## 信息披露

## (上接B057版)

购金额。

、投资目标

4、如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停 5束基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2个工作日在指定媒介连续刊登基金重新开放申购 成赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近1个工作日的基金份额净值。

一世的公告,并任星朝开放中则或赎回日公告版 十三、基金转换 本基金于2015年12月21日开通基金转换业务。

本公司管理基金的转换业务的解释权归本公司。

转换业务适用基金参见2015年12月19日刊登于本公司网站的《北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购,赎回,转换和定期定额投资业务的公告》和其他有关基金转换公告。 转换业务的收费计算公式及举例参见 2016 年12月2日刊登于本公司网站的《北信瑞丰基金基金转

十四、基金份额的转让 在法律法规允许且条件具备的情况下,基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交 场所或者交易方式讲行份额转让的电请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基 份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让 。 十五、基金的非交易讨户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承。捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以 及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户,或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式 进行处理的行为。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资 继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人

各其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体:司法强制执行是指司法机构依据生效司 文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人 法人或其他组织。办理非交易讨户必 在又书孙基並订制時有人好有的基並订制强制知粹結集他自然人。法人以具他组织。 办理非交易过户必 或提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办 里,并按基金登记机构规定的标准收费。

十六,基金的转托管 基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定

标准收取转托管费 上 定期定额投资计划 十七、定明定额区设计划 本基金已干通定期定额投资业务。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每 扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低

十八、基金的冻结和解冻 基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法 法规的其他情况下的冻结与解冻。

九、基金的投资

本基金在严格控制风险的前提下,通过相对灵活的资产配置,重点投资于受益于中国经济发展而快 速成长的上市公司,谋求基金资产的长期、稳定增值。

本基金的投资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的股票(包含中小板、创业 反及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、 公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券)、资产支持证券、债券回 构、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合 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,可以将其纳入

基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0% - 95%.80%以上的非现金基金资产投资

新金田的投資組合化的分。180票投資自基金資产的化的內的第一的6%。80%。80%以上的非認達基金資产方成长型上市公司证券。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金个包括结算备付金,存出保证金。应收申购款等,校证投资比例不得超过基金资产净值的3%;本基金投资于其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 三、投资策略 二、1次页 來吧 本基金的投资策略分为两个层面:首先,依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在 大类资产间的分配比例;而后,进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投

大笑或广向的分配比例;而启,还行者大笑或广中的个成、个多 策略、固定收益类资产投资策略和权证投资策略四部分组成。 1、大类资产配置策略 本基金将在基金合同约定的投资范围内,结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析,自上而 地实施积极的大类资产配置策略。主要考虑的因素包括:

(1)宏观经济指标:年度/季度GDP增速、固定资产投资总量、消费价格指数、采购经理人指数、进出 1数据、工业用电量、客运量及货运量等: (2)政策因素:税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策,利率水平、货币净投放等货币政

(3)市场指标:市场整体估值水平、市场资金的供需以及市场的参与情绪等因素。 结合对全球宏观经济的研判,本基金将在严格控制投资组合风险的前提下,动态调整基金资产在各 类资产间的分配比例,力图规避市场风险,提高配置效率。

2、股票投资策略 1、成长主题上市公司股票的界定 结合目前国家、社会以及技术进步的未来发展趋势,本基金管理人将从如下两个方面界定成长主题 关行业和公司:

1)、成长性行业的优选 (17.成长任行业的心思: 1) 在中国经济转型长周期过程中,表现显著高于市场总体水平的行业; 2) 在产业升级,模式创新,技术创新,行业细分等领域涌现出的具有成长潜力的新兴行业; 3) 在短期市场景气波动周期中,如经济复苏,行业复苏中存在的阶段性快速发展的行业。

(2)、成长性公司的精洗: 1)公司成长战略清晰可行;

17次三0成CKR@时间中3月7; 27公司治理持約有效,管理层稳定; 37公司的盈利模式具备一定壁垒。竞争者难以模仿; 47公司掌握专门技术或具备技术领先优势; 57公司提供的产品或服务在市场上具备领先优势,有较高的品牌知名度和客户忠诚度。

若未来由于技术进步或政策变化导致本基金成长主题相关行业和公司相关业务的覆盖范围发生变

本基金主要采取"自下而上"的选股策略,基于对上市公司成长性和估值水平的综合考量,使用定性 京定量相结合的方法精选股票进行投资。 (1)、首先,使用定性分析的方法,从技术能力、市场前景以及公司治理结构等方面对上市公司的基

