国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同

(上接A25版)

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

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,应当在该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,大会主持人可以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) 单独或合并持有权利登记日基金总份额10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,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召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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宣布会议议事程序及注意事项,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以所代表的基金份额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、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

在通讯表决开会的方式下,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第2个工作日统计全部有效表决,在公证机关及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公正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。

2.基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(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%以上通过方为有效,除下列(2)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者备案,并予以公告。

4.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(八)计票

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,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中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主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中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;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行选举三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异议,可以对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异议,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票人在监督人派出的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者备案。基金份额持有人大会决议自中国证监会依法核准或者出具无异议的意见之日起生效。

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执行生效的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日内在至少一种指定媒体公告。

(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。

九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

(一)基金管理人的更换

1.基金管理人的更换条件

有下列情形之一的,经基金份额持有人大会决议并经中国证监会核准,基金管理人职责终止:

(1)基金管理人被依法取消基金管理资格;

(2)基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产;

(3)基金管理人被基金份额持有人大会解任;

(4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

2.基金管理人的更换程序

更换基金管理人必须依照如下程序进行:

(1)提名:新任基金管理人由基金托管人提名;

(2)决议:基金份额持有人大会在原基金管理人职责终止后6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;

(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生效后方可执行;

(4)交接:原基金管理人职责终止的,应当妥善保管基金管理业务资料,及时办理基金管理业务的移交手续,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;

(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,同时报国务院证券监督管理机构备案,审计费用在基金财产中列支;

(6)公告:基金管理人更换后,由基金托管人在获得中国证监会核准后2日内公告;

(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的名称字样。

(二)基金托管人的更换

1.基金托管人的更换条件

有下列情形之一的,经基金份额持有人大会决议并经中国证监会核准,基金托管人职责终止:

(1)基金托管人被依法取消基金托管资格;

(2)基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产;

(3)基金托管人被基金份额持有人大会解任;

(4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

2.基金托管人的更换程序

(1)提名:新任基金托管人由基金管理人提名;

(2)决议:基金份额持有人大会在原基金托管人职责终止后6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;

(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生效后方可执行;

(4)交接:原基金托管人职责终止的,应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料,及时办理基金财产和托管业务移交手续, 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;

(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,同时报国务院证券监督管理机构备案,审计费用从基金财产中列支;

(6)公告:基金托管人更换后,由基金管理人在获得中国证监会核准后2日内公告。

(三)基金管理人与基金托管人同时更换

1.提名:如果基金管理人和基金托管人同时更换,由单独或合计持有基金总份额10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人;

2.基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行;

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2日内在指定媒体上联合公告。

(四) 新基金管理人接收基金管理业务或新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。

十、基金的托管

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《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、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。

十一、基金份额的登记

(一)本基金的登记结算业务指基金登记、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。

(二)本基金的登记结算业务由基金管理人委托的中国证券登记结算有限责任公司负责办理。基金管理人应与中国证券登记结算有限责任公司签订委托代理协议,以明确基金管理人和代理机构在登记结算业务中的权利义务,保护基金份额持有人的合法权益。

(三)登记结算机构享有如下权利:

1.建立和管理投资人基金账户;

2.取得登记结算费;

3.保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等;

4.在法律法规允许的范围内,制定和调整登记结算业务的相关规则;

5.法律法规规定的其他权利。

(四)登记结算机构承担如下义务:

1.配备足够的专业人员办理本基金的登记结算业务;

2.严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的登记结算业务;

3.保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录15年以上;

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;

5.按基金合同和招募说明书规定为投资人办理非交易过户、转托管等业务,并提供其他必要服务;

6.法律法规规定的其他义务。

十二、基金的投资

(一)投资目标

本基金为价值精选混合型股票基金,以量化指标分析为基础,在严密的风险控制前提下,不断谋求超越业绩比较基准的稳定回报。

(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、短期金融工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的35%–95%, 权证投资比例占基金资产净值的0–3%;债券资产的投资比例占基金资产的0–60%,其中资产支持证券类资产的投资比例占基金资产净值的0%–10%;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%。

(三)投资策略

1.大类资产配置

本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。

本基金资产配置主要包括战略性资产配置和战术性资产配置:战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险,然后确定最能满足各类基金风险–回报率目标的资产组合;战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同,预测短期性回报率,调整资产配置,获取市场时机选择的超额收益。本基金的资产配置主要采用定量分析与定性分析相结合的方法。

