（上接B015版）

第六部分 基金合同当事人及权利义务

一、管理人
（一）管理人简况
名称：上海光大证券资产管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层
法定代表人：熊国兵
设立日期：2012年5月9日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2011]1896号
注册资本：2亿元人民币
联系电话：021-22169999
（二）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，管理人的权利包括但不限于：
（11）在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为集合计划提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资和非交易过户等业务规则；
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：
（2）办理基金备案手续；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不少于法律法规的规定；
二、托管人
（一）托管人简况
住所：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
注册资本：466.79095亿人民币
法定代表人：李晓鹏
成立日期：1994年4月12日
批准设立机关及批准设立文号：国务院、国函[1992]7号
注册资本：590.86亿元人民币
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔2002〕75号
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不少于法律法规的规定；
（12）建立并保存集合计划份额持有人名册；
（15）依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定，召集集合计划份额持有人大会或配合集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；
（21）执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；
三、集合计划份额持有人
投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，投资者自依据《资产管理合同》取得的集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的份额。集合计划份额持有人作为《资产管理合同》当事人并不以在《资产管理合同》上书面签章或签字为必要条件。
同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于：
（7）执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；
集合计划份额持有人大会由集合计划份额持有人组成，集合计划份额持有人的合法授权代表有权代表集合计划份额持有人出席会议并表决。集合计划份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。
本集合计划份额持有人大会实行立项制。根据本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划份额持有人大会会前提案，在本集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；
（11）保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不少于法律法规的规定；
（12）建立并保存集合计划份额持有人名册；
（15）依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定，召集集合计划份额持有人大会或配合集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；
（21）执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；
三、集合计划份额持有人
份额持有人大会由集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，份额持有人自依据《资产管理合同》取得的集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的份额。集合计划份额持有人作为《资产管理合同》当事人并不以在《资产管理合同》上书面签章或签字为必要条件。
除法律法规另有规定或本基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。
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：
（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（8）遵守《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务还包括但不限于：
（2）首次公开发行未上市的股票和债券，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下，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）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），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唯一估值净价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、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。
5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。
6、股指期货合约、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。
7、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。
8、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划的估值的公平性。
9、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价。
10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，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，按照管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。
五、估值程序
1、某一类别集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，某类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。
每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。
2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。
六、估值错误的处理
管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当集合计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。
1、估值错误类型
对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行：
由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该长估错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。
2、估值错误处理原则
1)按法律法规规定处理的其他原则处理估值错误。
4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：
（1）集合计划份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。
（2）错误偏差达到集合计划份额净值的0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到集合计划份额净值的0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案。
（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。
七、暂停估值的情形
1、集合计划所涉及的证券、期货交易市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业或港股通临时暂停时；
2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。
八、基金净值的确认
基金资产净值和各类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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。
九、特殊情形的处理
1、管理人或托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。
2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构及登记结算公司、存款银行发送的数据错误等，管理人和托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而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
3、管理人或托管人因计算机系统发生故障而导致集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
4、由于证券交易所、证券登记结算机构、期货交易所、证券经纪商、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构发生错误给集合计划份额持有人造成损失的，若上述外部机构能够赔偿损失，管理人、托管人应当在其赔偿范围内向集合计划份额持有人赔偿。除上述外部机构能够赔偿损失外，由于上述外部机构的原因给集合计划份额持有人造成损失的，管理人、托管人应当在赔偿金到位后，在扣除因处理赔偿事宜而发生的合理费用后，将赔偿金按照集合计划份额持有人的损失比例进行分配。
5、由于证券交易所、证券登记结算机构、期货交易所、证券经纪商、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的过错导致集合计划份额持有人遭受损失，若该外部机构未赔偿损失或赔偿损失不足以弥补集合计划份额持有人的损失的，管理人、托管人应当积极向有关责任方追偿集合计划份额持有人的损失。
6、由于证券交易所、证券登记结算机构、期货交易所、证券经纪商、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的过错导致集合计划份额持有人遭受损失，管理人、托管人应当积极向有关责任方追偿集合计划份额持有人的损失。
7、由于不可抗力造成集合计划份额持有人的损失，管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。
8、由于投资者、证券经纪商、证券/期货经纪机构、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的过错导致集合计划份额持有人遭受损失，若该外部机构未赔偿损失或赔偿损失不足以弥补集合计划份额持有人的损失的，管理人、托管人应当积极向有关责任方追偿集合计划份额持有人的损失。
9、管理人、托管人免除赔偿责任的情形
（一）管理人职责终止的情形
1、被依法取消管理人资格；
二、管理人和托管人的更换程序
（一）管理人的更换程序
5、公告：管理人更换后，由托管人在更换管理人的集合计划份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告；
6、交接：管理人职责终止的，管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收。新任管理人应与托管人核对集合计划资产总值；
7、审计：管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在集合计划财产中列支；
（二）托管人的更换程序
5、公告：托管人更换后，由管理人在更换托管人的集合计划份额持有人大会决议生效后2日内在指定媒介公告；
6、交接：托管人职责终止的，应当妥善保管集合计划财产和集合计划托管业务资料，及时办理集合计划财产和集合计划托管业务的移交手续，新任托管人或者临时托管人应当及时接收。新任托管人与管理人核对集合计划资产总值；
7、审计：托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在集合计划财产中列支。
（三）管理人与托管人同时更换的条件和程序
3、公告：新任管理人和新任托管人应在更换集合计划份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上联合公告。
三、新任基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务，或新任基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原基金管理人或原基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。
四、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

