

# 民生加银基金管理有限公司

## 关于以通讯开会方式召开民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告

### 一、召开会议基本情况

民生加银基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)依据中国证监会证监许可[2009] 76号文核准募集的民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2009年3月27日成立。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会,审议《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。会议的具体安排如下:

1、会议召开方式:通讯方式。

2、会议投票表决起止时间:自2021年2月9日起,至2021年3月12日止(以表决票收件人收到表决票时间为准)。

3、会议通讯表决票的寄达地点

本基金管理人:民生加银基金管理有限公司

办公地址:北京市海淀区中关村南大街1号友谊宾馆贵宾楼北侧

联系人:陈亭

电话:(010)68960086

邮政编码:100873

请在信封表面注明:“民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-8888-388咨询。

### 二、会议审议事项

《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》(以下简称“议案”),议案内容见附件一。

### 三、基金份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2021年2月8日,即在2021年2月8日下午交易时间结束后,在本基金登记机构——民生加银基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参加本次基金份额持有人大会并投票表决。

### 四、会议的议事程序和表决方式

1、本次会议表决票详见附件二。基金份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印、登录本基金管理人网站([www.msjyfund.com.cn](http://www.msjyfund.com.cn))下载并打印或按以上格式自制表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容,其中:

(1)个人投资者自行投票的,需在表决票上签字,并提供本人身份证件正反面复印件;

(2)机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(或基金管理人认可的其他印章,下同),并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有关部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(3)合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的有效身份证件正反面复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(4)个人投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供个人投资者身份证件正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(详见附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有关部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(5)机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有关部门的批文、开户证明或登记证书复印件等),以及填妥的授权委托书原件(详见附件三)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有关部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(6)合格境外机构投资者委托他人投票的,应由代理人在表决票上签字或盖章,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件正反面复印件;如代理人为机构,还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有关部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(7)以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书,以基金管理人的认可为准。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2021年2月9日起,至2021年3月12日17:00以前(以基金管理人收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本次持有人大会基金管理人的办公地址,并在信封表面注明:“民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-8888-388咨询。

## 五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由基金管理人授权的两名监票人在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期后第2个工作日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定规则如下：

(1) 表决票填写完整清晰，所提供文件符合本次会议通知规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。如表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的，视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(2) 表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(3) 基金份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1) 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2) 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上作出了不同表决意见，视为弃权表决票，但计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数；

3) 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人收到的时间为准。

## 六、决议生效条件

1、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面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；

2、《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》应当由提交有效表决意见的本基金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；

3、本次基金份额持有人大会的决议，本基金管理人自通过之日起5日内报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。法律法规另有规定的，从其规定。

## 七、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的本基金基金份额占权益登记日基金总份额50%以上方可举行。根据《中华人民共和国证券投资基金法》，如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的公告。

## 八、本次大会相关机构

1、召集人：民生加银基金管理有限公司

持有人大会专线 / 客服电话：400-8888-388

会务常设联系人：陈亭

联系电话：(010) 68960086

电子邮件：services@msjyfund.com.cn

网址：www.msjyfund.com.cn

2、监督人

基金托管人：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：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

联系人：田青

电话：010-67595096

3、公证机构：北京市方圆公证处

地址：北京市东城区朝阳门内大街东水井胡同5号

邮政编码：100010

联系人：崔军

联系电话：010-85197622

4、见证机构：上海市通力律师事务所

地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：021-31358666

## 九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电基金管理人客户服务电话400-8888-388咨询。

3、本通知的有关内容由民生加银基金管理有限公司负责解释。

附件一：《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》

附件二：《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案的说明》

民生加银基金管理有限公司

2021年2月3日

附件一：

**关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金  
转型有关事项的议案**

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人：

为了更好地满足投资者的理财需求,保护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人——民生加银基金管理有限公司经与基金托管人——中国建设银行股份有限公司协商一致,提议对民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金进行转型,主要内容包括调整投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法、估值程序、基金费用、收益分配原则、基金的信息披露等以及修订《基金合同》,基金名称不进行更名。

为实施民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型事项,提议基金份额持有人大会授权基金管理人根据转型方案实施具体的转型操作。具体说明见附件四。

本议案如获得基金份额持有人大会审议通过,基金管理人将根据基金份额持有人大会决议对《基金合同》进行修改。本基金的托管协议、招募说明书也将进行相应的修改或补充。

以上议案,请予审议。

基金管理人:民生加银基金管理有限公司  
2021年2月3日

附件二：

**民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金  
基金份额持有人大会表决票**

基金份额持有人姓名或名称:			
证件号码 (身份证件号/营业执照号)		民生加银基金账户号	
审议事项	同意	反对	弃权
关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案			
基金份额持有人/受托人(代理人)签字或盖章 年 月 日			
说明: 1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见,持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所填基金账户号下的全部基金份额(以权益登记日所登记的基金份额为准)的表决意见。 2、表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾的,视为弃权表决;签字/盖章部分填写不完整、不清晰的,或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达指定联系地址的,视为无效表决。 3、本表决票中“证件号码”,仅指基金份额持有人认购/申购民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。 4、本表决票中“基金账户号”,指持有民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额的民生加银基金账户号。同一基金份额持有人拥有多个此类基金账户且需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的,应当填写基金账户卡号,其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的,将被默认为代表此基金份额持有人所持有的民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金所有份额。			

(本表决票可剪报、复印或登录本基金管理人网站(www.msjfund.com.cn)下载并打印,在填写完整并签字盖章后均为有效。)

附件三：

**授权委托书**

兹全权委托【                      】先生/女士/公司单位代表本人或本机构参加投票截止日为2021年3月12日17:00止以通讯方式召开的民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并代为全权行使所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

若在法定时间内就同一议案重新召开民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会,除本人(或本机构)重新作出授权外,本授权继续有效。

委托人姓名或名称:

委托人证件号码(身份证件/营业执照):

委托人基金账户号:

受托人姓名或名称:

受托人证件号码(身份证件/营业执照):

委托人签字/盖章:  
签署日期: 年 月 日

说明:

- 1、页末签字栏中委托人为机构的应当于名称后加盖公章,个人则为本人签字。
- 2、以上授权是持有人就其持有的本基金全部份额向受托人所做授权。
- 3、其他签字栏请视情形选择填写,凡适合的栏目均请准确完整填写。
- 4、持有人多次授权,且能够区分先后次序的,以最后一次授权为准;持有人多次授权,无法区分授权次序的,视为同意其授权的机构之一为受托人。
- 5、授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制,在填写完整并签字盖章后均为有效。



附件四：

## 关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 转型有关事项的议案的说明

### 一、声明

1、为更好地满足投资者的理财需求,保护基金份额持有人利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)和《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人民生加银基金管理有限公司经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致,决定召开基金份额持有人大会,讨论并审议《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。

2、本次民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型事宜属于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金原注册事项的实质性调整,经基金管理人向中国证监会申请,已经中国证监会准予变更注册。

3、本次基金份额持有人大会需由持有有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的50%的持有人出席方可召开,且《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》需经参加本次持有人大会表决的基金份额持有人(或代理人)所持表决权的50%以上通过,存在未能达到开会条件或无法获得相关持有人大会表决通过的可能。

4、基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见,均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

### 二、调整方案要点

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型方案的主要内容如下:

#### (一)变更后的投资范围及投资组合比例

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(包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、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、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转换债券等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。

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,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例为0%-95%,投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券不低于非现金基金资产的80%,本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的20%;每个交易日日终,扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及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。

如法律法规或中国证监会允许,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。

#### (二)变更后的投资策略

##### 1、大类资产配置策略

本基金主要对国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势等进行综合分析,采用定量和定性相结合的研究方法,确定本基金在股票、债券等各类资产的投资比例。

本基金将基于宏观环境等因素,重点考虑以沪深300成份指数为样本的权益市场平均估值水平(PE)等因素,在不同阶段对基金产品的股票仓位进行分段控制,并在此基础上进行权益资产的投资操作。

具体仓位控制如下:

当沪深300成份指数的市盈率(PE)处于历史后20%分位,本基金的股票资产占基金资产的比例为60-95%;

当沪深300成份指数的市盈率(PE)处于历史前20%分位,本基金的股票资产占基金资产的比例为0-50%;

除上述两种情况外,本基金的股票资产占基金资产的比例为50-90%。

本基金将积极关注、深入分析并论证蓝筹股企业的投资机会,通过综合分析行业空间、行业地位、竞争格局、产品竞争力、盈利能力多方面因素,去选择细分领域的龙头公司或具备成长为优质公司潜力的企业进行投资,分享企业长期增长带来的收益率。

##### 2、股票投资策略

本基金股票投资采取“核心—卫星策略”,即本基金投资于具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券不低于非现金基金资产的80%;卫星股票资产部分投资于具有品牌优势蓝筹企业之外的优质公司。

#### (1)核心股票资产投资策略

本基金核心股票资产部分采用买入并持有策略投资于具有品牌优势的蓝筹企业。

##### 1)蓝筹股企业的选择标准

蓝筹股是指具有稳定的盈余记录、能定期分派较丰厚的股息、业绩优良的企业的股票,又称为“绩优股”。本基金将选择具有以下特征的企业作为蓝筹股企业:

① 地位突出:在证券市场、行业中占有突出地位,企业的股本规模较大,总市值及权重较大,公司的总市值排名居于整个证券市场三分之一,或者总市值排名居于所在行业的前三分之一;企业在技术资源、客户资源、销售渠道、产品创新等方面处于行业领先地位。

② 业绩优良:主营业务突出,盈利能力强,投资回报稳定。

③ 分红优厚:分红稳定,具有较高的现金股息率。

④ 流动性较好:流动性较好一方面因为企业股本规模较大,另一方面因为成交活跃。

⑤ 成长性较好:企业发展前景良好,主营业务收入、净利润不断增长。

## 2) 品牌优势企业的选择标准

品牌优势企业是指具有品牌竞争优势的企业,其拥有具有竞争对手难以模仿甚至无法超越的品牌竞争差异化能力。品牌优势能够使企业具有较高的知名度、美誉度、忠诚度,容易吸引、培养和留住对企业有较高的认知度、较强的信任感和好感、较为稳定的长期客户,从而产生超额利润,实现优秀品牌的溢价能力。

本基金在定性分析上,将选择具有以下特征的企业作为品牌企业:

① 过硬的质量、完善的服务。质量是品牌的生命,也是企业的生命;服务是产品的衍生,是品牌的重要支撑,是现代市场竞争的焦点之一。

② 良好的形象、较高的文化价值。形象是品牌在市场上、客户心中所表现出的个性特征,体现客户对品牌的评价与认知。文化价值是品牌的精神内涵,是现代社会的消费心理和文化价值取向的结合,是企业形象的外在展现和传播。

③ 规范合理的公司治理、优秀的企业管理。规范合理的公司治理、优秀的企业管理是企业产生和长期拥有优秀品牌的保障,使得优秀品牌在各种情形下得以健康成长、顺利发展。长期良好的品牌的打造和维护,无一不是在规范合理的公司治理的基础上,依靠科学有效的优秀管理去创立、维护和创新的。

④ 较强的品牌长久发展能力。本基金通过研究品牌产品市场特性、品牌产品是否符合客户和市场的发展趋势、企业对于品牌维护的投入、品牌市场的细分与推广等因素,分析品牌的长久发展能力。

品牌优势最终将使得企业具有较强的议价和定价能力、较高的市场占有率以及超过行业平均水平的盈利能力,因此,本基金在财务分析上,将通过企业的毛利率、营业收入、净资产收益率等指标与行业进行对比分析,寻找出具有品牌优势的企业。