在定量分析方面,主要采用均衡市盈率预测模型,并参考其他相关指标。均衡市盈率模型的思路是通过测算A股市场理论上均衡的市盈率水平,然后将其与A股市场整体、基金股票池的实际市盈率水平进行比较,来判定股票市场系统性风险的高低,最后则根据理论值与实际值的差异程度来决定资产配置中股票资产的配置比例。另外,本基金还参照股息率、收益率差距表(1/PE–银行利率)等指标,来判断股市是否处于合理水平。

在定性分析方面,主要对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析,并对根据定量模型作出的资产配置方案进行修正。定性因素涉及很多方面,主要包括国家宏观经济和证券市场政策、利率和汇率政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等。

2.股票资产投资策略

本基金以量化分析为基础,从上市公司的基本面分析入手,建立基金的一、二级股票池。根据股票池中个股的估值水平和α值,运用组合优化模型,积极创建并持续优化基金的股票组合,在有效控制组合总体风险的前提下,谋求超额收益。

基金股票池的建立

本基金采取自下而上的方法,从个股选择入手,根据个股的基本面信息,运用多因子模型,选取各行业中具有内在价值的个股组成基金的一级股票池;在一级股票池的基础上,运用现金流折价模型和个股超额收益分析,筛选个股组建基金的二级股票池。

1)一级股票池个股筛选

本基金在建立一级股票池时,是以行业为单位,按照不同行业各自的特点,选取不同的估值因子构建多因子估值模型,对行业内的个股进行估值。本基金的行业分类以天相行业分类标准为依据。

本基金在运用估值模型对行业内个股内在价值估值的基础上,选取各行业内价值排名前1/3的个股组成基金的一级股票池。

2)二级股票池个股筛选

本基金二级股票池是以现金流折价模型和个股超额收益分析(个股的α值)做为筛选标准对基金一级股票池中的个股进行二次筛选。

本基金在运用现金流折现模型时, 通过对上市公司未来业绩的预测和场景模拟等方法, 估算个股的未来现金流; 在折现因子的确定上, 本基金运用加权平均资本成本模型(WACC),充分考虑到股权成本和债券成本的差异和税务盾牌的作用,精确估算个股的折现值。对于周期性行业等现金流波动较大的行业,本基金在现金流折现的基础上,依据这类个股的市场表现,估算个股的α值,以α值作为二次选股的优先考虑因素。

本基金在一级股票池中选取折现值靠前的300个左右个股组成基金的二级股票池。

3)股票组合构建和调整

本基金在充分考虑个股内在价值和风险收益水平的基础上,在二级股票池中选取个股构建基金的股票组合,运用组合优化模型不断优化股票组合,以达到单位风险下的收益最大化。

3.债券资产投资策略

本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础, 结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。

1)收益率曲线配置具体策略

当预测收益率曲线平行上移或是陡峭化时,适当地降低债券组合的平均久期;当预测收益率曲线平行下移或是平坦化时,适当地增加债券组合的平均久期;当预测收益率曲线剧烈平行上移时,同时降低债券组合的平均久期和债券组合的持仓量;当预测收益率曲线剧烈平行下移时,同时增加债券组合的平均久期和债券组合的持仓量;当预测收益率曲线(正向或是反向)蝴蝶型变化时,适当地将债券组合进行子弹型或是哑铃型配置。

2)债券置换策略

本基金以利差分析为基础,当债券利差增大时,适当增加企业债和金融债的数量、减少国债的数量,当债券利差减小时,适当增加国债的数量、减少企业债和金融债的数量;债券组合的平均信用等级保持在投资级(A+级)以上。

在通过上述配置方法构建债券组合之后,本基金在出现以下情况时对债券投资组合进行动态调整:

(1)短期经济运行指标, 如短期通货膨胀率、短期名义利率、汇率等发生变动,引起的市场实际利率的变动;

(2)中长期国内通货膨胀预期的变动引起中长期利率走势变动,导致整个投资组合重新估价;

(3)央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向,从而引起债券市场结构性调整;

(4)债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与认购情况发生变化,导致二级市场收益率产生波动;

(5)由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价;

(6)市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动;

