

A28 信息披露 Disclosure

(上接A27版)

款项的情形”的相关内容。

(3)收取短期回报费

对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

(4)暂停基金估值

当前一估值日基金资产净值(50%)以上的资产出现临时无法估值的情况，基金管理人可以暂停基金估值，并采取延时支付或接受基金份额申购赎回的措施。

当基金管理人出现上述情形时，本基金可能无法及时满足所有投资者的赎回申请，投资者收到赎回款项的时

间可能会延迟或预期可能增加投资者的赎回成本。

3、暂停风险

在基金管理人管理的基金出现巨额赎回、财务危机、基金合同约定的其他情形时，基金管理人有权暂停基金的赎回。

此外，在基金管理人的运作中，可能因技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行，甚至导致基

金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所及结算登记机构等。

4、操作技术风险

基金管理人及其相关业务人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程引起风险，如违规买卖证券、内幕交易、操纵市场和欺诈等。

2、基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

四、操作技术风险

基金管理人及其相关业务人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程引起风险，如违规买卖证券、内幕交易、操纵市场和欺诈等。

在此外，在基金管理人的运作中，可能因技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行，甚至导致基

金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所及结算登记机构等。

5、合规性风险

基金管理人在运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及《基金合同》有关规

定的风险。

六、基本风险类型

1.本基因为纯债型基金，债券的投资比例不低于基金资产的80%，该类债券的特定风险即成为本基金

的基本风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政策、行业政策、货币政策、市场

需求变化、行业波动等因素的影响，可能存在所投资标的的成长性与市场一致预期不符而不能达到券

价预期的收益率。

2.锁定期货投资的风险

本基金可投资于国债期货、国债期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点，投资国债期货主要存

在以下风险：

(1)市场风险：是由国债期货价格波动而给投资者带来的风险。

(2)流动性风险：是由国债期货合约的市场价格和指教价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同国

债期货合约价格之间的价格差所造成的价格差风险。

(3)基差风险：是由于国债期货合约的价格和指教价格之间的价格差的波动所造成的价格差风险。

(4)保证金风险：是指由于无法及时筹措资金建立或者维持国债期货合约头寸所要求的保证金而

带来的风险。

(5)信用风险：是指国债经纪公司违约而产生损失的风险。

(6)操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏忽，或者系统出现故障等原因造成

造成的风险。

3.投资资产支持证券的风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券的风险主要包括资产支持证券的发行主体、资产支持证券的

表现以及评级风险、法律风险等。

本基金的投资者包括公司债券类公司债券。由于证券公司短期公司债券非公开发行和交易，且限

制投资者的规模有限，存在流动性风险相对较大，若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回反而需要变

现资产，使流动性降低，本基金可能无法卖出所持的证券公司短期公司债券，由此可能对基金资产净值产

带来不利影响。

4.投资资产支持证券的风

七、本基金的基本风险及风险评价可能不一致的风险

八、其他风险

1.在合符基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资者对这些工具，基金公司可能会面临一

些特殊的风险；

2.因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

3.因基金经理迅速发展在制度建设、人员配备、内部控制制度等方面不完善而产生的风险；

4.因人为因素产生的风险，如内幕交易、操作行为等产生的风险；

5.对主要业务员如基金经理的业务能力产生的风险；

6.战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7.其他意外导致的风险。

第七部分 基金合同的变更、终止和基金财产的清算

一、《基金合同》的变更

1.变更基金合同时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通过，对于法律法规规定和基金合同约定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协商后更变，并公告，报中国证监会备案。

2.关于《基金合同》变更的基本份额持有人大会决议生效后两日内在指定

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《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、新基金托管人承接的；

3.《基金合同》约定的其他情形；

三、基金财产的清偿

1.基金财产小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组，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

务资格的会计师事务所、律师事务所、以及中国证监会认定的人员组成。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

产小组可以依法进行必要的民事活动。

4.基金财产清偿程序：

(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财产；

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3)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)将清算报告告之中国证监会备案公告；

(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，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期

限相应延长。

六、基金财产的公告

清算过程中的重大事项须及时公告，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个工作日内在基金财产清算小组进行公告。

(7)基金财产清算小组费用由基金财产清算小组自行承担。

六、基金财产清算公告及文件由基金托管人保存15年以上。

七、基金财产清算期间及文件由基金托管人保存

第八部分 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务

(一)基金管理人的权利与义务

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)依法募集基金；

(2)自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会准许的其他费用；

(4)销售基金份额；

(5)按照规定召集基金份额持有人大会；

(6)根据《基金合同》及有关法律规定行使基金托管人的权利；

(7)在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8)采取适当措施的报告计算基金财产申购、赎回、申购和销售价格的方法符合《基金合同》等法律文

件规定的，有关计算方法、定价原则和收费价格的；

(9)在基金合同约定的范围内行使其他权利；

(10)依据《基金合同》及有关法律决定基金收益分配的分配方案；

(11)在基金合同的范围内，拒绝任何不符合基金合同规定条件的申购和赎回申请；

(12)依法对基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的违法行为提起诉讼或者申请仲裁；

(13)法律法规规定的其他权利。

2.根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1)依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金的发售、申购、赎回和登记事

项；

(2)办理基金备案手续；

(3)自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(4)足额交纳基金管理费及法律法规规定或中国证监会准许的其他费用；

(5)编制半年度报告、年度报告、基金季度报告、基金半年度报告、基金年度报告等定期报告，报中国证监会

备案并公告；

(6)采用适当的基金名称，不得损害国家利益和社会公共利益；

(7)法律法规及《基金合同》规定的其他义务。

3.基金管理人的义务

(1)自《基金合同》生效之日起，依法履行《基金合同》约定的安全保管基金财产的义务；

(2)自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(3)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行投资；

(4)根据法律法规和《基金合同》的规定，随时接受基金份额持有人的查询；

(5)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(6)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(7)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(8)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(9)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(10)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(11)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(12)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(13)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(14)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(15)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(16)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(17)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(18)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(19)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(20)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(21)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(22)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(23)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(24)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(25)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(26)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(27)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(28)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(29)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(30)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(31)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(32)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(33)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(34)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(35)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(36)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(37)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(38)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(39)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(40)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(41)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(42)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(43)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(44)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(45)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(46)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(47)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；

(48)根据法律法规和《基金合同》的规定，对基金财产进行处分；