## (2) 卫星股票资产投资策略

本基金卫星股票资产部分是通过投资于具有品牌优势的蓝筹企业之外的优质公司来达到增加组合超额收益、分散组合风险的目的,因此,本基金将采取积极投资策略投资于企业总市值较小、成长性较好、核心团队稳定、经营管理优秀、估值合理的优质公司;此外,在符合法律法规、控制风险、深入研究的前提下,实现基金资产稳健增值。

## 3、普通债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

### (1) 债券投资组合策略

本基金的投资组合策略采用自上而下进行分析,从宏观经济和货币政策等方面,判断未来的利率走势,从而确定债券资产的配置策略;同时,在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合管理手段进行债券日常管理。

#### 1) 久期管理

本基金通过宏观经济及政策形势分析,对未来利率走势进行判断,在充分保证流动性的前提下,确定债券组合久期以及可以调整的范围。

#### 2) 收益率曲线形变预测

收益率曲线形状的变化将直接影响本基金债券组合的收益情况。本基金将根据宏观面、货币政策面等综合因素,对收益率曲线变化进行预测,在保证债券流动性的前提下,适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合。

### (2) 个券选择策略

在个券选择上,本基金重点考虑个券的流动性,包括是否可以进行质押融资回购等要素,还将根据对未来利率走势的判断,综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外,对于可转换债券等内嵌期权的债券,还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断,最终确定其投资策略。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券:

1) 信用等级高、流动性好;

2) 资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券;

3) 在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下,运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后,市场交易价格被低估的债券;

4) 公司基本面良好,具备良好的成长空间与潜力,转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。

## 4、可转换债券与可交换债券投资策略

本基金可投资于可转债债券、可交换债券,该类债券赋予债券投资者某种期权,比普通债券投资更加灵活。本基金将综合研究此类含权债券的债券价值和权益价值,债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素;权益价值方面仔细开展对含权债券所对应个股的价值分析,包括估值水平、盈利能力及未来盈利预期等。

### (1) 可转换债券投资策略

本基金将利用可转换债券定价模型进行估值分析,重点结合公司投资价值、可转换债券条款、可转债的转换价值溢价水平、债券价值溢价水平选择债性股性相对均衡的转债品种,获得一定超额回报。

### (2) 可交换债券投资策略

可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票,而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

## 5、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

## 6、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 7、股票期权投资策略

本基金按照风险管理的原则,在严格控制风险的前提下,以套期保值为主要目的,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断,结合期权定价模型,选择估值合理的期权合约。

## 8、资产支持证券投资策略

在有效控制风险的前提下,本基金对资产支持证券从以下方面综合定价,选择低估的品种进行投资。主要包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

### (三)调整基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×70%+ 上证国债指数收益率×30%

### (四)调整基金的费用支付方式和赎回费率

#### (1)调整基金的管理费和托管费的支付方式

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

#### (2)调整基金的赎回费率

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金赎回费率随赎回基金份额持有时间的增加而递减,具体如下表:

本基金的赎回费率如下:

持有期限	赎回费率	赎回费归入基金财产的比例
1天≤T<7天	1.50%	100%
7天≤T<30天	0.75%	100%
30天≤T<90天	0.50%	75%
90天≤T<180天	0.50%	50%
T≥180天	0.00%	-

### (五)调整基金的投资限制

#### 1.组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金股票资产占基金资产的 0%–95%,投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的 80%,投资于同业存单的比例不高于基金资产的 20%;

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约所需缴纳的交易保证金后,持有的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%,前述现金资产不包括结算备付金、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%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;

(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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 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%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

(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,不得超过基金资产净值的 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规模的 10%;

(9)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%;

(10)本基金应投资于信用评级评级为 BBB 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;

(11)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拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(13) 本基金的资产总值不得超过基金资产净值的140%；

(14) 本基金主动投资于流动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本基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 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%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

3) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

4) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约和股指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95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

5) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

(16) 本基金参与国债期货交易的，应当遵守下列要求：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值不得超过基金资产净值的15%；

2) 在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

3) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

4) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

(17) 本基金参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%；

2) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(18) 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；

(19) 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。

除第(2)、(10)、(14)、(18)项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，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之日起6个月内使基金的投资组合比例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本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制、投资禁止性规定，且该等调整或修改属于非强制性的，基金管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并向投资者履行信息披露义务。

(六) 调整基金的估值方法

1、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，确定公允价值；

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日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进行估值；

(4) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；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，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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，确定公允价值；

(5) 交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值；

(6) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，如基金管理人认为成本能够近似体现公允价值，基金管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

- 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：
  - (1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；
  - (2) 首次公开发行未上市的股票、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) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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；
  - (4) 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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。
- 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，回售登记期截止日（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、本基金投资的期货合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，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。
- 5、本基金投资的期权合约，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。
- 6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。
- 7、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。
- 8、如有充足理由认为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。
- 9、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。
- 10、存在相关法律法规以及监管部门有相关规范且适用于本基金的，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定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，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，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，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。

#### (七) 调整基金的估值程序

1、基金份额净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0.0001元，小数点后第五位四舍五入。基金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。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值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，由基金管理人按规定对外公布。

#### (八) 调整基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3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，本基金默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日的基金份额净值减去每单位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另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致后，可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

#### (九) 调整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定金额，不足以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，依照《民生加银基金管理有限公司开放式基金业务规则》执行。

#### (十) 其他对基金合同的必要调整

除上述内容的调整需要修改《基金合同》以外，基金管理人需要根据法律法规及转型后的民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的产品特征修订《基金合同》的相关内容。修改后的基金合同（即《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》）、托管协议（即《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金托管协议》）已经中国证监会变更注册。

#### (十一) 基金合同修订前后对照表



基金合同具体修订内容,详见本公告“附:基金合同修订前后对照表”。

### 三、基金管理人就方案相关事项的说明

#### (一)基金的历史沿革

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]76号文)准予募集。基金管理人为民生加银基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金于2009年2月25日至2009年3月25日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,原《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2009年3月27日生效。

#### (二)基金转型的可行性

##### 1、本基金转型不存在法律障碍

《基金法》第四十七条规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:(二)决定修改基金合同的重要内容……”。

《基金法》第八十六条规定,“……基金份额持有人大会就审议事项作出决定,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上通过;但是,转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并,应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构备案,并予以公告。”

依据民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的基金合同规定,基金转型需召开基金份额持有人大会,且本次基金份额持有人大会决议属于一般决议,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%以上通过为有效,基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

因此,民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型不存在法律方面的障碍。

##### 2、基金转型不存在技术障碍

民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型后,基金份额不变,民生加银基金管理有限公司已就变更登记有关事项进行了充分准备,技术可行。基金转型不存在技术障碍。

#### 四、基金转型的主要风险及预备措施

本基金基金转型调整方案存在被基金份额持有人大会否决的风险。

基金管理人已对主要持有人进行了走访,认真听取了持有人意见,拟定议案综合考虑了持有人的要求。议案公告后,我们还将再次征询意见。如有必要,基金管理人将根据持有人意见,对修改方案进行适当的修订并重新公告。基金管理人可在必要情况下,预留出足够的时间,以做二次召开或推迟基金份额持有人大会的召开的充分准备。

如果本方案未获得持有人大会批准,基金管理人计划按照有关规定重新向持有人大会提交议案。

基金管理人:民生加银基金管理有限公司

2021年2月3日

附:

基金合同修订前后对照表

《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)修改前后对照表

Table with 3 columns: 章节 (Section), 变更注册前的《基金合同》条款 (Original Clause), 变更注册后的《基金合同》条款 (Revised Clause). The table details amendments to the fund contract, covering sections like '第一部分 前言' and '第二部分 释义'.

<p>第三部分 基金的基本情况(原“三、基金的基本情况”)</p>	<p>(一)基金的名称 民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金</p> <p>(二)基金的类别 混合型</p> <p>(五)基金的最低募集份额总额和金额 基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元。</p> <p>(六)基金份额初始价值和认购费用 基金份额的初始面值为人民币1.00元。 本基金的认购费率最高不超过5%,具体费率情况由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。</p>	<p>一、基金名称 民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金</p> <p>二、基金的类别 混合型证券投资基金</p> <p>五、基金的最低募集份额总额 本基金的最低募集份额总额为2亿份。</p> <p>六、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金的认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。</p>
<p>第四部分 基金的历史沿革(原“四、基金份额的发售”)</p>	<p>(一)基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1.发售时间 自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2.发售方式 通过基金销售网点(包括基金管理人的直销网点及代销机构的代销网点,具体名单见基金份额发售公告等相关公告)公开发售。</p> <p>3.发售对象 个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p>(二)基金份额的认购</p> <p>1.认购费用 本基金的认购费率不得超过认购金额的5%,本基金的认购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。</p> <p>2.募集期利息的处理方式 认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息的具体金额及利息结转的基金份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。</p> <p>3.基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p>4.认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>5.认购的受理 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,认购申请成功受理的确认以基金合同生效后注册登记机构的确认结果为准。</p> <p>(三)基金份额认购金额的限制</p> <p>1.投资人认购前,需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2.投资人在募集期内可以多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。</p> <p>3.基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制,具体限制请参看招募说明书等相关公告。</p> <p>4.基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制,具体限制和处理方法请参看招募说明书等相关公告。</p>	<p>民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(股票资产占基金资产的比例为0%—95%)由民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金(股票资产占基金资产的比例为30%—80%)转型而来,民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]76号文)准予募集。基金管理人由民生加银基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。</p> <p>原民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金于2009年2月25日至2009年3月25日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,原《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2009年3月27日生效。</p> <p>经中国证监会X年X月X日《关于核准民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》,民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金就基金变更事宜进行变更注册,并自X年X月X日至X年X月X日民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,内容包括民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金调整基金的投资、基金资产估值、基金收益分配以及修订基金合同。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。自X年X月X日起,由原《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。</p>
<p>第五部分 基金的存续(原“五、基金备案”)</p>	<p>(一)基金备案的条件</p> <p>1.本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元,并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售,且基金募集达到基金备案条件,基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资,自收到验资报告之日起10日内,向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续,自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。</p> <p>2.基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。</p> <p>3.本基金合同生效前,投资人的认购款项只能存入专用账户,任何人不得动用。认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息的具体金额及利息结转的基金份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。</p> <p>(二)基金募集失败</p> <p>1.基金募集期届满,未达到基金备案条件,则基金募集失败。</p> <p>2.如基金募集失败,基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,在基金募集期届满后30日内退还投资人已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。</p> <p>3.如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。</p> <p>(三)基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额</p> <p>基金合同生效后的存续期内,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,基金管理人应当及时报告中国证监会;基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人,或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元,基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。</p>	<p>《基金合同》生效后,连续20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5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召开基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。</p>



#### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供其他方式办理基金份额的申购与赎回。

#### 二、申购和赎回的开放日及时间

##### 1. 开放日及开放时间

投资人可在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体以届时公告为准,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定可暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

#### 三、申购与赎回的原则

3. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

5. 基金管理人有权决定本基金的总规模限额,但应遵守基金合同的限制,并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

6. 办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

##### 2. 申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时,必须在规定的时间内全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立,登记机构确认基金份额时,申购生效。基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立,登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者赎回申请生效后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他不可抗力因素,基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程,赎回款项划付时间相应顺延。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整,基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### 3. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请当日为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。因投资者急于进行款项查询等义务,使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

#### 五、申购和赎回的数量限制

5. 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2. 基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

5. 基金管理人可以根据市场环境,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制,基金管理人必须调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并提前中国证监会备案。