在技术能力方面,选择研发团队技术实力强、技术的发展与应用前景广阔并且在技术上具有一定扩 在市场前景方面,需要考量的因素包括市场的广度、深度、政策扶持的强度以及上市公司利用科技创

斯能力取得竞争优势,开托市场,进而创造利润增长的能力。 公司治理结构的优劣对包括公司战略、创新能力、盈利能力乃至估值水平都有至关重要的影响。本基 金将从上市公司的管理规则作、战略定位和管理制度体系等方面对公司治理结构进行评价。 (2)、其次,使用定量分析的方法,通过财务和运营数据进行企业价值评估。本基金主要从行业景气

度、盈利能力、成长能力以及估值水平等方面进行考量。 1)行业景气度

本基金通过一系列定量指标对行业景气度进行研判。这些指标包括行业销售收入增长率、行业毛利 秦和净利率、原材料和成品价格指数以及库存率等。通过与历史和市场平均水平进行比较,并结合定性分 折的结果来评判行业的景气度水平。 2)盈利能力

本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力,主要参考的指标包括净资产收益率 本基金通过成长能力分析评估上市公司未来的盈利增长速度,主要参考的指标包括EPS增长率和主

4)估值水平 本基金通过估值水平分析评估当前市场估值的合理性,主要参考的指标包括市盈率(P/E)、市净率

中華並通以10世ルケーアの「中に自用中の10世間で17年15、工会参与17担から26中量率( 7月)、市益増长比率(PBG)、自由現金流貼現(FCFF,FCFE)和企业价值/EBITDA等。 3、固定收益类资产投资策略 在进行固定收益类资产投资时,本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、 (转换债券投资策略和资产支持证券投资策略,选择合适时机投资于低估的债券品种,通过积极主动管

则财政政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上, 预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。 组合久期是反映利率风险最重要的指标。本基金将根据对市场利率变化趋势的预期,制定出组合的 

市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素,评价债券发行人的信用风险,并根据特定债券的 发行契约,评价债券的信用级别,确定企业债券、公司债券的信用风险利差。 (3) 套利交易資格 在預測和分析同一市场不同板块之间(比如国债与金融债)、不同市场的同一品种、不同市场的不同

版块之间的收益率利差基础上,基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差基础上,基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的。但是在某种情况下,比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破,若能提前预测并进行交易,就可进

行套利或減少损失。 (4)可转换债券投资策略 着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究,同时兼顾其债券价值和转换期权价值,对那些有

電缸列 印表模版乔利 丛印雄電版探視分析 "可財力",同时课顺具版秀的"国和表现界校的""但,对那些有着较强的盈利能力或成长部力的上市公司的可转换债券进行重点投资。 本基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本而进行分析,包括所处行业的景气度,成长性、 该心竞争力等,并参考而类公司的估值水平,研判发行公司的投资价值,基于对利率水平、票息率及派息 频率。信用风险等因素的分析,判断其债券投资价值,采用期权定价模型。估算可转换债券的转换期权价

直。综合以上因素,对可转换债券进行定价分析,制定可转换债券的投资策略。 (5)资产支持证券投资 (5) 页户文符证券投资 本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定 模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以 降低流动性风险。

4. 权证投资策略 本基金还可能运用组合财产进行权证投资。在权证投资过程中,基金管理人主要通过采取有效的组策略,将权证作为风险管理及降低投资组合风险的工具: (1)运用权证与标的资产可能形成的风险对冲功能,构建权证与标的股票的组合,主要通过波幅套

可及风险对冲策略实现相对收益; 以应对伊柬哈头现怕对收益; (2)构建权证与债券的组合,利用债券的固定收益特征和权证的高杠杆特性,形成保本投资组合;

(3)针对不同的市场环境,构建骑墙组合、扼制组合、蝶式组合等权证投资组合,形成多元化的盈利

模式; (4)在严格风险监控的前提下,通过对标的股票、波动率等影响权证价值因素的深入研究,谨慎参与

(4) 化广省日本经验加强企业 (4) 化广省日本经验加强企业 (4) 化广省日本经验 (4) 从杠杆放大为目标的权证投资。若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。

