（上接D3版）

第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、管理人 （一）管理人简况 住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层 法定代表人：熊国兵 设立日期：2012年5月9日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2011]1886号 注册资本：2亿元人民币 联系电话：021-22169999 （二）管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于： （3）依照《资产管理合同》收取基金管理费、业绩报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用； （11）在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请； （12）依照法律法规为基金计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利； （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为集合计划提供服务的外部机构； （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于： （2）办理资产管理合同变更申请； （12）保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露； （16）按规定保存集合计划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。 二、托管人 （一）托管人简况 住所：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心 批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号 注册资本：590.86亿元人民币 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[2002]75号 （二）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，托管人的权利包括但不限于： （4）根据相关市场规则，为集合计划开设资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，为集合计划办理证券、期货交易资金清算； （5）以本集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券托管账户； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于： （6）按规定开设集合计划财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，按照《资产管理合同》的约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜； （7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露； （8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格； （11）保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上； （12）建立并保存集合计划份额持有人名册； （21）执行生效的集合计划份额持有人大会的决定； 三、集合计划份额持有人 投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，投资者自依据基金合同购买取得基金份额，即成为本基金的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手面签章或签字为必要条件。 《资产管理合同》上手面签章或签字为基金合同另有约定，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于： （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层 法定代表人：刘刚 设立日期：2004年4月22日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42号 注册资本：人民币1.6亿元 联系电话：021-80262888 （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： （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； （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； （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计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外； （16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不少于法律法规的规定；	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 注册资本：466.79095亿人民币 批准设立机关和设立文号：国务院、国函[1992]7号 基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2002]75号 （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： （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）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； （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》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露； （8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格； （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15年以上； （12）建立并保存基金份额持有人名册； （21）执行生效的基金份额持有人大会的决定； 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，即成为本基金的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手面签章或签字为必要条件。 基金合同另有约定，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于： （9）执行生效的基金份额持有人大会的决定；	一、投资目标 本基金通过深度研究，捕捉宏观环境及政策趋势走向，主要投资于智造相关行业的股票，把握制造业产业升级过程中的投资机会。在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 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，包括国内依法发行或上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、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）。 基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%—95%，投资于港股通标的股票的比例不超过本基金所投资股票资产的50%，投资于本基金界定的智造主题相关行业股票及存托凭证的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当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；其中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变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。 三、投资策略 1、资产配置策略 本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性等市场指标，确定未来市场变动趋势；通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。 2、股票投资策略 （1）智造主题的界定 …… 细化到行业分类上，本基金投资的行业主要包括如下几类： （1）符合国家高端装备制造重点方向的行业，包括国防军工、机械设备； （2）符合新经济发展趋势、具有先进技术或者着力于突破关键技术、持续迭代升级的行业，包括医药生物、电子、计算机、通信、电力设备、新能源； （3）在传统工业中运用新兴技术、新材料或现代管理方式而向智能化转型的行业，包括汽车、有色金属、轻工制造、纺织服饰、家用电器、公用事业、化工、金属非金属新材料。 未来由于经济增长方式转变、产业结构升级、人口红利变化等因素，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，基金管理人按照监管部门要求在履行适当程序后，本基金视实际情况对上述界定进行调整和修订。 （3）港股通股票投资策略 本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将关注在港股市场上市、具有行业优势或行业趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求具有阿尔法收益率。本基金将从宏观经济、政策导向、市场流动性、估值水平、盈利预期、公司治理、品种选择、以风险管理为原则，以套利策略为辅助手段，以期获取长期稳定的收益。 本基金可根据投资策略需要或不同配置地的市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。 3、存托凭证的投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，通过定性分析和定量分析相结合的方式，对存托凭证的发行企业和所属行业进行深入研究判断，在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，精选出具备投资价值的存托凭证进行投资。 4、债券投资策略 （1）目标久期策略及凸性策略 在组合的久期选择方面，本基金将结合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策动向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金组合久期的合理范围；同时，通过凸性管理策略进一步分析债券的利率风险，对久期策略做出适当的补充和修正。 （2）收益率曲线策略 组合基于宏观经济研究和债券市场研究，结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型，对未来的收益率曲线移动进行情景分析，从而根据不同期限的收益率变动情况，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或者阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构。 （3）信用品种投资策略 1）市场整体信用利差曲线策略 本基金将从经济周期、市场利率和政策因素三方面考量信用利差曲线的整体走势。在经济周期向上阶段，企业盈利能力增强，经营现金流改善，则信用利差可能收窄，反之当经济周期不景气，企业的盈利能力减弱，信用利差扩大。同时本基金也将考虑市场资量、信用债供给以及流动性之间的相互关系，动态研究信用债市场的主要特征，为分析信用利差提供依据。另外，企业债因更长的信用期限，以及较高的票息，在市场利率下行的情况下，中在信用债市场的供给方面和需求方面，本基金将从供给和需求两方面分别评估政策对信用债市场的作用。 2）单个信用债信用分析策略 信用债的收益率水平及其变化很大程度上取决于其发行主体自身的信用水平，本基金将对不同信用类债券的信用等级进行评估，深入挖掘信用债的投资价值，增强本基金的收益。本基金还要通过对行业体经济增长、杠杆物值量、实约条款和公司治理情况等方面分析和评估单个信用债券的信用水平。 5、资产支持证券投资策略 资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、提前偿还风险和利率曲线等风险因素进行分析，采取包括久期、凸性、利率曲线等模型在内的多种定量分析工具，以期获取长期稳定的收益。 6、可转换债券投资策略 本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下，结合宏观经济、证券市场、股票特征等因素的基础上，选择具中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，选择投资价值较高的个券进行投资。 