合约的违约所造成的可能损失。从信用等级上,信用风险表现为证券化资产所产生的现金流不能支持本金和利息的支付并引起投资者资产损失。

(2)利率风险是指资产支持证券作为固定收益证券的一种,也具有利率风险,即资产支持证券的价格受利率波动发生逆方向变动的风险。

(3)流动性风险是指资产支持证券不能迅速、低成本地变现的风险。

(4)提前偿付风险是指资产支持证券交易结构为复杂,参与方众多、交易条件复杂,而存在的法律风险。

(5)操作风险是指因参与方在业务操作过程中,因操作失误造成反操作程序引起的风险。

(6)法律风险是指因资产支持证券交易结构为复杂,参与方众多、交易条件复杂,而存在的法律风险。

(五)本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概括性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人及基金销售机构)根据基金的具体情况,按照相关法律法规结合本基金的资产配置、仓位控制、投资策略等因素,对基金的风险收益特征做出更加细化和具体的风险收益特征描述。对于风险收益特征的表述可能存在不同,投资人在购买本基金前应仔细阅读基金的要求或基金风险收益与产品风险等级的匹配说明。

1. 投资者在本基金基金管理人处购买基金,如果投资于这些工具,基金可能会面临一些特殊风险:

2. 因技术故障而产生的风险,如电脑系统故障等不可产生的风险;

3. 因基金快速交易而带来的风险,如申购赎回、大额赎回、大额赎回等方面不完善而产生的风险;

4. 因人为因素而产生的风险,如公司治理结构问题、内幕交易、不公平定价等欺诈行为、上市停止交易等产生的风险;

5. 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险;

6. 因基金管理人内部控制不力而带来的基金资产的损失,影响基金收益水平,从而带来风险;

7. 其他意外导致的风险。

十、基金的终止与清算

(一)《基金合同》的变更

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,应经基金份额持有人大会决议通过。对于不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理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表决通过之日起生效,并自决议生效后两日内报中国证监会备案。

(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》生效后,连续60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5000万元的,基金管理人应当终止《基金合同》,并按照《基金合同》的约定程序进行清算,不需要召开基金份额持有人大会;

(三)《基金合同》终止后的其他事项

1. 基金财产的清算

基金合同终止后,由基金管理人组织成立基金财产清算小组,基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所、律师事务所组成基金财产清算小组,基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

2. 基金财产清算小组的职责: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。

3. 基金财产清算程序

(1)基金财产清算小组自成立情形出现时,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书;

(6)将基金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。

基金财产清算期限为6个月。

(四)清算费用

清算费用是指基金财产清算过程中发生的有合理费用,清算费用由基金财产清算小组从基金财产中支付。

(五)基金财产清算后的分配

依据基金财产清算后的分配方案,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、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六)基金财产清算时顺序清偿:

(1)支付清算费用;

(2)交纳所欠税款;

(3)清偿基金债务;

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(一)至(四)项规定清偿前,不得为分配基金份额持有人;

(七)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2个工作日内在中国证监会指定媒体上刊登。

(八)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管15年以上。

十一、基金合同的内容摘要

1. 基金管理人、基金托管人和基金托管人的权利、义务

(1)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

1)依法募集资金,办理基金份额的发售和登记事宜;

2)根据《基金合同》及有关规定,制定和调整基金费率;

3)依照《基金合同》及有关规定,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

4)依据《基金合同》及有关规定,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

5)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

6)依据《基金合同》及有关规定,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

7)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

8)依据《基金合同》及有关规定,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

10)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

11)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

12)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

13)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

14)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

15)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

16)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

17)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

18)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

19)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

20)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

21)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

22)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

23)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

24)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

25)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

26)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

27)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

28)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

29)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

30)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

31)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

32)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

33)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

34)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

35)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

36)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

37)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

38)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

39)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

40)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

41)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

42)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

43)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

44)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

45)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

46)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

47)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

48)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

49)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

50)担任或委托其他符合条件的机构担任基金财产清算小组负责人或基金财产清算小组其他成员,有权代表基金财产清算小组进行必要的民事活动;

7)监督基金管理人投资运作;

8)基金管理人、基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

9)法律法规和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》、招募说明书等基金法律文件;

2)了解基金风险收益特征,了解自身风险承受能力,自行承担基金的投资风险,自主做出投资决策,自行承担投资损失;

3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;

4)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;

5)持有基金份额期间,承担基金亏损风险和基金赎回风险;《基金合同》终止时的有限责任;