四、投资决策依据和决策程序 12.1.发现於東京地區中心東平區17 1. 决策依賴 (1) 国内国际宏观经济环境; (2) 国家财政、货币政策,产业政策、区域规划与发展政策; (3) 证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况;

4)上市公司的行业发展状况。景气指数及竞争优势

(6)上市公司盈利能力、增长能力和创新能力、以及对公司综合价值的评估结论; (6)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

 2、决策程序
 1)投资决策委员会制定整体投资战略; 2)研究部根据自身或者其他研究机构的研究成果,构建各级股票池,对拟投资对象进行持续跟踪

研,并提供个股,债券决策支持; 析,并定股上版、同好於果文行; (3)投资部根据投资决策委员会的投资战略,在研究支持下,结合对证券市场、上市公司、投资时机 分析,规定所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、策略配置,行业配置,重仓个股投资方案; (4)投资决策委员会对投资部提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要;

(5)研究部定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案

五、汉文政时 (一)禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动: (1)承销证券; (2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(2) ) 加東東亞中區大阪東東東東京 (3) 从事東但无限費任的投资; (4) 汉李其他基金份额,但是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、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

>每半年对关联交易事项讲行审查。

(7) 法甲、打政法次附中国证监云观企业口负责他占切。 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 当苦关系的公司发行的证券或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 注目标和投资策略,遵循基金份额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 则,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

生之1年十年六月大阪大公南中坝址行甲重。 法律、行政定规或监督部门取消上述禁止性规定,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。 (二)投资组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制 (1)股票投资占基金资产的比例为0%-95%,80%以上的非现金基金资产投资于成长型上市公司

安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。基金管理人董事会应

正券; (2)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,其中,现金不包括结算 ··· 各付金,存出保证金。应收申购款等。 (3)本基金持有一家公司发行的证券,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公司发行的证券,不超过该证券的10%; (5)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) / 本華並持有的主語以证,其印值小等超过基並實// [中国的35]; (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过法权证的10%; (7) 本基金在任何交易日买人权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%; (8) 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,不得超过基金资产净值的10%; (9) 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%;

10)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

, (11)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%; (12)本基金应投资于信用级别评级为BB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 间,如来共同用等级下降、不再行百枚效标准,这往并级成百效和之口减少了为内寸以至命头口; (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的总资产,本基金所申报的股票数量不超过机发行股票公司本次发行股票的总量;

(14) 本基金进入全国银行间同业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 基全在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年、债券回购到期后不得展期。

公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得 超过该上市公司可流通股票的30%

(18) 本基金主对投资干流对性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款 所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(19) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

基金管理 人 应当自其全会同生效之日起6个日内使基金的投资组会比例符合基金会同的有关约定

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。 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以调整后的规定为准。 六、业绩比较基准 中证800指数收益率×30% + 中证综合债券指数收益率×70%

中证800指数收益率×30% + 中证综合领外指数收益率×70% 中证800指数是由中证指数有限公司开发的中国A股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市。中证800指数成分股覆盖了中证500和沪深300的所有成分股,综合反映沪深证券市场内大中小市值

司的整体状况,具有一定权威性,适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中证综合债券指数是-宗合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,适合作为 \* 其今债券郊公的业绩比於其准 本基金是混合型基金,基金在运作过程中将维持0%-96%的股票投资,其余资产投资于债券及其他 具有高流动性的规期金融工具。本基金将业级比较基准中股票指数与债券指数的权重确定30%和70%, 并用中证综合债券指数收益率代表债券资产收益率。因此,"中证800指数收益率×30% + 中证综合债

券指数收益率×70%"是衡量本基金投资业绩的理想基准。 若未來市场发生变化导致此处就上较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准用,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时,基金管理人有权根却市场发更快况及本基金的投资范畴积投资率。现象本基金的业绩比较基准,业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一级,并在更新的招募说明书中列示,而无需召开基金

份额持有人大会, 七、风险收益特征

本基金为混合型基金,具有较高預期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益低于股票型基金。高于债券型基金和货币市场基金。 ,八、基金管理人代表基金行使股东权利、债权人权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利、债权人权利,保护基金份额持有人的

, 2、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理; 3. 有利于基金财产的安全与增值; 4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。 九、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其 内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人中信建投证券股份有限公司根据基金合同规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载,误导性陈述或者重大遗漏。 本投资组合报告所载数据截至2022年3月31日,本报告所列财务数据未经审计。