#### (六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告,遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

2. 申购份额的计算及余额的处理方式,本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3. 赎回金额的计算及处理方式,本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4. 申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

5. 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于7日的投资者,收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产;对持续持有期不少于7日的投资者,不低于赎回费总额的25%应归入基金财产,未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。其中,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,并将全额计入基金财产。

6. 本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7. 当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可按照法律法规规定,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定。

8. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下,根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。

2. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,

#### (一) 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构,并在基金管理人网站公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。

#### (二) 申购和赎回的开放日及时间

##### 1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定可暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书中载明。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

##### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的,其基金份额申购、赎回或转换的价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。

#### (三) 申购与赎回的原则

4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

5. 基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (四) 申购与赎回的程序

##### 1. 申购和赎回的申请方式

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功,若申购不成功或无效,基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

##### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请当日作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。因投资者急于进行款项查询等义务,使其相关权益受损的,基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

#### (五) 申购和赎回的金额

1. 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2. 基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

4. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制,具体规定请参见招募说明书或相关公告。

5. 基金管理人可以根据市场环境,在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制,基金管理人必须调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并提前中国证监会备案。

#### (六) 申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告,遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

2. 申购份额的计算及余额的处理方式,本基金申购份额的计算详见招募说明书。本基金的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3. 赎回金额的计算及处理方式,本基金赎回金额的计算详见招募说明书。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4. 申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

5. 赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金对持续持有期少于7日的投资者,收取不少于1.5%的赎回费并全额计入基金财产;对持续持有期不少于7日的投资者,不低于赎回费总额的25%应归入基金财产,未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。其中,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,并将全额计入基金财产。

6. 本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7. 当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可按照法律法规规定,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的处理原则与操作规范参见法律法规和自律组织的规定。

8. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下,根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### 第六部分 基金份额的申购与赎回

##### (原“六、基金份额的申购与赎回”)

#### (七) 拒绝或暂停申购的情形

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法接受投资者的申购申请
2. 证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况
4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的
5. 基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形

发生上述 1-3、5、8、9 项规定的暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理

#### (八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法支付赎回款项
2. 证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值
3. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况

发生上述情形时,基金管理人应当在当日报中国证监会备案并按照规定公告,已接受的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,延期支付最长不得超过 20 个工作日,并在指定媒介上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### (九) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的处理方式

(1) 部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下,可对其余赎回申请延期办理,对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回,选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理

(2) 部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下,可对其余赎回申请延期办理,对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回,选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理

(3) 如本基金发生巨额赎回,在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 30% 以上的赎回申请等情形下,基金管理人可以采取以下措施对其进行延期办理赎回:即,若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额的 30%,基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 30% 的赎回申请实施延期办理,而对该单个基金份额持有人 30% 以内(含 30%) 的赎回申请与其他投资者的赎回申请按前述条款处理,具体见招募说明书或相关公告。

(4) 暂停赎回:连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

##### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

(十) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人应在规定期限内通过指定媒介上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周,暂停期间,基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次;暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

##### (十一) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

##### (十二) 基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可,符合法律法规的其它非交易过户。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人。

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将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关依据生效司法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。办理非交易过户必须提供基金注册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注册登记机构的规定办理,并按基金注册登记机构规定的标准收费。

##### (十四) 定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期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申购金额。

##### (十五) 基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻,以及注册登记机构认可,符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。

3. 证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值
4. 接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时

5. 基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或出现其他可能对基金业绩产生负面影响,或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形

6. 基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金登记系统或基金会计系统无法正常运作。

发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的,被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理

#### (八) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

1. 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项
2. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项

3. 证券、期货交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值

5. 发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时,基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,若出现上述第 4 项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人可在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 九、巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的处理方式

(1) 部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10% 的前提下,可对其余赎回申请延期办理,对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回,选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理

若基金发生巨额赎回,对该单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 以上的部分,基金管理人可以先行对该单个基金份额持有人超出 10% 的赎回申请实施延期办理,具体措施如下:延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于单个基金份额持有人当日赎回申请未超过上一开放日基金总份额 10% (含 10%) 的赎回申请与其他投资者的赎回申请应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额。对于上述延期办理而未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回,选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(3) 暂停赎回:连续 2 个交易日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

##### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在两日内在指定媒介上刊登公告。

十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人应在规定期限内通过指定媒介上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 若暂停时间超过 1 日,基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定公告的增加次数,但基金管理人须依照《信息披露办法》,最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告,或根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时可不再另行发布重新开放的公告。

##### 十一、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

##### 十二、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易场所或者交易方式进行份额转让的申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金份额转让业务的,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业务。

##### 十三、基金的非交易过户

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。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人。

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将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关依据生效司法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。办理非交易过户必须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理,并按基金登记机构规定的标准收费。

##### 十五、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期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申购金额。

##### 十六、基金份额的冻结和解冻

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,符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回  
本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

一、基金管理人  
(一)基金管理人概况  
名称:民生加银基金管理有限公司  
住所:深圳市福田区莲花街道福中三路 2005 号民生金融大厦 13 楼 13A  
法定代表人:张焕南  
设立日期:2008 年 11 月 3 日  
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会监督管理委员会证监许可[2008]1187 号  
组织形式:有限责任公司(中外合资)  
注册资本:叁亿元  
存续期限:永续经营  
联系电话:010-68960030

(二)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批准的其他费用;  
(4)销售基金份额;  
(5)按照规定召集基金份额持有人大会;  
(6)依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律法规规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;  
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;  
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的有关行为进行监督和处置;  
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;  
(10)依照《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案;  
(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请;  
(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;  
(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;  
(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;  
(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金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认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则;  
(17)法律法规及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,基金管理人的义务包括但不限于:  
(1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;  
(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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;  
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;  
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;  
(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;  
(7)依法接受基金托管人的监督;  
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;  
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;  
(10)编制季度报告、中期报告和年度报告;  
(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;  
(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;  
(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;  
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;  
(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;  
(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 15 年以上;  
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;  
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;  
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;  
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;  
(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;  
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;  
(23)以基金管理人名义,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;  
(24)基金管理人募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;  
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;  
(26)建立并保存基金份额持有人名册;  
(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人  
(一)基金托管人概况  
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:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  
法定代表人:田国立  
成立时间:2004 年 9 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

第七部分 基金合同当事人及权利义务

一、基金份额持有人  
(一)基金份额持有人的权利  
(二)基金份额持有人的义务

二、基金管理人  
(一)基金管理人概况  
(二)基金管理人权利与义务

三、基金托管人  
(一)基金托管人概况  
(二)基金托管人权利与义务



21. 基金托管人违反基金合同约定造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;  
22. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;  
23. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;  
24. 执行生效的基金份额持有人大会决议;  
25. 不得从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;  
26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利, 不谋求对上市公司的控股和直接管理;  
27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(六) 基金托管人的权利  
根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的权利为:  
1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;  
2. 监督基金管理人对本基金的投资运作;  
3. 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;  
4. 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;  
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时报告中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;  
6. 依法召集基金份额持有人大会;  
7. 按规定取得基金份额持有人名册资料;  
8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(七) 基金托管人的义务  
根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的义务为:  
1. 安全保管基金财产;  
2. 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;  
3. 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立;  
4. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;

5. 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;  
6. 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;  
7. 保守基金商业秘密, 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, 不得向他人泄露;  
8. 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行; 如果基金管理人未执行基金合同规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;  
9. 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;  
10. 复核基金合同的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;

11. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;  
12. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格;  
13. 按照规定监督基金管理人的投资运作;  
14. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;  
15. 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;  
16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;  
17. 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因过错而免除;  
18. 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;  
19. 参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;  
20. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会和银行业监督管理机构, 并通知基金管理人;  
21. 执行生效的基金份额持有人大会决议;  
22. 不得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、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(八) 基金份额持有人的权利  
根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金份额持有人的权利为:

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. 依法申请赎回其持有的基金份额;  
4. 按照规定要求召开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. 监督基金管理人的投资运作;  
8. 对基金管理人、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;

9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。  
每份基金份额具有同等的合法权益。  
(九) 基金份额持有人的义务  
根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金份额持有人的义务为:  
1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;  
2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;  
3. 在持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;  
4. 不得从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;  
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议;  
6. 返还其在基金交易过程中因任何原因, 自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的非正当利益;  
7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。  
(十) 本基金合同当事人各方的权利义务义务以本基金合同为依据, 不因基金财产账户名称有所改变。

组织形式; 股份有限公司  
存续期间: 持续经营  
(二) 基金托管人的权利与义务  
1. 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的权利包括但不限于:  
(1) 自《基金合同》生效之日起, 依法法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;  
(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;  
(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时报告中国证监会, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;  
(4) 根据相关市场规则, 为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户, 为基金办理证券、期货交易资金清算;

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;  
(6) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;  
(7) 法律法规及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, 基金托管人的义务包括但不限于:  
(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;  
(2) 设立专门的基金托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;  
(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立; 对所托管的不同的基金分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;  
(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;  
(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户, 按照《基金合同》的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;  
(7) 保守基金商业秘密, 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予以保密, 不得向他人泄露;  
(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格;  
(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;  
(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行; 如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

(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不于法律法规规定的最低期限;  
(12) 建立并保存基金份额持有人名册;  
(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;  
(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;  
(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定, 召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;  
(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人投资运作;  
(17) 参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;  
(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会和银行业监督管理机构, 并通知基金管理人;  
(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因过错而免除;  
(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务, 基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;  
(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;  
(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人  
基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受, 基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额, 即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人, 直至其不再持有本基金的基金份额, 基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。  
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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;  
(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;  
(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) 监督基金管理人的投资运作;  
(8) 对基金管理人、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或仲裁;

(9) 法律法规及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》、招募说明书等信息披露文件;  
(2) 了解所投资基金产品, 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;  
(3) 关注基金信息披露, 及时行使权利和履行义务;  
(4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;  
(5) 在其持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;  
(6) 不得从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;  
(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;  
(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;  
(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。



## (六)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、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前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决定的提案。

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

关联性。大会召集人对于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大会职权范围的,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。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在本次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可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定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议决定的提案,基金管理人、基金托管人提交基金份额持有人大会审议决定的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于6个月,法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的议事程序如下:**(1)会议的召开**。如果需要将原有提案进行修改,应当在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

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照规定程序和议事程序及议事事项,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,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的,其授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人授权代表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代理人所持表决权的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主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

#### (2)通讯方式开会

在通讯开会的方式下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关或监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议,如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

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。

(七)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享有平等的表决权。

#### (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(含50%)通过。但下列2项所规定的须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;

#### (2)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;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准或备案,并予以公告。

4. 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书面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,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

### 5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

## (八)议事程序

### 1.现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的召集人应当在会议召开前至少30日书面通知基金份额持有人和代理人,并推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名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召集人应当在会议召开前至少30日书面通知基金份额持有人和代理人,并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名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人或基金托管人授权代表未能出席,则大会召集人可自行选举3名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有疑义,可以对所投票数进行重新清点;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疑义,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即组织监票人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督员在基金托管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,如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权3名监票人进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或备案。基金份额持有人大会决议的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本基金第(二)条所规定的第(1)-(8)项召开事由的基金份额持有人大会决议须经中国证监会核准生效后方可执行,关于本基金第(二)条所规定的第(9)、(10)项召开事由的基金份额持有人大会决议须经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

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严格执行基金份额持有人大会决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2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,必须将公证文书、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

(4)上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表人出具书面意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证,受托出具书面意见的代理人出具的委托人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法规、基金合同和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符的,基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式进行表决,基金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,具体方式由召集人确定并在会议通知中列明。