第十部分 基金份额持有人大会

集合计划份额持有人大会由集合计划份额持有人组成，集合计划份额持有人的合法授权代表有权代表集合计划份额持有人出席会议并表决。集合计划份额持有人持有的每一集合计划份额拥有平等的投票权。
本集合计划份额持有人大会实行立项制。根据本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划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根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。
一、召开事由
1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会，但法律法规另有规定或本合同另有约定的除外：
（1）终止《资产管理合同》（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）；
（5）调整管理人、托管人的报酬标准；
2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：
（2）调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；
（6）管理人、登记机构、销售机构调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
（7）公募基金业绩报酬相关法律法规发布后，本合同约定的业绩报酬相关条款根据法律法规进行调整的；
二、会议召集人及召集方式
2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集；
三、召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人；书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为托管人，则应另行书面通知管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为集合计划份额持有人，则应另行书面通知管理人和托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督，管理人或托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。
四、集合计划份额持有人出席会议的方式
2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。
（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；
（3）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不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小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三分之一以上（含三分之一）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。
（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、委托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符；
3、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人大会亦可采用网络、电话、短信或其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行。集合计划份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明；
4、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人可采用其他书面或录音方式召开授权他人代为出席集合计划份额持有人大会并行使表决权，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。
六、表决
2、特别决议，特别决议应当经参加大会的集合计划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）通过方可做出。除本合同另有约定外，转换集合计划运作方式、更换管理人或者托管人、终止《资产管理合同》、本集合计划与其他集合计划合并以特别决议通过方为有效。
采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。
七、计票
2、通讯开会
在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在托管人授权代表（若由托管人召集，则为管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。管理人或托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。
八、生效与公告
集合计划份额持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告集合计划份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。
九、本部分关于集合计划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或监管规则的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人经与托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

第十一部分 基金份额持有人权益的享有、行使和限制

一、基金份额持有人的权益
（一）基金份额持有人享有的权益
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权益包括但不限于：
（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算剩余基金财产的权利；
（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额的权利；
（4）按照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的权利；
（5）对基金份额持有人大会所审议事项行使表决权的权利；
（6）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、登记机构、基金投资顾问、基金投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的监督权；
（7）查阅、复制与其所持有的基金份额有关的部分基金财产会计账簿、报表、记录和其他相关资料的权利；
（8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、登记机构、基金投资顾问、基金投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的违反法律、法规、《资产管理合同》、《基金份额持有人权益说明书》或其他有关规定的行为，依法提起诉讼或仲裁的权利；
（9）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、登记机构、基金投资顾问、基金投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的违反法律、法规、《资产管理合同》、《基金份额持有人权益说明书》或其他有关规定的行为，有权向中国证监会、证券业协会或其他有关机构举报或投诉的权利；
（10）法律法规、中国证监会和《资产管理合同》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）遵守《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务还包括但不限于：
（2）首次公开发行未上市的股票和债券，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下，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）流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），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唯一估值净价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、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。
5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。
6、股指期货合约、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。
7、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。
8、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划的估值的公平性。
9、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价。
10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。
五、估值程序
1、某一类别集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，某类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。
每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。
2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。
六、估值错误的处理
管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当集合计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。
1、估值错误类型
对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行：
由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该长估错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。
2、估值错误处理原则
1)按法律法规规定处理的其他原则处理估值错误。
4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：
（1）集合计划份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。
（2）错误偏差达到集合计划份额净值的0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到集合计划份额净值的0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案。
（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。
七、暂停估值的情形
1、集合计划所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业或港股通临时暂停时；
2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。
八、基金净值的确认
基金资产净值和各类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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。
九、特殊情形的处理
1、管理人或托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。
2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构及登记结算公司、存款银行发送的数据错误等，管理人和托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而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
3、管理人或托管人因计算机系统发生故障而导致集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。
4、由于证券交易所、证券登记结算机构、期货交易所、证券经纪商、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构发生错误给集合计划份额持有人造成损失的，若上述外部机构能够赔偿损失，管理人、托管人应当在其赔偿范围内向集合计划份额持有人赔偿。除上述外部机构能够赔偿损失外，由于上述外部机构的原因给集合计划份额持有人造成损失的，管理人、托管人应当在赔偿金到位后，在扣除因处理赔偿事宜而发生的合理费用后，将赔偿金按照集合计划份额持有人的损失比例进行分配。
5、由于证券交易所、证券登记结算机构、期货交易所、证券经纪商、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的过错导致集合计划份额持有人遭受损失，若该外部机构未赔偿损失或赔偿损失不足以弥补集合计划份额持有人的损失的，管理人、托管人应当积极向有关责任方追偿集合计划份额持有人的损失。
6、由于证券交易所、证券登记结算机构、期货交易所、证券经纪商、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的过错导致集合计划份额持有人遭受损失，管理人、托管人应当积极向有关责任方追偿集合计划份额持有人的损失。
7、由于不可抗力造成集合计划份额持有人的损失，管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。
8、由于投资者、证券经纪商、证券/期货经纪机构、证券/期货投资咨询机构、律师事务所、会计师事务所、银行业金融机构、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构的过错导致集合计划份额持有人遭受损失，若该外部机构未赔偿损失或赔偿损失不足以弥补集合计划份额持有人的损失的，管理人、托管人应当积极向有关责任方追偿集合计划份额持有人的损失。
9、管理人、托管人免除赔偿责任的情形
（一）管理人职责终止的情形
1、被依法取消管理人资格；
二、基金管理人和基金托管人的更换程序
（一）基金管理人的更换程序
5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告；
6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值；
7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支；
（二）基金托管人的更换程序
5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告；
6、交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值和净值；
7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支。
（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序
3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上联合公告。
三、新任基金管理人或临时基金管理人接收基金管理业务，或新任基金托管人或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。原基金管理人或原基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。
四、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第十二部分 基金的投资