9.1 报告期末基金资产组合情况 定收益投资 其中:债券 资产支持证 ≥融衍生品投资 E人返售金融等 中:买断式回购的买人返售金融资 行存款和结算备付金合 注:由于四舍五人的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可

能有星差 9.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	-	-
C	制造业	4,459,297.20	59.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
Ε	建筑业	-	_
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,478,952.28	33.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	118,331.00	1.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	-	-
Ω	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,056,580.48	94.21

9.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

9.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

9.3.1报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 占基金资产净值出 例(%) 股票名称 数量(股) 铜峰电子 審商信息 天顺风能 国联股份 新强联

9.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组金 本基金本报告期末未持有债券。 9.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

福莱特

9-3 ) 取占纳不以公元(10) (国仁基金並) 广伊·国比尼罗/人/ 14/8/74 ) 即且在国境对发现明知 本基金本报告期未未持有债券。 9.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。 9.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属

9.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 (1)本基金本报告期末未持有股指期货

(1) 本基金平成口郊木木-F中级目的/成。 (2) 本基金-松长-笛内木-进行股捐明货交易。 9.9.2本基金投资股捐期货的投资政策 本基金投资范围未包括股捐期货,无相关投资政策。 9.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 9.10.1 本期国债期货投资政策 9.10.1 本期国领明 反役買政東 本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。 9.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益 (1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易 9.10.3 本期国债期货投资评价 本基金报告期内未参与国债期货投资,无相关投资评价。

本基金报告期内未参与国面明的投资,尤相大投资评价。 9.11 投资组合报告附注 一、二、三、四、五、六、七、八、九、十、十一、9.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体 本期受到调查以及处罚的情况的说明 交到响直以及处500%的行动的场势 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日 - 在内受到公开谴责 外罚的情形

4-1752到公开吨级、XVIII31间形。 9.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。 9.11.3 其他资产构成

立收证券清算制 2收申购# 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细本基金本报告期末未持有处于转股期的可转

9.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在溶通受限情况 0.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

9.11.6 校政组合依否附注的共鸣2.7 + 10.12 = 10.7 由于计算中四舍五人的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。 十、基金的业绩 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的 1199950円17。 北信瑞丰新成长灵活配置混合型证券投资基金合同生效日2015年11月11日,基金业绩截止日2022 年3月31日。

净值收益率 标准差② ① – ③ 2-4 阶段

1.00%

北信瑞丰新成长

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投 资所形成的价值总和。

《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可

23.339

0.38%

17 不编制当期季度报告 4

75.0437011世纪末4。 二、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。 三、基金财产的账户 基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他 专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账

58,39%

:根据基金合

户以及其他基金财产账户相独立。 四、基金财产的保管和处分 本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产,并由基金托管人保管。基金托管 人对实际交付并控制下的基金财产承担保管职责,对于非由基金托管人保管的财产不承担责任。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任,其债权人不得

对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外,基金财产不 每飲欠行。 基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产 不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权,不得与其固有资产产生的债务相互抵 销;基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。 十二. 基金资产估值

一、估值日 估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金

净值的非交易日 基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

. 估值原则

二、1位值原则 对于存在活跃市场的情况下,以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值;对于活跃市场 报价未能代表计量日公允价值的情况下,对市场报价进行调整以确定计量日的公允价值;对于不存在市 场活动或市场活动很少的情况下,则采用估值技术确定其公允价值。 四、估值方法

证券交易所上市的有价证券的估值 (1)交易所上市的有价证券(包括股票,权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发

行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交 易市价,确定公允价格。

10月,明定公元50日。 (2)在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构 供的相应品种当日的估值净价估值。 (3)对在交易所市场上市交易的可转换债券,按照每日收盘价作为估值全价。 (4)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券,估值日不存在活跃市场时采用估值技术

确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值,应持续评估上述做法的适当性,并在情况发生

量公允价值的情况下按成本估值。 (3)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况 F,按成本应对市场报价进行调整,确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况 下,则采用估值技术确定公允价值。

(4) 首次公开设行自由较小900亿公司记值。 (4) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值,非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 3. 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净 介或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记截止日(含当日)后未行使回售 权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按 成本估值。 4、存款的估值方法