本基金将综合分析可交换债券的基本情况、发行人资质、转股标的等因素，对可交换债券的风险收益特征进行评估，在风险可控的前提下，选取具有超额收益的优质标的进行投资。同时，本基金还将密切跟踪可交换债券的信息变化情况和发行主体经营状况，合理调整可交换债券的投资风险。 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）本集合计划股票资产占集合计划资产的比例为60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；本集合计划投资于智造主题相关行业股票的比例不低于非现金集合计划资产的80%； （2）每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 （3）本人投出共表决意见或授权他人代表出共表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出共表决意见或授权他人代表出共表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会，重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。 （4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理股票授权委托证明书的，其所持有的基金份额应计入有效参会基金份额总数。 七、计票 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担派代表对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决议自生效之日起依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。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，必须特公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。 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，则相关基金份额持有人大会决议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召集和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、基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额计不低于权益登记日基金份额10%以上（含10%）； 2、现场开会的到会者在权益登记日代表基金份额不少于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、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）。 4、当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的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会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、现场开会出席基金份额持有人和代理人所持有表决权的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； 侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会和议事规则涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户持有人大会决议，同一主侧袋账户内同一类别的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。 侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本章节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用上文相关约定。 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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或更改的，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。	第十二部分 基金的投资	一、投资目标 通过深度研究，捕捉宏观环境及政策趋势走向，主要投资于智造相关行业的股票，把握制造业产业升级过程中的投资机会。在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 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，包括国内依法发行或上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、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）。 本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%；本集合计划投资于智造主题相关行业股票的比例不低于非现金集合计划资产的80%； （2）每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 （3）本人投出共表决意见或授权他人代表出共表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出共表决意见或授权他人代表出共表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会，重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。 （4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理股票授权委托证明书的，其所持有的基金份额应计入有效参会基金份额总数。 七、计票 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担派代表对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决议自生效之日起依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。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，必须特公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。 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，则相关基金份额持有人大会决议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召集和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、基金份额持有人投票的基金份额持有人所持有的基金份额不少于权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）； 2、现场开会的到会者在权益登记日代表基金份额不少于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、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）。 （3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出共表决意见或授权他人代表出共表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会，重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。 （4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理股票授权委托证明书的，其所持有的基金份额应计入有效参会基金份额总数。 七、计票 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担派代表对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决议自生效之日起依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。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，必须特公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。 九、本部分关于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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或更改的，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。	第十四部分 基金资产估值	一、估值日 本集合计划的估值日为本集合计划相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。 二、估值对象 集合计划所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 三、估值原则 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，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。 四、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对应的当日估值净价估值。 （4）对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价； （5）在交易所上市并以全价交易的债券以每日收盘价作为估值全价； （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： （2）首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值； （3）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值进行估值；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。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （2）首次公开发行未上市的股票，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，不包括特殊、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、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。 5、本基金投资国债期货合约，一般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。 6、本基金投资股指期货合约，一般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。 7、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。 8、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性，并需履行相关信息披露义务。 9、估值计算中涉及外币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为准：估值当日中国人民银行或其授权机构公布的外币对人民币汇率中间价为准。 根据《基金法》，管理人计算集合计划资产净值，托管人复核管理人计算的集合计划资产净值。集合计划净值信息计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。 10、本基金投资开托证券的估值核算，依据境内上市交易的股票进行。 11、当本基金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。 根据有关法律法规，涉及基金净值信息计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。 12、当本基金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。 根据有关法律法规，涉及基金净值信息计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。 13、基金管理人对估值方法的变更、估值错误的更正、暂停估值的情形、暂停基金份额申购、赎回或延迟支付赎回款项的情形、暂停基金份额申购、赎回或延迟支付赎回款项的情形、暂停基金份额申购、赎回或延迟支付赎回款项