4. 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,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。

### 五、议事内容与程序

#### 1. 议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如(基金合同)的重大修改、决定终止(基金合同)、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的任何其他应由基金份额持有人大会审议的事项,基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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。

#### 2. 议事程序

##### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表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代理人所持表决权三分之二以上(含三分之二)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒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作出决议的效力。

出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

##### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

### 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

1. 一般决议。一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第2项所规定的须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。

2. 特别决议。特别决议应当经参加大会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。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、本基金与其他基金合并、终止(基金合同)以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。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书面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,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

### 七、计票

#### 1. 现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的召集人应当在会议召开后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名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或基金管理人或基金托管人召集,但基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的召集人应当在会议召开后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如会议主持人怀疑计票结果或者对计票过程有异议,可在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

#### 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基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人授权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

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。基金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,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证文书、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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的决议。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。

### 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制,则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会决议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例。

1. 基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额10%以上(含10%);

2. 现场开会到会者在权益登记日代表的基金份额不少于一半;本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

3. 通讯开会直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不少于一半;本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

4. 在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一,召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间后的3个月内就原定审议事项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)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;

5. 现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人;

6. 一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过;

7. 特别决议应当经参加大会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。同一侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

十. 本部分关于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,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。



<p>(一)基金管理人更换</p> <p>1.基金管理人更换条件</p> <p>有下列情形之一,基金管理人职责终止:</p> <p>(1)基金管理人被依法取消基金管理资格;</p> <p>(2)基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产;</p> <p>(3)基金管理人被基金份额持有人大会解任;</p> <p>(4)法律法规及基金合同规定的其他情形。</p> <p>2.基金管理人更换程序</p> <p>更换基金管理人必须依照如下程序进行:</p> <p>(1)提名:新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有基金份额<b>10%</b>以上(包括<b>10%</b>)的基金份额持有人提名;</p> <p>(2)决议:基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后<b>6</b>个月内对被提名的新任基金管理人形成决议,新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件;</p> <p>(3)核准:新任基金管理人产生之前,由中国证监会指定临时基金管理人;更换基金管理人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准后方可执行;</p> <p>(4)交接:原基金管理人职责终止的,应当妥善保存基金管理人业务资料,及时办理基金管理人移交手续,新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收,并与基金托管人核对基金资产总值;</p> <p>(5)审计:原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;</p> <p>(6)公告:基金管理人更换后,由基金托管人在新任基金管理人获得中国证监会核准后<b>2</b>日内公告;</p> <p>(7)基金名称变更:基金管理人更换后,如果原任或新任基金管理人要求,应按其要求替换或删除基金名称中与原任基金管理人有关名称字样。</p>	<p>一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形</p> <p>(一)基金管理人职责终止的情形</p> <p>有下列情形之一,基金管理人职责终止:</p> <p>1.被依法取消基金管理资格;</p> <p>2.被基金份额持有人大会解任;</p> <p>3.依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产;</p> <p>4.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p> <p>(二)基金托管人职责终止的情形</p> <p>有下列情形之一,基金托管人职责终止:</p> <p>1.被依法取消基金托管资格;</p> <p>2.被基金份额持有人大会解任;</p> <p>3.依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产;</p> <p>4.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。</p> <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>(一)基金管理人的更换程序</p> <p>1.提名:新任基金管理人由基金托管人或者单独或合计持有<b>10%</b>以上(含<b>10%</b>)基金份额的基金份额持有人提名;</p> <p>2.决议:基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后<b>6</b>个月内对被提名的基金管理人形成决议,该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)表决通过,决议自表决通过之日起生效;</p> <p>3.临时基金管理人:新任基金管理人产生之前,由中国证监会指定临时基金管理人;</p> <p>4.备案:基金份额持有人大会更换基金管理人的决议须经中国证监会备案;</p> <p>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<b>2</b>日内在规定媒介公告;</p> <p>6.交接:基金管理人职责终止的,基金管理人应妥善保存基金管理人业务资料,及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理人业务移交手续,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;</p> <p>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;</p> <p>8.基金名称变更:基金管理人更换后,如果原任或新任基金管理人要求,应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关名称字样。</p>
<p>第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序(原“九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序”)</p> <p>1.基金托管人的更换条件</p> <p>有下列情形之一,基金托管人职责终止:</p> <p>(1)基金托管人被依法取消基金托管资格;</p> <p>(2)基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产;</p> <p>(3)基金托管人被基金份额持有人大会解任;</p> <p>(4)法律法规及基金合同规定的其他情形。</p> <p>2.基金托管人的更换程序</p> <p>(1)提名:新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有基金份额<b>10%</b>以上(包括<b>10%</b>)的基金份额持有人提名;</p> <p>(2)决议:基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后<b>6</b>个月内对被提名的新任基金托管人形成决议,新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件;</p> <p>(3)核准:新任基金托管人产生之前,由中国证监会指定临时基金托管人;更换基金托管人的基金份额持有人大会决议应经中国证监会核准后方可执行;</p> <p>(4)交接:原基金托管人职责终止的,应当妥善保存基金财产和基金托管业务资料,及时办理基金财产和托管业务移交手续,新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收,并与基金管理人核对基金资产总值;</p> <p>(5)审计:原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,审计费用从基金财产中列支;</p> <p>(6)公告:基金托管人更换后,由基金管理人在新任基金托管人获得中国证监会核准后<b>2</b>日内公告。</p> <p>(二)基金管理人及基金托管人同时更换</p> <p>1.提名:如果基金管理人及基金托管人同时更换,由单独或合计持有基金份额<b>10%</b>以上(包括<b>10%</b>)的基金份额持有人提名新任基金管理人及基金托管人;</p> <p>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获得中国证监会核准后<b>2</b>日内在指定媒介上联合公告。</p> <p>(四)新任基金管理人接收基金管理人业务或新任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。</p>	<p>(二)基金托管人的更换程序</p> <p>1.提名:新任基金托管人由基金管理人或者单独或合计持有<b>10%</b>以上(含<b>10%</b>)基金份额的基金份额持有人提名;</p> <p>2.决议:基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后<b>6</b>个月内对被提名的基金托管人形成决议,该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)表决通过,决议自表决通过之日起生效;</p> <p>3.临时基金托管人:新任基金托管人产生之前,由中国证监会指定临时基金托管人;</p> <p>4.备案:基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案;</p> <p>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<b>2</b>日内在规定媒介公告;</p> <p>6.交接:基金托管人职责终止的,应当妥善保存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与基金管理人核对基金资产总值;</p> <p>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。</p> <p>(三)基金管理人及基金托管人同时更换的条件和程序</p> <p>1.提名:如果基金管理人及基金托管人同时更换,由单独或合计持有基金份额<b>10%</b>以上(含<b>10%</b>)的基金份额持有人提名新任基金管理人和基金托管人;</p> <p>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<b>2</b>日内在指定媒介上联合公告。</p>
<p>第十部分 基金财产的保管(原“十、基金的托管”)</p> <p>基金财产由基金托管人保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、基金合同及有关规定订立《民生加银银禧蓝筹灵活配置混合型证券投资基金托管协议》,订立托管协议的目的明确基金托管人与基金管理人之间在基金财产保管方面的权利和义务,基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责,确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。</p>	<p>基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议。</p> <p>订立托管协议的目的明确基金托管人与基金管理人之间在基金财产保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责,确保基金财产的安全,保护基金份额持有人的合法权益。</p>
<p>第十一部分 基金份额的登记(原“十一、基金份额的登记”)</p> <p>(一)本基金的注册登记业务指基金登记、存管、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。</p> <p>(二)本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构负责办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的,应与代理人签订委托代理协议,以明确基金管理人和代理机构在注册登记业务中的权利和义务,保护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>(三)注册登记机构享有如下权利:</p> <p>1.建立和管理投资人基金账户;</p> <p>2.取得注册登记费;</p> <p>4.在法律法规允许的范围内,制定和调整注册登记业务的相关规则;</p> <p>5.法律法规规定的其他权利。</p> <p>(四)注册登记机构承担如下义务:</p> <p>1.配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务;</p> <p>2.严格按照法律法规及基金合同规定的条件办理基金份额的注册登记业务;</p> <p>3.保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录<b>15</b>年以上;</p> <p>4.对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失,须承担相应的赔偿责任,但司法强制检查情形除外;</p> <p>5.按基金合同、招募说明书和有关公告的规定为投资人办理非交易过户等业务,并提供其他必要服务;</p> <p>7.法律法规规定的其他义务。</p>	<p>一、基金份额的登记业务</p> <p>本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。</p> <p>二、基金登记业务办理机构</p> <p>本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理,基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的,应与代理人签订委托代理协议,以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务,保护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>三、基金登记机构的权利</p> <p>基金登记机构享有以下权利:</p> <p>1.取得登记费;</p> <p>2.建立和管理投资者基金账户;</p> <p>4.在法律法规允许的范围内,对登记业务的办理时间和相关业务规则进行调整,并依照有关规定开始实施前在指定媒介上公告;</p> <p>5.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。</p> <p>四、基金登记机构的义务</p> <p>基金登记机构承担以下义务:</p> <p>1.配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务;</p> <p>2.严格按照法律法规及《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务;</p> <p>3.妥善保存登记数据,并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于<b>20</b>年;</p> <p>4.对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失,须承担相应的赔偿责任,但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外;</p> <p>5.按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务,提供其他必要的服务;</p> <p>7.法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。</p>

二、投资范围  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、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、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债债券等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为**0%-95%**，投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券不低于非现金基金资产的**80%**。本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的**20%**；每个交易日终，扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的**5%**，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及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。

如法律法规或中国证监会允许，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。

三、投资策略  
1、大类资产配置策略  
本基金主要对国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势等进行综合分析，采用定量和定性相结合的研究方法，确定本基金在股票、债券等各类资产的投资比例。

本基金将基于宏观环境等因素，重点考虑以沪深**300**成份指数为样本的权益市场平均估值水平(PE)等因素，在不影响对基金产品的投资仓位进行分段控制，并在此基础上进行权益资产的投资操作。

具体仓位控制如下：  
当沪深**300**成份指数的市盈率(PE)处于历史后**20%**分位，本基金的股票资产占基金资产的比例为**60%-95%**；当沪深**300**成份指数的市盈率(PE)处于历史**20%**分位，本基金的股票资产占基金资产的比例为**0-50%**。

除上述两种情况外，本基金的股票资产占基金资产的比例为**50-90%**。

本基金将积极关注、深入分析并论证蓝筹股企业的投资机会，通过综合分析行业空间、行业地位、竞争格局、产品竞争力、盈利能力等多方面因素，去选择细分领域的龙头企业或具备成长为优质公司潜力的企业进行投资，分享企业长期增长带来的收益率。

2、股票投资策略  
本基金股票投资采取“核心-卫星策略”，即本基金投资于具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券不低于非现金基金资产的**80%**；卫星股票资产部分投资于具有品牌优势蓝筹企业之外的优质公司。

3、普通债券投资策略  
(1)债券投资组合策略  
本基金投资组合策略采用自上而下进行分析，从宏观经济和货币政策等方面，判断未来的利率走势，从而确定债券资产的配置策略；同时，在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合管理手段进行债券日常管理。

(2)个券选择策略  
在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

1)信用等级高、流动性好；  
2)资信状况良好，未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；  
3)公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理，有一定下行保护的转债。

4)可转换债券与可交换债券投资策略  
本基金可投资于可转债债券、可交换债券，该类债券赋予债券投资者某种期权，比普通债券投资更加灵活。本基金将综合研究此类期权债券的债券价值和期权价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素；期权价值方面仔细研究对含权债券所对应的个股的估值分析，包括估值水平、盈利能力和未来盈利预期等。