一、基金的投资目标
本集合计划的投资目标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（含创业板、中小板及其他经中国证监会允许集合计划投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、回业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货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（但须符合中国证监会相关规定）。
三、投资策略
（二）股票投资策略
1、行业配置策略
基金管理人将跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC变动情况，依此来判断各行业的景气度，再根据行业整体的估值情况、市场的预期、目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。
2、股票投资策略
（1）股票组合的构建
本基金首先通过行业发展前景及竞争格局考察、公司竞争力分析、公司可持续成长潜力评估及投资吸引力评估等四个层面的综合比较初步筛选出投资备选股票。然后，以全球市场为参照，通过对经济发展阶段、行业发展阶段和前景、公司综合竞争能力的逐层分解，形成对公司的相对估值判断。最后，由研究员通过财务、财务分析及成长性等方法，筛选出质地优良、盈利持续增长、估值具备吸引力和市场预期持续改善的公司构建股票投资组合。
（2）港股通股票投资策略
本基金将关注在港股市场上市、具有行业代表性和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。
本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。
（3）存托凭证的投资策略
本基金将根据投资目标和股票投资策略，通过定性分析和定量分析相结合的方式，对存托凭证的发行企业和所属行业进行深入研究判断，在综合考虑股票期权盘、风险、流动性等因素的基础上，精选出具备投资价值的存托凭证进行投资。
（3）债券投资策略
1）一级市场申购策略
管理人将深入地把握上市公司基本面，结合市场整体估值水平和投资环境，以及一、二级市场投资者投资理念和定价差异，有效识别并防范风险，积极参与询价与申购，为集合计划持有人获得稳健收益。
（2）二级市场股票投资策略
本集合计划首先通过行业发展前景及竞争格局考察、公司竞争力分析、公司可持续成长潜力评估及投资吸引力评估等四个层面的综合比较初步筛选出投资备选股票。然后，以全球市场为参照，通过对经济发展阶段、行业发展阶段和前景、公司综合竞争能力的逐层分解，形成对公司的相对估值判断。最后，由研究员通过调研、财务分析及量化估值等方法，筛选出质地优良、盈利持续增长、估值具备吸引力和市场预期持续改善的公司构建股票投资组合。
（4）资产支持证券投资策略
资产支持证券的投资决策以宏观经济运行状况、利率水平、证券市场资金供求状况、证券发行人的资产质量、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。
（5）股指期货投资策略
基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。
2、国债期货的交易策略
本基金参与国债期货交易以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。
四、投资限制
1、组合限制
基金投资组合应遵循以下限制：
（4）基金管理人代表基金行使相关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相关权利，保护基金份额持有人的利益；
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、授权代表或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。
5、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：
管理人运用集合计划财产买卖管理人、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的，应当符合集合计划的投资目标