(7)单个券种或某一类别债券的定价偏差,也就是市场失衡导致的投资机会等。

(四)业绩比较基准

业绩比较基准:65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率

上证综合指数和上证国债指数市场代表性较强,适合作为本基金的业绩比较基准。

在本基金的运作过程中,如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益,则基金管理人在经过基金托管人同意后可以对业绩比较基准进行适当调整,并在报中国证监会核准后,公告并予以实施。

(五)风险收益特征

本基金属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。

(六)选券标准

1.债券资产选择标准

(1)个券信用等级在AA级或其同等级别以上;

(2)相同剩余期限中到期收益率较高的;

(3)有较好流动性(日成交量大、买卖价差小);

(4)通过二叉树模型估算所含期权被市场低估的可转债;

(5)可转债具有不可撤销的连带责任担保或者资产抵押。

2.股票资产选择标准

(1)利用多因子估值模型筛选出的各行业股值前1/3的个股;

(2)根据现金流折现模型和个股α值,对个股进行二次估值;

(3)通过内在价值分析,对内在价值被低估的个股进行重点投资。

3.权证选择标准:

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上,主要用于锁定收益和控制风险。

(1)考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值;

(2) 计算权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性,为权证的具体操作提供依据。

(七)投资限制

1.组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(3)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%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(5) 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%;

(6) 本基金股票资产的投资比例占基金资产的35%–95%,权证投资占基金资产净值的0–3%,债券资产的投资比例占基金资产的0–60%,其中资产支持证券类资产占基金资产净值的0–10%;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%;

(7)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%;

(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%;本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。本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;

(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)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;

(11) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(12)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人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;

(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8)依照法律法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(9)法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

(七)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十三、基金的财产

(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)基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三)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。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四)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、基金托管人因基金财产的管理、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、托管费以及其他基金合同约定的费用。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。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的,基金财产不属于其清算财产。

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。

十四、基金资产的估值

(一)估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日。

(二)估值方法

1.股票估值方法:

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;

(2)未上市股票的估值:

1)送股、转增股、配股和增发等方式发行的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值,该日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;

2)首次发行的股票,按成本价估值;

(3)配股权证,从配股除权日起到配股确认日止,若收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值;若收盘价等于或低于配股价,则估值为零;

(4)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)–(3)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)–(3)小项规定的方法对基金资产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,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(5)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

2.债券估值办法:

(1)证券交易所市场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,按最近交易日的收盘价估值;

(2) 证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值,估值日没有交易的,按最近交易日债券收盘净价估值;

(3)未上市债券按其成本价估值;

(4)在银行间债券市场交易的债券按其成本价估值;

(5)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)–(4)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)–(4)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券价格,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)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

3.权证估值办法:

(1)基金持有的权证,从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值;估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值;未上市交易的权证按公允价估值;

(2)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)小项规定的方法对基金资产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,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(3)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

4.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。

5.根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金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开放日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每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.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。月末、年中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

1.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。

2.差错处理

本基金合同的当事人应按照以下约定处理:

(1)差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人("受损方")按下述"差错处理原则"给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错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,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

(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,由差错责任方承担赔偿责任;若差错责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。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)差错的责任方对可能导致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("受损方"),则差错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差错责任方。

4)差错调整采用尽量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, 如果因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。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

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,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

(3)差错处理程序

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:

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责任方;

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;

3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

4)根据差错处理的方法,需要修改基金登记结算机构交易数据的,由基金登记结算机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

(4)基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

2)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、通报基金托管人并报中国证监会备案。

3)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,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。

4)基金管理人和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。

5)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。

(六)暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2.因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,已决定延迟估值;

4.如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;

5.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七)基金净值的确认

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工作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,由基金管理人对基金净值予以公布。

(八)特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(4)项、债券估值方法的第(5)项或权证估值方法的第(2)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。

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,本基金管理人和本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,本基金管理人和本基金托管人免除赔偿责任。但本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。

十五、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.基金财产拨划支付的银行费用;

4.基金合同生效后的信息披露费用;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

7.基金的证券交易费用;

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;

9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人、基金托管人在法律规定的范围内按照公允的市场价格按实列支,法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

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:

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

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,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

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:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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,支付日期顺延。

3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

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,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从基金财产中支付。

(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率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

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。

十六、基金的收益与分配

(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。

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;

2.基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;