(1)可转换债券投资策略  
本基金利用可转换债券定价模型进行估值分析，重点结合个股投资价值、可转换债券条款、可转债的转债价值溢价水平、债券价值溢价水平选择性价比相对均衡的转债品种，获得一定超额回报。

(2)可交换债券投资策略  
可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过针对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析开展投资决策。

5、股指期货投资策略  
本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对市场走势和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货交易的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

6、国债期货投资策略  
本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险，对冲特债情形下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7、股票期权投资策略  
本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金基于对证券市场判断，结合期权定价模型，选择估值合理的期权合约。

8、资产支持证券投资策略  
在有效控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从以下方面综合定价，选择低估的品种进行投资，主要包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

四、投资限制  
1、组合限制  
基金的投资组合应遵循以下限制：  
(1)本基金股票资产占基金资产的**0%-95%**，投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券的比例不低于非现金基金资产的**80%**，投资于同业存单的比例不高于基金资产的**20%**；

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和国债期货合约需缴纳的交易所保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的**5%**，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3)本基金持有一家上市公司发行的证券，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上市公司发行的证券，不超过该证券的**10%**，完全按照有关指数的构成比例进行投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金及处于开放期的定期开放式基金)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**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%**；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(12)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%**，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为**1年**，债券回购到期后不得展期；

(六)投资管理程序  
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。本基金的投资管理程序如下：  
1.研究提供研究报告，以研究驱动投资  
本基金严格执行分析支持投资决策机制，加强研究对投资决策的支持工作，防止投资决策的随意性。研究员在熟悉基金的投资目标和投资策略基础上，对其分工的行业和上市公司进行综合研究、深度分析，广泛参考和利用外部研究成果，拜访政府机构、行业协会等，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，调查上市公司和相应服务提供商、终端销售商，考察上市公司真实经营状况，并向投资决策委员会和基金经理定期或不定期提供提供宏观经济分析报告、证券市场行情报告、行业分析报告和发债主体及上市公司研究报告等。

(二)投资范围  
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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的**30%-80%**；债券、货币市场工具、权证、现金、资产支持证券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占基金资产的**20%-70%**，其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的**3%**。基金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，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金股票资产部分至少**80%**投资于具有品牌优势的蓝筹企业。

(三)投资理念  
坚持价值投资理念，注重收益性、安全性、流动性的和衷，通过深入研究、仔细分析、全面论证，主要选取具有品牌优势的蓝筹企业进行积极主动投资，争取实现基金资产的长期稳健增值。

(四)投资决策依据  
1.国家有关法律法规和基金合同的有关规定；  
2.国内外宏观经济形势及其对中国证券市场的影响；  
3.国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；  
4.行业发展现状及前景；  
5.上市公司基本面及成长前景；  
6.股票、债券等资产的预期收益率及风险水平。

(五)投资策略  
本基金将综合运用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。在资产配置层面与个股选择层面对投资组合进行优化配置，争取实现基金资产超越业绩比较基准的稳健增值。

1.资产配置  
本基金资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA)。

(1)战略性资产配置(SAA)  
本基金战略性资产配置是指股票、债券等大类资产配置和股票的行业配置。具体而言，是在遵守基金合同规定的投资范围和投资比例的前提下，以现代投资组合理论、经济周期理论为指导，依据“自上而下”多经济周期MEKI分析决策支持系统，运用定性分析和定量分析，确定股票、债券等大类资产的投资比例和进行自上而下确定股票的行业配置。

根据现代投资组合理论和经济周期理论，预期风险与收益呈相关性。经济周期波动主要依据经济周期理论，经济发展具有周期性变化，每一轮经济周期分为衰退、复苏、扩张、放缓四个循环阶段，在这四个阶段中，股票、债券等大类资产和行业均存在着周期性的兴衰变化。因而本基金关注可能对各类资产及不同行业的预期风险、收益及相关性产生影响的各种因素，通过对宏观经济运行指标、财政、货币、利率、通货膨胀等进行前瞻性研究分析，判断和预测中国经济周期和趋势，严谨衡量大类资产以及不同行业的长期性的收益率、风险及相关性，确定基金资产在各大类资产和各个行业之间的战略配置策略。

(2)战术性资产配置(TAA)体系  
战术性资产配置(TAA)是根据特定市场环境及经济条件，围绕基金资产的战略资产配置基准对资产配置状态进行动态调整，从而增加投资组合价值的积极投资过程。

本基金结合国内资本市场的特点并结合成熟的联邦模型，建立了适应国内市场的战术性资产配置TAA体系，该体系遵循“回归均衡”的原则，根据各大类资产相对无风险资产的风险溢价水平以及该溢价水平对均衡或长期水平的偏离程度配置大类资产。

2.股票投资策略  
本基金股票投资采取“核心-卫星策略”，即本基金股票的核心资产部分投资于具有品牌优势的蓝筹企业，此部分投资不低于股票资产的**80%**；卫星股票资产部分投资于具有品牌优势蓝筹企业之外的优质公司。

3.债券投资策略  
(1)债券投资组合策略  
本基金的投资组合策略采用自上而下进行分析，从宏观经济和货币政策等方面分析，判断未来的利率走势，从而确定债券资产的配置策略；同时，在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合管理手段进行债券日常管理。

(2)个券选择策略  
在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

1)信用等级高、流动性好；  
2)资信状况良好，未来信用评级趋于稳定或有较大改善的企业发行的债券；  
3)公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率和投资溢价率合理，有一定下行保护的转债。

4.其他金融工具的投资策略  
本基金的权证投资将以保值为主要投资策略，以充分分散权证到期下跌风险，实现保值和锁定收益的目的。本基金在权证投资中以对应的标的证券的基本面为基础，结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等。

对于监管机构允许基金投资的其他金融工具，本基金将在谨慎分析收益性、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上，进行稳健投资，以降低组合风险，实现基金资产的保值增值。

(四)业绩比较基准  
沪深**300**指数收益率×**60%**+上证国债指数收益率×**40%**。  
本基金是混合型基金，基于本基金资产配置比例、股票投资对象和指数的市场代表性，采用沪深**300**指数和上证国债指数加权组成的复合指数作为本基金的业绩比较基准，能够真实反映本基金的风险收益特征，同时也能够恰当衡量本基金的投资业绩。

在本基金的运作过程中，如果法律法规变化或者出现更优、更具代表性、更能为市场普遍接受的业绩比较基准，则基金管理人将与基金托管人协商一致，并报中国证监会核准后公告，对业绩比较基准进行变更。

(五)风险收益特征  
本基金属于主动式混合型证券投资基金，通常预期风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

(六)投资管理程序  
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。本基金的投资管理程序如下：  
1.研究提供研究报告，以研究驱动投资  
本基金严格执行分析支持投资决策机制，加强研究对投资决策的支持工作，防止投资决策的随意性。研究员在熟悉基金的投资目标和投资策略基础上，对其分工的行业和上市公司进行综合研究、深度分析，广泛参考和利用外部研究成果，拜访政府机构、行业协会等，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，调查上市公司和相应服务提供商、终端销售商，考察上市公司真实经营状况，并向投资决策委员会和基金经理定期或不定期提供提供宏观经济分析报告、证券市场行情报告、行业分析报告和发债主体及上市公司研究报告等。

(二)投资范围  
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(包括中小板、创业板及其他依法发行上市的股票)、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、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债债券等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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)。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为**0%-95%**，投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券不低于非现金基金资产的**80%**。本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的**20%**；每个交易日终，扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交

易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的**5%**，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许，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。

三、投资策略  
1、大类资产配置策略  
本基金主要对国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势等进行综合分析，采用定量和定性相结合的研究方法，确定本基金在股票、债券等各类资产的投资比例。

本基金将基于宏观环境等因素，重点考虑以沪深**300**成份指数为样本的权益市场平均估值水平(PE)等因素，在不影响对基金产品的投资仓位进行分段控制，并在此基础上进行权益资产的投资操作。

具体仓位控制如下：  
当沪深**300**成份指数的市盈率(PE)处于历史后**20%**分位，本基金的股票资产占基金资产的比例为**60%-95%**；当沪深**300**成份指数的市盈率(PE)处于历史**20%**分位，本基金的股票资产占基金资产的比例为**0-50%**。

除上述两种情况外，本基金的股票资产占基金资产的比例为**50-90%**。

本基金将积极关注、深入分析并论证蓝筹股企业的投资机会，通过综合分析行业空间、行业地位、竞争格局、产品竞争力、盈利能力等多方面因素，去选择细分领域的龙头企业或具备成长为优质公司潜力的企业进行投资，分享企业长期增长带来的收益率。

2、股票投资策略  
本基金股票投资采取“核心-卫星策略”，即本基金投资于具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券不低于非现金基金资产的**80%**；卫星股票资产部分投资于具有品牌优势蓝筹企业之外的优质公司。

3、普通债券投资策略  
(1)债券投资组合策略  
本基金投资组合策略采用自上而下进行分析，从宏观经济和货币政策等方面，判断未来的利率走势，从而确定债券资产的配置策略；同时，在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合管理手段进行债券日常管理。

(2)个券选择策略  
在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

1)信用等级高、流动性好；  
2)资信状况良好，未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；  
3)公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理，有一定下行保护的转债。

4)可转换债券与可交换债券投资策略  
本基金可投资于可转债债券、可交换债券，该类债券赋予债券投资者某种期权，比普通债券投资更加灵活。本基金将综合研究此类期权债券的债券价值和期权价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素；期权价值方面仔细研究对含权债券所对应的个股的估值分析，包括估值水平、盈利能力和未来盈利预期等。

(1)可转换债券投资策略  
本基金利用可转换债券定价模型进行估值分析，重点结合个股投资价值、可转换债券条款、可转债的转债价值溢价水平、债券价值溢价水平选择性价比相对均衡的转债品种，获得一定超额回报。

(2)可交换债券投资策略  
可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过针对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析开展投资决策。

5、股指期货投资策略  
本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对市场走势和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货交易的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

6、国债期货投资策略  
本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险，对冲特债情形下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7、股票期权投资策略  
本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金基于对证券市场判断，结合期权定价模型，选择估值合理的期权合约。

8、资产支持证券投资策略  
在有效控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从以下方面综合定价，选择低估的品种进行投资，主要包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

四、投资限制  
1、组合限制  
基金的投资组合应遵循以下限制：  
(1)本基金股票资产占基金资产的**0%-95%**，投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券的比例不低于非现金基金资产的**80%**，投资于同业存单的比例不高于基金资产的**20%**；

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和国债期货合约需缴纳的交易所保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的**5%**，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3)本基金持有一家上市公司发行的证券，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上市公司发行的证券，不超过该证券的**10%**，完全按照有关指数的构成比例进行投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金及处于开放期的定期开放式基金)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**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%**；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(12)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%**，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为**1年**，债券回购到期后不得展期；

(六)投资管理程序  
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。本基金的投资管理程序如下：  
1.研究提供研究报告，以研究驱动投资  
本基金严格执行分析支持投资决策机制，加强研究对投资决策的支持工作，防止投资决策的随意性。研究员在熟悉基金的投资目标和投资策略基础上，对其分工的行业和上市公司进行综合研究、深度分析，广泛参考和利用外部研究成果，拜访政府机构、行业协会等，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，调查上市公司和相应服务提供商、终端销售商，考察上市公司真实经营状况，并向投资决策委员会和基金经理定期或不定期提供提供宏观经济分析报告、证券市场行情报告、行业分析报告和发债主体及上市公司研究报告等。