任方:

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。

3节目37871元3977参见近点77节80以外至274.1267以36.121070平空上1990人7630人7。 5.投资证券行生品的价值方法 (1)从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的 收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估 值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考监管机构或行业协会有关规定,或者类似投资品 种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行估值。 6、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据. 7、因持有股票而享有的配股权,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的

感显行色入场运出,这级相反较轻力过时间到了相互相互相。 10.相关法律法规以及监督部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法,程序及相关法律法规的规 或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通识对方,共同查明期因、双方协商解决。 根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会 计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论

后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布

值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。 六、估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。 当基 金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。 基金合同的当事人应按照以下约定处理

过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人 ("受损方")的直接损失按下述"估值错误处理原则"给予赔偿,承担赔偿责任 上述估值错误的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差

错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对重接损失承担赔偿责任,若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况的有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。 (2)估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有 关直接当事人负责,不对第三方负责。 (3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对

(4)估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(3)根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数期的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数期的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的 | 1 / 建立以が呼呼順日が日の日の中の日の日の日の日本日の日本日の日本日に、四国を選出て日へ、万千年以口を担け | 描施防止損失进一歩扩大。 | (2) 错误偏差达到基金份額净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告

七、新停估值的情形 基金投资所洗及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时: 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时; 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商一致的;

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值计发送给基金托管人,基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人按规定对基金净值予以公布。 、基金管理人或基金托管人按估值方法的第9项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错

2、由于不可抗力原因,或由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误等原因,基金管理人和 基金杆管人虽然已经采取必要 适当 合理的措施进行检查 但是未能发现该错误的 由此造成的基金资 产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已 **立**理收益指基金利润减去公允价值变动收益后的全额 其全可供分配利润 基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

得低于该次可得失過至3月13年17月前度「/本建立设平平设置力配公成成分为126人。或以收益2月16日9/ 得低于该次可性外质利润的25%。若《基金合同》生效不测个月可不进行收益分配。 2、本基金收益分配方式分两种。现金分红与红利再投资、投资者可选择现金红利或将现金红利自动 转为基金份额进行再投资,若投资者不选择、本基金账认的收益分配方式是现金分红。 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。即基金收益分配基准目的基金份额净值减去每单位

太其全收3公元的30元公司 5人加 太其全收3公元百安五其全等理人拟完 并由其全环等人有核 按规定在提完储存公生

定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依昭《业务规则》执行。 十四、基金的费用与税收

3.48基出的目前60%为证。 4.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用,法律法规,中国证监会另有规定的除外; 5.《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费; 6.基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用; 8.基金的银行汇划费用: 9.基金的相关账户的开户及维护费用:

9.基金的相关账户的升户及维护级用; 10.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

H为每日应计提的基金托管费 等,支付日期顺延。

E为前一曰的基金资产净值 基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无

E、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用 (7.75)以而不为以企业以市、 、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失; 、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用; 编制基金会计报表

载于指定媒介上。

一次基金份额净值和基金份额累计净值。

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认

、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事

务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计

2.会计师事务所更换经办注册会计师,应事先征得基金管理人同意。 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需按规定 在指定媒介公告。

十六、基金的信息披露 、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关

规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时,本基金从其最新规定。 二、信息披露义务人 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人

等法律法规用中国证监金规定的自然人法人和非法人组织。 本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规

定披露基金信息,并保证所被露信息的真实性、准确性、无影性、及时性、简明性和易得性。 本基金信息拔露、多人应当在中国证监会规定时间内、将应予披露的基金信息通过中国证监会的全国性报刊(以下简称"指定报刊")和排定互联网网站(以下简称"指定网站")包括基金管规划》的现在分的全国性报刊(以下简称"指定网站")包括基金管规划》,以前经过,以下简称"指定网站"包括基金管规人网站,基金托管人网站,中国证监会基金电子披露网站)等媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约

定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏; 2、对证券投资业绩进行预测; 3、违规承诺收益或者承担损失; 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字; 国证监会禁止的甘他行为 6、中国此监云宗止的县他行79。 四、本基金公开披露的信息的文本 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证不同

文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,以中文文本为准。 本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。 五、公开披露的基金信息

瓜、公开被解的建金信息包括: (一)基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议 1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2.基金招募访明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项、说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资基金产品特性、风险揭示。信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金产品资料概要是基金得募纳用护劢模型文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。 基金合同生效后,基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在