6)不得从事任何有损基金份额持有人利益的行为;

7)执行生效的基金份额持有人大会决议;

8)遵守法律法规和中国证监会颁布的法律法规和《基金合同》约定的其他义务。

(三)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席并行使表决权。

2. 本基金份额持有人大会不设日常机构,在本基金存续期间,基金份额持有人大会可以设立日常机构,日常机构的设立与运作应当符合相关法律法规和中国证监会的规定。

(四)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止《基金合同》、本基金合同另有约定的除外;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求调整或调整不影响的除外;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)变更基金投资目标、范围或策略;

(9)变更基金持有人大会程序;

10. 基金管理人、基金托管人、基金服务机构有权提议召开基金份额持有人大会;

11. 基金份额持有人大会应当有代表基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人(或基金管理人)提议召开;

12. 对基金份额持有人权利和义务产生重大影响的其他事项;

13. 法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他事项。

(五)在不违背法律法规和《基金合同》的前提下,以下情况可由基金管理人或基金托管人协商后,不需召开基金份额持有人大会:

1. 法律法规规定增加基金份额持有人利益;

2. 基金管理人、基金托管人、基金服务机构有权提议召开基金份额持有人大会;

3. 基金份额持有人大会应当有代表基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人(或基金管理人)提议召开;

4. 对基金份额持有人权利和义务产生重大影响的其他事项;

5. 法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他事项。

(六)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席并行使表决权。

2. 本基金份额持有人大会不设日常机构,在本基金存续期间,基金份额持有人大会可以设立日常机构,日常机构的设立与运作应当符合相关法律法规和中国证监会的规定。

(七)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止《基金合同》、本基金合同另有约定的除外;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求调整或调整不影响的除外;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)变更基金投资目标、范围或策略;

(9)变更基金持有人大会程序;

10. 基金管理人、基金托管人、基金服务机构有权提议召开基金份额持有人大会;

11. 基金份额持有人大会应当有代表基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人(或基金管理人)提议召开;

12. 对基金份额持有人权利和义务产生重大影响的其他事项;

13. 法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他事项。

(八)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席并行使表决权。

2. 本基金份额持有人大会不设日常机构,在本基金存续期间,基金份额持有人大会可以设立日常机构,日常机构的设立与运作应当符合相关法律法规和中国证监会的规定。

(九)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止《基金合同》、本基金合同另有约定的除外;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求调整或调整不影响的除外;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)变更基金投资目标、范围或策略;

(9)变更基金持有人大会程序;

10. 基金管理人、基金托管人、基金服务机构有权提议召开基金份额持有人大会;

11. 基金份额持有人大会应当有代表基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人(或基金管理人)提议召开;

12. 对基金份额持有人权利和义务产生重大影响的其他事项;

13. 法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他事项。

(十)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席并行使表决权。

2. 本基金份额持有人大会不设日常机构,在本基金存续期间,基金份额持有人大会可以设立日常机构,日常机构的设立与运作应当符合相关法律法规和中国证监会的规定。

(十一)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止《基金合同》、本基金合同另有约定的除外;

(2)更换基金管理人;

(3)更换基金托管人;

(4)转换基金运作方式;

(5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求调整或调整不影响的除外;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)变更基金投资目标、范围或策略;

(9)变更基金持有人大会程序;

10. 基金管理人、基金托管人、基金服务机构有权提议召开基金份额持有人大会;

11. 基金份额持有人大会应当有代表基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人(或基金管理人)提议召开;

12. 对基金份额持有人权利和义务产生重大影响的其他事项;

13. 法律法规及中国证监会规定和《基金合同》约定的其他事项。

(十二)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席并行使表决权。

2. 本基金份额持有人大会不设日常机构,在本基金存续期间,基金份额持有人大会可以设立日常机构,日常机构的设立与运作应当符合相关法律法规和中国证监会的规定。

(十三)基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1. 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(一)基金托管协议当事人

1. 基金托管人:基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

2. 基金管理人:基金管理人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

3. 基金托管人:基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

4. 基金管理人:基金管理人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

5. 基金托管人:基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

6. 基金管理人:基金管理人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

7. 基金托管人:基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

8. 基金管理人:基金管理人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

9. 基金托管人:基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

10. 基金管理人:基金管理人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

11. 基金托管人:基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

12. 基金管理人:基金管理人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

13. 基金托管人:基金托管人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

14. 基金管理人:基金管理人、基金服务机构和其他基金权益的行为依法提起诉讼或仲裁;

15.