(二)投资范围  
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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的**30%-80%**；债券、货币市场工具、权证、现金、资产支持证券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占基金资产的**20%-70%**，其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的**3%**。基金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，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金股票资产部分至少**80%**投资于具有品牌优势的蓝筹企业。

(三)投资理念  
坚持价值投资理念，注重收益性、安全性、流动性的和衷，通过深入研究、仔细分析、全面论证，主要选取具有品牌优势的蓝筹企业进行积极主动投资，争取实现基金资产的长期稳健增值。

(四)投资决策依据  
1.国家有关法律法规和基金合同的有关规定；  
2.国内外宏观经济形势及其对中国证券市场的影响；  
3.国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；  
4.行业发展现状及前景；  
5.上市公司基本面及成长前景；  
6.股票、债券等资产的预期收益率及风险水平。

(五)投资策略  
本基金将综合运用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。在资产配置层面与个股选择层面对投资组合进行优化配置，争取实现基金资产超越业绩比较基准的稳健增值。

1.资产配置  
本基金资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA)。

(1)战略性资产配置(SAA)  
本基金战略性资产配置是指股票、债券等大类资产配置和股票的行业配置。具体而言，是在遵守基金合同规定的投资范围和投资比例的前提下，以现代投资组合理论、经济周期理论为指导，依据“自上而下”多经济周期MEKI分析决策支持系统，运用定性分析和定量分析，确定股票、债券等大类资产的投资比例和进行自上而下确定股票的行业配置。

根据现代投资组合理论和经济周期理论，预期风险与收益呈相关性。经济周期波动主要依据经济周期理论，经济发展具有周期性变化，每一轮经济周期分为衰退、复苏、扩张、放缓四个循环阶段，在这四个阶段中，股票、债券等大类资产和行业均存在着周期性的兴衰变化。因而本基金关注可能对各类资产及不同行业的预期风险、收益及相关性产生影响的各种因素，通过对宏观经济运行指标、财政、货币、利率、通货膨胀等进行前瞻性研究分析，判断和预测中国经济周期和趋势，严谨衡量大类资产以及不同行业的长期性的收益率、风险及相关性，确定基金资产在各大类资产和各个行业之间的战略配置策略。

(2)战术性资产配置(TAA)体系  
战术性资产配置(TAA)是根据特定市场环境及经济条件，围绕基金资产的战略资产配置基准对资产配置状态进行动态调整，从而增加投资组合价值的积极投资过程。

本基金结合国内资本市场的特点并结合成熟的联邦模型，建立了适应国内市场的战术性资产配置TAA体系，该体系遵循“回归均衡”的原则，根据各大类资产相对无风险资产的风险溢价水平以及该溢价水平对均衡或长期水平的偏离程度配置大类资产。

2.股票投资策略  
本基金股票投资采取“核心-卫星策略”，即本基金股票的核心资产部分投资于具有品牌优势的蓝筹企业，此部分投资不低于股票资产的**80%**；卫星股票资产部分投资于具有品牌优势蓝筹企业之外的优质公司。

3.债券投资策略  
(1)债券投资组合策略  
本基金投资组合策略采用自上而下进行分析，从宏观经济和货币政策等方面分析，判断未来的利率走势，从而确定债券资产的配置策略；同时，在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合管理手段进行债券日常管理。

(2)个券选择策略  
在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

1)信用等级高、流动性好；  
2)资信状况良好，未来信用评级趋于稳定或有较大改善的企业发行的债券；  
3)公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率和投资溢价率合理，有一定下行保护的转债。

4)可转换债券与可交换债券投资策略  
本基金可投资于可转债债券、可交换债券，该类债券赋予债券投资者某种期权，比普通债券投资更加灵活。本基金将综合研究此类期权债券的债券价值和期权价值，债券价值方面综合考虑票面利率、久期、信用资质、发行主体财务状况及公司治理等因素；期权价值方面仔细研究对含权债券所对应的个股的估值分析，包括估值水平、盈利能力和未来盈利预期等。

(1)可转换债券投资策略  
本基金利用可转换债券定价模型进行估值分析，重点结合个股投资价值、可转换债券条款、可转债的转债价值溢价水平、债券价值溢价水平选择性价比相对均衡的转债品种，获得一定超额回报。

(2)可交换债券投资策略  
可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。本基金将通过针对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析开展投资决策。

5、股指期货投资策略  
本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对市场走势和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货交易的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

6、国债期货投资策略  
本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险，对冲特债情形下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7、股票期权投资策略  
本基金按照风险管理的原则，在严格控制风险的前提下，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金基于对证券市场判断，结合期权定价模型，选择估值合理的期权合约。

8、资产支持证券投资策略  
在有效控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从以下方面综合定价，选择低估的品种进行投资，主要包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

四、投资限制  
1、组合限制  
基金的投资组合应遵循以下限制：  
(1)本基金股票资产占基金资产的**0%-95%**，投资于本基金界定的具有品牌优势的蓝筹企业的相关证券的比例不低于非现金基金资产的**80%**，投资于同业存单的比例不高于基金资产的**20%**；

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和国债期货合约需缴纳的交易所保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的**5%**，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3)本基金持有一家上市公司发行的证券，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上市公司发行的证券，不超过该证券的**10%**，完全按照有关指数的构成比例进行投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(5)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金及处于开放期的定期开放式基金)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**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%**；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的部分基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(12)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%**，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为**1年**，债券回购到期后不得展期；

(六)投资管理程序  
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。本基金的投资管理程序如下：  
1.研究提供研究报告，以研究驱动投资  
本基金严格执行分析支持投资决策机制，加强研究对投资决策的支持工作，防止投资决策的随意性。研究员在熟悉基金的投资目标和投资策略基础上，对其分工的行业和上市公司进行综合研究、深度分析，广泛参考和利用外部研究成果，拜访政府机构、行业协会等，了解国家宏观经济政策及行业发展状况，调查上市公司和相应服务提供商、终端销售商，考察上市公司真实经营状况，并向投资决策委员会和基金经理定期或不定期提供提供宏观经济分析报告、证券市场行情报告、行业分析报告和发债主体及上市公司研究报告等。

(二)投资范围  
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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的**30%-80%**；债券、货币市场工具、权证、现金、资产支持证券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占基金资产的**20%-70%**，其中，基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的**3%**。基金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，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金股票资产部分至少**80%**投资于具有品牌优势的蓝筹企业。

(三)投资理念  
坚持价值投资理念，注重收益性、安全性、流动性的和衷，通过深入研究、仔细分析、全面论证，主要选取具有品牌优势的蓝筹企业进行积极主动投资，争取实现基金资产的长期稳健增值。

(四)投资决策依据  
1.国家有关法律法规和基金合同的有关规定；  
2.国内外宏观经济形势及其对中国证券市场的影响；  
3.国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；  
4.行业发展现状及前景；  
5.上市公司基本面及成长前景；  
6.股票、债券等资产的预期收益率及风险水平。

(五)投资策略  
本基金将综合运用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。在资产配置层面与个股选择层面对投资组合进行优化配置，争取实现基金资产超越业绩比较基准的稳健增值。

1.资产配置  
本基金资产配置主要分为战略性资产配置(SAA)和战术性资产配置(TAA)。

(1)战略性资产配置(SAA)  
本基金战略性资产配置是指股票、债券等大类资产配置和股票的行业配置。具体而言，是在遵守基金合同规定的投资范围和投资比例的前提下，以现代投资组合理论、经济周期理论为指导，依据“自上而下”多经济周期MEKI分析决策支持系统，运用定性分析和定量分析，确定股票、债券等大类资产的投资比例和进行自上而下确定股票的行业配置。

(13)本基金的资产总值不得超过基金资产净值的**140%**；  
(14)本基金主动投资于流动性受限资产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本基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；  
(15)本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：  
1)本基金在任何交易日终，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%**；  
2)本基金在任何交易日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的**20%**；  
3)本基金在任何交易日终，持有的买入股指期货合约和卖出股指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**95%**，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；  
4)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；  
(16)本基金参与国债期货交易的，应当遵守下列要求：  
1)本基金在任何交易日终，持有的买入国债期货合约价值不得超过基金资产净值的**15%**；  
2)任何交易日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的**30%**；  
3)本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；  
4)本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的**30%**；  
(17)本基金参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：  
1)本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的**10%**；  
2)本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；平仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；  
3)本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的**20%**，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；  
(19)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。

除第(2)、(10)、(14)、(18)项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在**10**个交易日内进行调整，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之日起**6**个月内使基金的投资组合比例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本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的有关规定执行，如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制，以变更后的规定为准，且等调整生效后属于非强制性的，基金管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并应向投资者履行信息披露义务。

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保；  
(4)买卖其他基金份额，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；  
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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其他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时，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，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。重大关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至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止或限制性规定，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或以变更后的规定为准。

五、业绩比较基准

沪深300指数收益率x70%+上证国债指数收益率x30%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所内流动性好、规模最大的**300**只A股为样本的成份股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好、同时公信力较好的股票指数。上证国债指数由中证指数有限公司编制，以上海证券交易所上市的所有国债为样本，具有较好的市场代表性和较高的知名度，适合作为本基金债券基金投资的业绩基准。

根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称，或者有更权威的、能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

六、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

七、基金管理人代表基金行使股东或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或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；  
2.不谋求对上市公司的控股；  
八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

## 第三部分 基金财产

### (一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### (二)基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户，并开立基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相

### (三)基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构因履行该基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用。基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第三部分 基金财产

### (一)基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### (二)基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户，并开立基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相

### (三)基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构因履行该基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及基金合同约定的其他费用。基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买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。

## 二、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户以及其他基金财产账户相独立。

## 三、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。除法律法规和《基金合同》的规定外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有财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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买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。

## 二、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户以及其他基金财产账户相独立。

## 三、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。除法律法规和《基金合同》的规定外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有财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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买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。

## 二、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户以及其他基金财产账户相独立。

## 三、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。除法律法规和《基金合同》的规定外，基金财产不得被处分。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有财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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。



## 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易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。

## 估值对象

基金所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资资产及负债。

## 估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。(一)对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(二)对不存在活跃市场的投资品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(三)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。

## 估值方法

1.证券交易所上市的可有价证券的估值(1)交易所上市的可有价证券(包括股票等),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,确定公允价值;

(2)交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

(3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日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进行估值;

(4)对在交易所市场上上市的可转换债券,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值;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的,按最近交易日收盘价减去该可转债收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,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,确定公允价值;

(5)交易所上市实行净价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息(税后)得到的净价进行估值;

(6)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,如基金管理人认为有充分理由认为公允价值高于通过估值技术确定的公允价值,且公允价值更能客观和合理地反映公允价值,基金管理人应持续评估上述估值技术的适用性,并在估值技术失效时及时做出调整处理;

2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:(1)逆回购、转融通、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、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)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、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限售限售股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中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;

(4)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,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况,应采用估值技术确定公允价值;

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.本基金投资的股指期货合约以估值当日结算价进行估值,估值当日无报价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日的结算价估值。

5.本基金投资的期权合约,根据相关法律法规以及监管部门的有关规定估值。

6.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。

7.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。

8.如有充足理由认为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。

9.当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

10.存在相关法律法规以及监管部门有相关规定且适用于本基金的,从其规定,如有新增事项,按国家最新规定估值。

## 估值程序

1.基金份额净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0.0001元,小数点后第五位四舍五入。基金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。

基金管理人于每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2.基金管理人应每个估值日对基金资产估值,但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送给基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按规定对外公布。