金产品资料概要。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利。

三)《基金合同》生效公告 (三)(本金近日)(主次以口) 基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。 (四)基金净值信息 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在指定网站公

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登

在开始办理基金份额申购或考赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过其指定网 在打架4分型4基亚可源中跨域省域归归,基亚目建入应当在个成了设计打成口的公口,但以具有足网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放目的基金分额等值和基金分额实计净值。 基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站公告半年度和年度最后一日的 (五)基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算

式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金销售机构网站或者营业网点查阅或者复制前述信

月放送日本中央18年2年11日 ・ 自 資料。 (六)基金定期报告,包括基金年度报告,基金中期报告和基金季度报告(含資产组合季度报告) ・ 「カース・18年2年11日 - 18年2年11日 - 18年2年11日 - 18年2年11日 - 18年2日 基金管理人应当在每年结束之日起三个月,编制完成基金年度报告,将年度报告登载于指定网站上, 并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券,期货 打得不免限任证公司总量的证据定取引。 据关业务资格的会计师事务所审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告费载在指定网 站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。 基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定

x基金持续运作过程中,应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的 权益,基金管理人至少应当在基金定期报告"影响投资者决策的其他重要信息"项下披露该投资者的类 别。报告期末持有份额及占比。报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险。中国证监会认定的特殊

网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。 《基金合同》生效不足2个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项; 2、《基金合同》终止、基金清算; 3、转换基金运作方式、基金合并; 1、更换基金管理人、基金托管人

4、至映盛至日生八、盛至几日八、秦至九日、 5、基金曾里人委托基金职务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金 5机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项; 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更; 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人 3、基金募集期延长: 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动; 5.基金官理人商级自理人风,基金总理科基金打官人等[基金尤首即]贝贝人及主变观; 10.基金管理人的董事任最近12个月内变更超过百分之五十; 11.基金管理人,基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三

12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁 13.基金管理人或基础与建业分、基础工与显示的对外或或种类; 13.基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚; 超、基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚; 14、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,中国证监会 另有规定的情形除外: 15. 基金收益分配事项: 10、毫重改 (正) 加宁寧() 情息管理费 : 計管費、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更; 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五; 18、基金改聘会计师事务所;

18. 基立区内等江州单等所;
19. 更越基金登记机构;
20. 本基金产生巨额赎回并延期办理;
21. 本基金产生巨额赎回并延期办理;
22. 本基金连续发生巨额赎回并延期办理;
23. 本基金暂停接受申购,赎回申请或重新接受申购,赎回申请。
24. 发生涉及基金申购,赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;

為、基金官息收錄义务人认为中能对基金份額符有人权益或者基金份額的价格产生與大影响的具他事項或中国证監会規定的其他事項。 (八)澄清公告 在《基金合同》存续期限内,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格 产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后 应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

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

清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定 将刊上

(十二)中国正監会規定的其他信息。六、信息披露事务管理基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理 基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等

」的规定。 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的 基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。

务的质量。具体要求应当符合中国证监会相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用,该费用不得从基 1904年,美华大学不是当代日子国生品的《1907年) 1924年) 基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,法可以根据需要在其他公共媒介披露信 基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,法可以根据需要在其他公共媒介披露 墓並日理八、造並工戶へ降町な伝い日上來月上級時日20分1分。 1,但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。 为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作。

十七,风险揭示 风险揭示

(2)经济周期风险 证券市场是国民经济的晴雨表,而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的 收益水平产生影响,从而产生风险。

(3)利家风险 (3) 科學內內經 金融市场利率被动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成 本和利润水平。基金投资于股票和债券,收益水平会受到利率变化的影响。 (4)上市公司经营风险

(5) 购买力风险 如果发生通货膨胀,基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵销,从而影响基金资产的保 2.信用风险

指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致 本基金将通过采取控制信用等级、投资比例限制、信用风险预算并比较等措施逐步加强对信用风险 的控制。

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险, 单一的久期指标并不能充分反

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响,这与利率上升所带来的价 格风险(即前面所提到的利率风险)互为消长。具体为当利率下降时,基金从投资的固定收益证券所得的 利息收入进行再投资时,将获得较少的收益率。