3.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

4.在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益可进行分配,本基金收益每年最多分配6次,每年基金收益分配比例不低于当年可分配收益的90%;

5.本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人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;若投资人不选择,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.基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;

8.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、支付方式等内容。

(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体上公告并报中国证监会备案;

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分红资金的划付。

十七、基金的会计和审计

(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.会计制度执行国家有关的会计制度;

5.本基金独立建账、独立核算;

6.基金管理人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规定事项进行审计。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(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,并报中国证监会备案后可以更换。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体上公告。

十八、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。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、准确性和完整性。

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等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称"指定报刊")和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称"网站")等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

1.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;

2.对证券投资业绩进行预测;

3.违规承诺收益或者承担损失;

4.诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构;

5.登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字;

6.中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括:

(一)招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额集中申购的3日前,将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后,基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

(二)基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额集中申购的3日前, 将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

(三) 集中申购公告

基金管理人应当就集中申购的具体事宜编制集中申购公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

(四)基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

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,基金管理人将在每个开放日的次日,通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值;

3. 基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

(五)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上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(六)基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1.基金管理人应当在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券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结束之日起60日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上;

3.基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上;

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、半年度报告或者年度报告。

5.基金定期报告应按规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

(七)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,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案:

1.基金份额持有人大会的召开及决议;

2.终止基金合同;

3.转换基金运作方式;

4.更换基金管理人、基金托管人;

5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;

6.基金管理人股东及其出资比例发生变更;

7.基金集中申购期延长;

8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;

9.基金管理人的董事在一年内变更超过50%;

10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%;

11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;

12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;

13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;

14.重大关联交易事项;

15.基金收益分配事项;

16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

17.基金份额净值计价错误达基金份额净值0.5%;

18.基金改聘会计师事务所;

19.基金变更、增加或减少代销机构;

20.基金更换登记结算机构;

21.本基金开始办理申购、赎回;

22.本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;

23.本基金发生巨额赎回并延期支付;

24.本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;

25.本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;

26.基金推出新业务或服务;

27.中国证监会规定的其他事项。

(八)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

(十)中国证监会规定的其他信息

(十一)信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后,将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地供公众查阅。投资人在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(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)终止基金合同;

(2)转换基金运作方式;

(3)变更基金类别;

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;

(5)变更基金份额持有人大会程序;

(6)更换基金管理人、基金托管人;

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外;

(8)本基金与其他基金的合并;

(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时,可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:

(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;

(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、赎回费率或收费方式;

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(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;

(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;

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

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体公告。

(二)本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

1.基金份额持有人大会决定终止的;

2.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;

3.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;

4.中国证监会允许的其他情况。

(三)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(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。

(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。

(3)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。

2.基金财产清算程序

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。基金合同终止后,发布基金财产清算公告。基金财产清算程序主要包括:

(1)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;

(2)对基金财产进行清理和确认;

(3)对基金财产进行估价和变现;

(4)聘请律师事务所出具法律意见书;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;

(6)将基金财产清算结果报告中国证监会;

(7)参加与基金财产有关的民事诉讼;

(8)公布基金财产清算结果;

(9)对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

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。

4.基金财产按下列顺序清偿:

(1)支付清算费用;

(2)交纳所欠税款;

(3)清偿基金债务;

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

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须及时公告;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。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

二十、违约责任

(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,应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的,当事人可以免责:

1.不可抗力;

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;

3.基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

4.在基金运作过程中,基金管理人及基金托管人按照《基金法》的规定以及本基金合同的约定履行了相关职责,但由于第三方的原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(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。

(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。

(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。

(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。

二十一、争议的处理

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,任何一方均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。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

二十二、基金合同的效力

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。

(一) 本基金合同由《金鼎证券投资基金基金合同》修订而成。本基金合同经金鼎基金份额持有人大会决议授权,由基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或其授权代表签字,报中国证监会核准后,自金鼎基金终止上市之日起生效,原《金鼎证券投资基金基金合同》自同日起失效。

(二)本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、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约束力。

(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有两份。每份均具有同等的法律效力。

(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。

二十三、其他事项

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。

二十四、基金管理人和基金托管人签章

本页无正文,为《国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金基金合同》签字页。

基金合同当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日

基金管理人:国泰基金管理有限公司

(法定代表人或授权代表签字)

基金托管人:中国建设银行