## 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4位以内(含第4位)发生估值计算错误时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

## 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、登记机构、销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,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(“受损失方”)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、下达指令差错等。

## (一)估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

## (二)估值方法

1.证券交易所上市的可有价证券的估值(1)交易所上市的可有价证券(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,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,确定公允价值;

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,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,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,确定公允价值;

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;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,按最近交易日收盘价减去该债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,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,确定公允价值;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,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;

2.处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:(1)逆回购、转融通、配股和公开增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,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况下,按成本估值;

(3)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时,按交易所上市的同一股票的市价(收盘价)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.全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4.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。

5.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,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。

6.当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

7.相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

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,按照基金管理人对本基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## (三)估值对象

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。

## (四)估值程序

1.基金份额净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0.0001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

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.基金管理人应于每个工作日对基金资产估值,但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送给基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按规定对外公布。月末、季末和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## (五)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)发生差错时,视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

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、登记机构、销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,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(“受损失方”)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、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系行业内现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,不按差错处理。

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差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利者仍应承担返还不当得利义务。

2.差错处理原则

(1)差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方对直接损失承担赔偿责任;若差错责任方已积极协调,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,则应与其承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正。

(2)差错的赔偿责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对差错的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3)因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务,但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损失方”),则差错责任方应赔偿受损失方的直接损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损失方,则受损失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差错责任方。

(4)差错调整采用估值恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和其他基金财产的损失,并由过错承担赔偿的责任。在基金管理人追偿之前,应由基金管理人负责向差错方追偿。上述追偿程序产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

## 第十四部分 基金资产估值(原“十四、基金资产的估值”)

<p>(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行依据法律法规,向被追偿方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现错误的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。</p> <p>(7)按法律法规规定的其他方式处理差错。</p> <p>3.差错处理程序</p> <p>差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:</p> <p>(1)查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的赔偿责任;</p> <p>(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;</p> <p>(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的当事人进行更正和赔偿损失;</p> <p>(4)根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下:</p> <p>(1)基金份额净值出现差错时,基金管理人应当及时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。</p> <p>(2)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成直接损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。</p> <p>(3)基金管理人及基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。</p> <p>(4)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。</p> <p>(六)暂停估值的情形</p> <p>1.基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>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;</p> <p>3.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保护投资者的利益,决定延迟估值;</p> <p>4.出现基金管理人认为属于会导致基金资产价值发生重大变化的情形,经与基金托管人协商一致,基金管理人应当暂停估值;</p> <p>(七)基金净值的确认</p> <p>用于基金信息披露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并发送给基金托管人。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,由基金管理人对外公布。</p> <p>(八)特殊情况的处理</p> <p>1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第5项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2.由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,基金管理人及基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人及基金托管人免除赔偿责任,但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>	<p>2.估值错误处理原则</p> <p>(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而产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方直接承担相应赔偿责任;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,则其应当承担责任。估值错误责任方对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。</p> <p>(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。</p> <p>(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估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成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当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。</p> <p>(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。</p> <p>3.估值错误处理程序</p> <p>估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:</p> <p>(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任方;</p> <p>(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;</p> <p>(3)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的当事人进行更正和赔偿损失;</p> <p>(4)根据估值错误处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金托管机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。</p> <p>4.基金份额净值估值错误处理的方法如下:</p> <p>(1)基金份额净值出现差错时,基金管理人应当及时通报基金托管人,并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案;</p> <p>(2)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。如果行业另有通行做法,基金管理人及基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>1.基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>八、基金净值的确认</p> <p>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并发送给基金托管人。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,由基金管理人对外公布。</p> <p>九、特殊情况的处理</p> <p>1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第8项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2.由于不可抗力原因,或证券、期货交易所及登记结算公司、存款银行发送的数据错误等,基金管理人及基金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基金资产估值错误,基金管理人、基金托管人免除赔偿责任,但基金管理人、基金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。</p> <p>十、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>本基金实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息,暂停披露侧袋账户净值。</p>
<p>(一)基金费用的种类</p> <p>3.基金财产划拨支付的银行费用;</p> <p>4.基金合同生效后与基金信息披露费用;</p> <p>5.基金合同生效后与基金有关的会计师事务所和律师费;</p> <p>7.基金的证券、期货交易费用;</p> <p>8.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;</p> <p>9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。</p> <p>(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。</p> <p>(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1.基金管理人的管理费</p> <p>在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提,计算方法如下:</p> $H = Ex \times \text{年管理费率} \times \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p>E为前一日基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。</p> <p>2.基金托管人的托管费</p> <p>在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提,计算方法如下:</p> $H = Ex \times \text{年托管费率} \times \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>E为前一日基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。</p> <p>3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据相关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额列支,列入或摊入当期基金费用。</p> <p>(四)不列入基金费用的项目</p> <p>基金管理人及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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不列入基金财产中支付。</p> <p>(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费和基金托管费率。基金管理人必须至少提前30个工作日在指定媒介上刊登公告。</p> <p>(六)基金税收</p> <p>基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。</p>	<p>一、基金费用的种类</p> <p>3.基金财产划拨支付的银行费用;</p> <p>4.(基金合同)生效后与基金相关的信息披露费用;</p> <p>5.(基金合同)生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼费和仲裁费;</p> <p>7.基金的证券、期货等交易费用;</p> <p>8.基金的银行汇划费用;</p> <p>9.基金的开户费用、账户维护费用;</p> <p>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。</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1.基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提,管理费的计算方法如下:</p> $H = Ex \times 1.50\% \times \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金管理费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日期顺延,费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。</p> <p>2.基金托管人的托管费</p> <p>本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,托管费的计算方法如下:</p> $H = Ex \times 0.25\% \times \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的基金托管费</p> <p>E为前一日的基金资产净值</p> <p>基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日或不可抗力等,支付日期顺延,费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第3-10项费用,根据有关法规和相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>下列费用不列入基金费用:</p> <p>1.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;</p> <p>2.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;</p> <p>3.(基金合同)生效前的相关费用;</p> <p>4.其他根据相关法律法规和中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。</p> <p>四、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定。</p> <p>五、基金税收</p> <p>本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。</p> <p>鉴于基金管理人作为基金的利益投资者,运用基金财产过程中,可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人,就归属于基金的投资收益、投资回报和/或基金承担纳税义务。因此,本基金运营过程中由于上述原因发生的增值性税费,仍由本基金财产承担,同时基金管理人及基金托管人可通过本基金财产账户直接缴付,或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。</p>

第十五部分 基金费用与税收

(一)十五 基金的费用与税收

#### (一)基金收益的构成

- 1.买卖证券差价；
- 2.基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3.银行存款利息；
- 4.已实现的其他合法收入；
- 5.持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

#### (二)基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定应在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### (三)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：  
1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；  
收益分配所发生的银行转账或其他手续费由投资者自行承担，当投资者的现金红利小于一定金额时，基金注册登记机构可将投资者的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资者选择不，本基金默认的收益分配方式是现金分红；  
3.本基金在符合有关分红条件的前提下，收益每年最多分配4次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益

的50%；  
4.若基金合同生效不满3个月则不进行收益分配；  
5.本基金收益分配方式分为两种，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按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；  
6.基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；  
7.基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；  
8.基金收益分配后基金份额净值不能低于基金份额面值；  
9.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### (四)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式和内容。

#### (五)收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；  
2.在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行红资金的划付。

#### (一)基金的会计政策

1.基金管理人为本基金的会计责任方；  
2.本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；  
3.本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；  
4.会计核算执行国家有关的会计制度；  
6.基金管理人保证完整的会计账目，凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；  
7.基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

#### (二)基金的审计

1.基金管理人聘请具有从事证券、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年度财务报表及其他财务事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。  
2.会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。  
基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，可以更换，就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (一)基金的信息披露政策

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及相关法律法规，基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

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及其召集机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当按照《信息披露办法》等相关规定披露，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。

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：  
4.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；  
5.对同一事项进行选择性披露；  
6.法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

#### (一)招募说明书

基金管理人应在基金发售前将基金招募说明书登载于指定报刊和网站上；基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

#### (二)基金合同、托管协议

基金管理人应在基金发售的3日前，将基金合同、托管协议登载在指定报刊和网站上；基金合同生效后，基金合同、托管协议发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金合同、托管协议并登载在指定网站上；基金合同、托管协议其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金合同、托管协议。

#### (三)基金产品资料概要

基金产品资料概要为基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明扼要的信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

#### (四)基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，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载于指定报刊和网站上。

#### (五)基金合同生效公告

基金管理人将在收到基金合同生效文件的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将载明基金募集概况。

#### (六)基金净值信息

1.本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；  
2.在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；  
3.基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### (七)基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件中载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (八)基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

1.基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，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需经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；  
2.基金管理人应当在上半年度结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上；  
3.基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (九)基金重大事件公告

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产状况及其流动性风险分析等。

#### (十)基金终止上市公告

基金管理人应当在基金终止上市公告中披露基金终止上市的原因、基金份额持有人的财产处置方案、基金财产清算的进展等情况。

#### (十一)基金清算报告公告

基金管理人应当在基金清算报告中披露基金清算的进展、基金财产清算的结果、基金份额持有人的财产处置方案等情况。

#### (十二)基金分红公告

基金管理人应当在基金分红公告中披露基金分红的方案、基金分红的日期、基金分红的对象、基金分红的金额、基金分红的支付方式、基金分红的资金来源等情况。

#### (十三)基金投资策略公告

基金管理人应当在基金投资策略公告中披露基金的投资目标、投资范围、投资策略、资产配置比例、风险控制措施等情况。

#### (十四)基金费用公告

基金管理人应当在基金费用公告中披露基金的各项费用，包括基金管理费、基金托管费、基金销售服务费、基金赎回费等。

#### (十五)基金风险评级公告

基金管理人应当在基金风险评级公告中披露基金的风险等级、基金的风险收益特征、基金的风险控制措施等情况。

#### (十六)基金其他重要公告

基金管理人应当在基金其他重要公告中披露基金的其他重要信息，包括基金的重大诉讼、基金的重大关联交易、基金的重大资产处置等情况。

#### (十七)基金其他重要公告

基金管理人应当在基金其他重要公告中披露基金的其他重要信息，包括基金的重大诉讼、基金的重大关联交易、基金的重大资产处置等情况。

#### (十八)基金其他重要公告

基金管理人应当在基金其他重要公告中披露基金的其他重要信息，包括基金的重大诉讼、基金的重大关联交易、基金的重大资产处置等情况。

#### (十九)基金其他重要公告

基金管理人应当在基金其他重要公告中披露基金的其他重要信息，包括基金的重大诉讼、基金的重大关联交易、基金的重大资产处置等情况。

#### (二十)基金其他重要公告

基金管理人应当在基金其他重要公告中披露基金的其他重要信息，包括基金的重大诉讼、基金的重大关联交易、基金的重大资产处置等情况。

#### (二十一)基金其他重要公告

基金管理人应当在基金其他重要公告中披露基金的其他重要信息，包括基金的重大诉讼、基金的重大关联交易、基金的重大资产处置等情况。

#### (二十二)基金其他重要公告

基金管理人应当在基金其他重要公告中披露基金的其他重要信息，包括基金的重大诉讼、基金的重大关联交易、基金的重大资产处置等情况。

#### 一.基金利润的构成

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，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

#### 二.基金可供分配利润

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。

#### 三.基金收益分配原则

1.本基金收益分配应遵循下列原则：  
基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；  
2.本基金收益分配方式分为两种：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，本基金默认的收益分配方式为现金分红；  
3.基金收益分配基准日的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位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.法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致后，对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。  
本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