(1)基金申购、赎回安排 本基金申购, 赎回的具体安排请参见招募说明书第八部分的内容。

(3) 巨额晚上间形下时3元以上从80户3年19版 基金出现巨额晚间情怀,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况 决定全额赎回或部分延期赎回。同时,如本基金单个基金份额持有人在单个开放目申请赎回基金份额超 过基金总份额一定比例以上的,基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。 (4)实施备用的流动性风险管理工具的情形。程序及对投资者的潜在影响

(〒)何身板台 基金合同终止情形出现的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出

占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细

角度, 在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下, 自主提升信息披露服

底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年 七、信息披露文件的存成与查阅 依法必须披露的信息发布后,基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所,以供社会公众查阅、复制。

货币政策,财政政策,产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响,导致市场价格波动,

上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变 化,从而导致基金投资收益变化。

4年基金中央、2008年20年中多元由9900年10年7日3月197日。 (2) 12投资市场,行业资产的流动性风险评估。 基基金的投资市场主要为证券交易所,全国银行同债券市场等流动性较好的规范型交易场所,主要 投资对象为具有复好流动性的金融工具。但括国内依法发行上市的股票,债券和货币市场工具等),同时 本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征,综合评估在正常市场环境下本基金

3、债券收益率曲线变动风险

(下转B059版

(2)首次发行未上市的权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情 忍下,按成本估值。 (3)因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值进行

情况下,按成本估值。 8、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的、按债券所处的市场分别估值。 9、如有额值证据录明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况 与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值

五、近世程列 1.基金份額沖值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算、精确 到0.001元,小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。 基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。 2.基金管理人均每个工作日对基金资产估值,但基金管理人根据治律法规或基金合同的规定暂停估。

(1)估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更 正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值

藤並立市即51事へ应収無以下50足处理: 1、估值错误类型 本基金运作过程中, 如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的

(5) 於同位間經典的原序中,每年時間至華外的当事人不返还或不全都返还不当得利益其他当事人的利益损失(受损方"),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的公事人享有要求交付不当得利的权利,如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受利的当事人已经将此部分不当得利返还给受 损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额 部分支付给估值错误责任方。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形

三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不

配数额及比例、分配方式等内容。 五、收益分配方案的确定、公告与实施 各金並收成7月成分配基本自生/1802.7円益並71日/人夏次130%已代訂在289/1公口。 基金红利发放日距源收益分配基准日(即可供分配利潤计算截止日)的时间不得超过15个工作日。 六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一

2. 基金托管人的托管费: 3. 基全的销售服务费。

1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.8% - 当年天教

3、基金销售服务费

(4) 16值指误处理程序 3. 估值错误处理程序 估值错误处现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下 (1)查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责 , (2)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

十三、基金的收益与分配 、基金利润的构成

基金份额收益分配金额后不能低于面值; 4、每一基金份额享有同等分配权; 5. 法律法规或监管机关早有规定的 从其规定。

划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下: H=E×0.2%÷当年天数 H为每日应计提的基金销售服务费

一、 本並云 F 以 取 1. 基金管理 人为本基金的基金会计责任方;
2. 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果《基金合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度披露;
3. 基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;
4. 会计制度执行国家有关会计制度;
5. 本基金处址中枢: 如今社会管

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算、按照有关规定

H=E×0.8% - ヨキ犬奴 H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值 发现的目录,基础自己人类设计)从分别是十五年日7万条基础对于一个任义的日本显显自全人。 假日、公休假等,支付日期间延。 2.基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

(3)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分

1、基金管理人的管理费

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书,并登载在指定报刊和指定 前款所称重大事件,是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事

25、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他

报刊上。 (十一)资产支持证券的投资情况 本基金投资资产支持证券,基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金 季度报告中披露其持有的资产支持证券总额。资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。 报金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。 报送信息的真实、准确、完整、及时。 基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外,也可着眼于为投资者决策提供有用信息的

法金分额持有人须了解并承受以下风险: 1.市场风险 证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动,将对 本基金资产产生潜在风险,主要包括 (1)政策风险

5、流动性风险 在基金交易过程中,可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难,导致流 动性风险,甚至影响基金份额净值。

(3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

(主) 关心思用可以可以不过不可以 在市场大幅级动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时,基金管理人将 以保障投资者合法权益为前提,严格按照法律法规及基金合同的规定,谨慎选取延期办理巨额赎回申请、 暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类