#### 四.收益分配方案

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

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告。

#### 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由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费时，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，依照《业务规则》执行。

#### 七.实施强制执行期间的收益分配

本基金实施强制执行时，除账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

#### 一.基金会计政策

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；  
3.基金会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；  
4.会计核算执行国家有关会计制度；  
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，按照有关规定编制基金会计报表；  
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。

#### 二.基金的年度审计

1.基金管理人聘请具有从事证券、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年度财务报表及其他财务事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。  
2.会计师事务所更换经办注册会计师时，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，须报经基金托管人同意，更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

#### 一.本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《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和中国证监会规定的自然人、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，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务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符合中国证监会规定条件的全国性报刊(以下简称“规定报刊”)和(信息披露办法)规定的互联网网站(以下简称“规定网站”)等公开披露，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：

4.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；  
5.对同一事项进行选择性披露；  
6.法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

#### 四.公开披露的基金信息

基金管理人应当在基金招募说明书中披露基金的投资目标、投资范围、投资策略、资产配置比例、风险控制措施等情况。

#### (一)基金招募说明书

1.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
2.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
3.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
4.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
5.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
6.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
7.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
8.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
9.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
10.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
11.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
12.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
13.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
14.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
15.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
16.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
17.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
18.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
19.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
20.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
21.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
22.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
23.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
24.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
25.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
26.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
27.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
28.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
29.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
30.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
31.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
32.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
33.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
34.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
35.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
36.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
37.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
38.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
39.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
40.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
41.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
42.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
43.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
44.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
45.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
46.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
47.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
48.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
49.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
50.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
51.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
52.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
53.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
54.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
55.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
56.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
57.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
58.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
59.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
60.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
61.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
62.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
63.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
64.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
65.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
66.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
67.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
68.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
69.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
70.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
71.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
72.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
73.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
74.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
75.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
76.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
77.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
78.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
79.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
80.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
81.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
82.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
83.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
84.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
85.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
86.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
87.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
88.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
89.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
90.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
91.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
92.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
93.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
94.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
95.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
96.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
97.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
98.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
99.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
100.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
101.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
102.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
103.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
104.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
105.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
106.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
107.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
108.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
109.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
110.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
111.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
112.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
113.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
114.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
115.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
116.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
117.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
118.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
119.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
120.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
121.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
122.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
123.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
124.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
125.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
126.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
127.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
128.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
129.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
130.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
131.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
132.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
133.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
134.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
135.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
136.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
137.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
138.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
139.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
140.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
141.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
142.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
143.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
144.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
145.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
146.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
147.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
148.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
149.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
150.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
151.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
152.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
153.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
154.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
155.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
156.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
157.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
158.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
159.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
160.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
161.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
162.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
163.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
164.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
165.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
166.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
167.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
168.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
169.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
170.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
171.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
172.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
173.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
174.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
175.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
176.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
177.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
178.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
179.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
180.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
181.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
182.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
183.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
184.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
185.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
186.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
187.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
188.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
189.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
190.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
191.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
192.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
193.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
194.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
195.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
196.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
197.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
198.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
199.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
200.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
201.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
202.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
203.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
204.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
205.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
206.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
207.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
208.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
209.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
210.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
211.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
212.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
213.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
214.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
215.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
216.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
217.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
218.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
219.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
220.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
221.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
222.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
223.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
224.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
225.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
226.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
227.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
228.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
229.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
230.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
231.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
232.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
233.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
234.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
235.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
236.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
237.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
238.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
239.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
240.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
241.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
242.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
243.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
244.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
245.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
246.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
247.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
248.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
249.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
250.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
251.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
252.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
253.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
254.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
255.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
256.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
257.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
258.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
259.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
260.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
261.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
262.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
263.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
264.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
265.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
266.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
267.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
268.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
269.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
270.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
271.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
272.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
273.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
274.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
275.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金产品资料概要；  
276.基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、



3. 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网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

4. 基金合同生效不足 2 个月的,本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。

5. 报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形,为保障其他投资者利益,基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告中披露“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。

6. 本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分析等。

#### (九) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时,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网站上:

2. 基金合同终止、基金清算;

8. 基金募集期延长;

10. 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%,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 30%;

11. 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁;

16. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.50%;

23. 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事项、中国证监会或基金合同规定的其他事项。

#### (十) 澄清公告

在本基金合同存续期限内,任何公共媒体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。

(十一) 基金份额持有人大会决议

#### (十二) 清算报告

基金合同终止的,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报刊上。

#### (十四) 信息披露事务管理

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法律法规。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息,并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但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,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

#### (十五) 信息披露文件的存放与查阅

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各自住所,供社会公众查阅、复制。

(十六) 本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

2. (基金合同) 终止、基金清算;

8. 基金募集期延长或提前结束募集;

10. 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十,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三十;

11. 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁;

16. 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;

23. 增加或调整基金份额类别的设置;

24. 基金推出新业务或服务;

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事项或中国证监会规定的其它事项。

#### (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。

#### (十) 基金投资股指期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### (十一) 基金投资国债期货的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### (十二) 基金投资股票期权的信息披露

基金管理人应当在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等,并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### (十三) 基金投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年度报告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内未按时市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### (十四) 清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计,并由律师事务所出具法律意见书,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报刊上。

#### (十五) 实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露,详见招募说明书的规定。

#### 六、信息披露事务管理

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法规规定。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金的信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息,并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但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、信息披露文件的存放与查阅

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各自住所,供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟披露基金信息的情形

当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息:

1. 不可抗力;
2. 出现基金合同约定的暂停估值的情形;
3. 法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

#### (一) 基金合同的变更

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;

(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、监管机构要求提高该等报酬标准的除外;

(7) 本基金与其他基金的合并;

(8) 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、基金合同或中国证监会规定的其它情形。

<p>但出现下列情况时,可以不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:</p> <p>(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;</p> <p>(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率、转换费率等费率或收费方式;</p> <p>(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(6)按照法律法规或本基金合同规定需召开基金份额持有人大会以外的其他情形。</p> <p>2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起2日内在至少一种指定媒介上公告。</p> <p>(二)本基金合同的终止</p> <p>有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后终止:</p> <p>1. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,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公司承接其原有权利义务;</p> <p>2. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由,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托管机构承接其原有权利义务;</p> <p>3. 中国证监会规定的其他情况。</p> <p>(三)基金财产的清算</p> <p>1. 基金财产清算组</p> <p>(1)基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。</p> <p>(2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>(3)在基金财产清算过程中,基金管理人和基金托管人应各自履行职务,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>(4)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>2. 基金财产清算程序</p> <p>基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:</p> <p>(1)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;</p> <p>(2)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;</p> <p>(3)对基金财产进行清理和确认;</p> <p>(4)对基金财产进行估价和变现;</p> <p>(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;</p> <p>(6)聘请律师事务所出具法律意见书;</p> <p>(7)将基金财产清算结果报告中国证监会;</p> <p>(8)参加与基金财产有关的民事诉讼;</p> <p>(9)公布基金财产清算结果;</p> <p>(10)对基金剩余财产进行分配。</p> <p>3. 清算费用</p> <p>清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。</p> <p>4. 基金财产按下列顺序清偿:</p> <p>(1)支付清算费用;</p> <p>(2)交纳所欠税款;</p> <p>(3)清偿基金债务;</p> <p>(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。</p> <p>基金财产未按前款(1)-(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。</p> <p>5. 基金财产清算的公告</p> <p>基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。</p> <p>6. 基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。</p>	<p>一、(基金合同)的变更</p> <p>1. 变更基金合同涉及法律法规规定或本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决议通过。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同意后变更并公告,并报中国证监会备案。</p> <p>2. 关于(基金合同)变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行,自决议生效后两日内在指定媒介公告。</p> <p>二、(基金合同)的终止事由</p> <p>有下列情形之一的,经履行相关程序后,(基金合同)应当终止:</p> <p>1. 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;</p> <p>3.(基金合同)约定的其他情形。</p> <p>4. 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p> <p>三、基金财产的清算</p> <p>1. 基金财产清算小组,自出现(基金合同)终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,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。</p> <p>2. 基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>3. 基金财产清算小组职责: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。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>4. 基金财产清算程序:</p> <p>(1)基金合同终止情形出现时,由基金财产清算组统一接管基金财产;</p> <p>(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认;</p> <p>(3)对基金财产进行估值和变现;</p> <p>(4)制作清算报告;</p> <p>(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;</p> <p>(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;</p> <p>(7)对基金剩余财产进行分配。</p> <p>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,清算期限相应顺延。</p> <p>四、清算费用</p> <p>清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。</p> <p>五、基金财产清算剩余资产的分配</p> <p>依据基金财产清算的分配方案,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。</p> <p>六、基金财产清算的公告</p> <p>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符合《中华人民共和国证券法》规定的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个工作日内由基金财产清算小组进行公告。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报刊上。</p> <p>七、基金财产清算账册及文件的保存</p> <p>基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存,保存期限不低于法律法规规定的最低期限。</p>
<p>(一)基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中,违反(基金法)规定或者本基金合同约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为给基金财产或者基金份额持有人造成的直接损失依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当对直接损失承担赔偿责任,但是发生下列情况的,当事人可以免责:</p> <p>2. 基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失;</p> <p>3. 在有过错的情况下,基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则投资或不投资而造成的损失或给基金财产造成损失。</p> <p>(二)基金合同当事人违反基金合同,给其他当事人造成经济损失的,应当对直接损失承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下,基金合同能继续履行的,应当继续履行。</p> <p>(三)本基金合同一方当事人造成违约后,其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。</p> <p>(四)因一方当事人违约而导致其他当事人损失的,基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。</p> <p>(五)由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资人损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p>	<p>一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中,违反(基金法)等法律法规的规定或者(基金合同)约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为给基金财产或者基金份额持有人造成的直接损失依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当对直接损失承担赔偿责任,仅限于直接损失,但是如发生下列情况,当事人免责:</p> <p>2. 基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等;</p> <p>3. 基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则投资或不投资造成的损失等。</p> <p>二、在发生一方或多方违约的情况下,在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下,(基金合同)能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施,防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。</p> <p>三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成基金财产或投资人损失,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金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。</p>
<p>对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决,不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方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届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,仲裁费用由败诉方承担。</p> <p>本基金合同受中华人民共和国法律管辖。</p>	<p>各方当事人同意,因(基金合同)而产生的或与(基金合同)有关的一切争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方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届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,除非仲裁裁决另有规定,仲裁费用由败诉方承担。</p> <p>(基金合同)受中国法律管辖。</p>
<p>基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>(一)本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字,在基金募集结束,基金备案手续办理完毕,并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p> <p>(二)本基金合同自生效之日起即包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律效力。</p> <p>(三)本基金合同正本一式八份,除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外,基金管理人和基金托管人各持两份,每份均具有同等的法律效力。</p> <p>(四)本基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。</p>	<p>(基金合同)是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>1.(基金合同)经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续,并经中国证监会书面确认后生效。</p> <p>2.(基金合同)的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。</p> <p>3.(基金合同)自生效之日起即包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的(基金合同)各方当事人具有同等的法律效力。</p> <p>4.(基金合同)正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,基金管理人、基金托管人各持二份,每份具有同等的法律效力。</p> <p>5.(基金合同)可印制成册,供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。</p>
<p>其他事项(原“第二十三部分”其他事项)</p> <p>本基金合同如有未尽事宜,由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。</p>	<p>(基金合同)如有未尽事宜,由(基金合同)当事人各方按有关法律法规协商解决。</p>