**权证：**

一、基金可以持有在股权分置改革中被动获得的权证，并可以根据证券交易所的有关规定卖出该部分权证或行权。

二、基金可以主动投资于在股权分置改革中发行的权证。

三、基金管理人拟根据本通知第二条的规定运用基金财产投资权证的，应当遵照有关法律法规，符合基金合同的有关约定，并将权证投资方案报告中国证监会并公告。权证投资方案应当列明基金投资权证的比例限制、投资策略、信息披露方式、风险控制措施等，并充分揭示相关投资风险。

四、基金管理人运用基金财产进行权证投资，不得有下列情形：

（一）一只基金在任何交易日买入权证的总金额，超过上一交易日基金资产净值的千分之五。

（二）一只基金持有的全部权证，其市值超过基金资产净值的百分之三。

（三）同一基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，超过该权证的百分之十。

中国证监会另有规定的，不受前款第（一）、（二）、（三）项规定的比例限制。

**固有资本投资：**

　第八条 基金管理公司固有资金可以进行金融资产投资以及进行与经营资产管理业务相关的股权投资，其中持有现金、银行存款、国债、基金等高流动性资产的比例不得低于50%。

固有资金进行金融资产投资的，不得投资于上市交易的股票、期货及其他衍生品。

第九条 基金管理公司运用固有资金投资本公司管理的基金的，应当遵守基金合同、招募说明书等的约定，并遵守下列规定：

　　（一）持有基金份额的期限不少于6个月，但持有货币市场基金等现金管理工具基金或者公司出现风险事件确需赎回基金份额弥补资金缺口的不受此限，持有发起式基金份额的期限另有规定的从其规定；

　　（二）按照基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申购和赎回，不享有比其他投资人更优惠的费率，并不得进行盘后交易；

　　（三）认购基金份额的，在基金合同生效公告中载明所认购的基金份额、认购日期、适用费率等情况；

　　（四）申购、赎回或者买卖基金份额的，在基金季度报告中载明申购、赎回或者买卖基金的日期、金额、适用费率等情况。

　　第十一条 基金管理公司固有资金投资本公司及子公司管理的单个特定客户资产管理计划的份额与本公司及子公司员工投资的份额合计不得超过该计划总份额的50%。

　　第十三条 基金管理公司可以用固有资金为本公司管理的特定投资组合提供保本承诺或者资金垫付以及为子公司管理的特定投资组合提供担保，但保本承诺总额、资金垫付总额或者担保总额合计不得超过上一会计年度本公司经审计的**净资产**规模。

　第十九条 基金管理公司的净资产低于4000万元人民币，或者现金、银行存款、国债、基金等可运用的高流动性资产低于2000万元人民币且低于公司上一会计年度营业支出的，基金管理公司应当暂停继续运用固有资金进行投资，其固有资金应当主要用于日常经营管理活动。

**股指期货：**

第四条 股票型基金、混合型基金及保本基金可以按照本指引参与股指期货交易，债券型基金、货币市场基金不得参与股指期货交易。

第五条 基金参与股指期货交易，除中国证监会另有规定或批准的特殊基金品种外，应当遵守下列要求：

（一）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%。

（二）开放式基金在任何交易日日终，持有的买入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%。

封闭式基金、开放式指数基金（不含增强型）、交易型开放式指数基金（ETF）在任何交易日日终，持有的买入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100%。

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）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

（三）基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%。

基金管理公司应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

（四）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。

（五）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%。

（六）开放式基金（不含ETF）每个交易日日终在扣除股指期货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。

（七）封闭式基金、ETF每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

（八）保本基金参与股指期货交易不受上述第（一）项至第（七）项的限制，但应当符合基金合同约定的保本策略和投资目标，且每日所持期货合约及有价证券的最大可能损失不得超过基金净资产扣除用于保本部分资产后的余额。担保机构应当充分了解保本基金的股指期货交易策略和可能损失，并在担保协议中作出专门说明。

（九）法律法规、基金合同规定的其他比例限制。

因证券期货市场波动、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要求的，基金管理人应当在10个交易日之内调整完毕。

**公募开放式证券投资基金流动性风险管理规定**

第十五条同一基金管理人管理的全部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%；同一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。

第十六条单只开放式基金主动投资于流动性受限**资产**的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。

**证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法**

第二条　本办法所称证券投资基金行业高级管理人员（以下简称高级管理人员），是指基金管理公司的董事长、总经理、副总经理、督察长以及实际履行上述职务的其他人员，基金托管银行基金托管部门的总经理、副总经理以及实际履行上述职务的其他人员。

第三条　高级管理人员的选任或者改任，应当报经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）审核。

第五条　中国证监会依法对高级管理人员进行监督管理，制定高级管理人员、董事、基金经理等人员管理的具体规定。基金管理公司的董事和基金经理的任免，应当向中国证监会报告。

**关于基金从业人员投资证券投资基金有关事项的规定**

基金从业人员购买基金的，鼓励通过定期定额或者其他方式进行长期投资。基金从业人员持有基金份额的期限不得少于6个月，高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本公司管理的基金份额及基金经理持有本人管理的基金份额的期限不得少于1年，投资货币市场基金以及其他现金管理工具基金不受上述期限限制。

**关于发布和实施《基金经理注册登记规则》有关事项的通知**

七、关于非公募基金投资经理注册

公司聘任投资总监、特定客户资产管理投资经理、企业年金投资经理、社保基金投资经理等投资管理人员的，无需在聘任前注册。请各公司于《规则》实施后30日内向协会报送本通知第一条规定的基金经理（投资经理）基本情况登记表及公司投资经理总体情况表（见附件4），为上述现任投资管理人员办理登记手续。请各公司今后于每季度结束后5个工作日内向协会报送公司投资经理总体情况表及上述人员的变更情况，并报送新聘任投资管理人员的基本情况登记表。

**基金经理注册登记规则**

第七条 公司拟聘任基金经理的，应当在做出拟聘任基金经理决议之日起7个工作日内，向协会报送下列注册申请材料：

第八条 协会接收公司报送的注册申请材料后向中国证监会相关派出机构等机构征求意见，在10个工作日内审查完毕，并将审查结果以电子邮件或传真等方式告知公司。符合本规则规定条件的，注册为基金经理。

第九条 有下列情形之一的人员，不得注册为基金经理：

（一）不符合本规则第六条规定条件的；

（二）被监管机构采取市场禁入措施，尚处于市场禁入期内的；

（三）被监管机构采取重大**行政监管措施**未满2年的；

（四）违反投资管理人员基本行为规范及公司对投资管理人员的有关规定，对市场造成较大影响的；

（五）无特殊情况管理基金未满1年主动离职，且离职时间未满1年的；

（六）短期内频繁变换任职单位的；

（七）尚处于法律法规规定及劳动合同约定的竞业禁止期内的；

（八）违反协会自律规则被协会采取纪律处分未满2年的；

（九）按照协会有关规定，未通过证券从业人员执业年检的；

（十）最近1年接受合规培训和业务培训的时间少于中国证监会和协会要求的；

（十一）注册申请材料存在虚假信息、隐瞒重大事项的；

（十二）按照法律法规和协会的规定以及审慎性原则，不得注册为基金经理的其他情形。

第十条 公司应在对外公告聘任基金经理之日起2个工作日内向协会报送对外公告的信息。协会在收到公告信息后3个工作日内在其网站上公告。

第十二条 公司应当在做出变更基金经理决议或决定后3个工作日内向协会备案，报送以下备案材料：

第十三条 协会在收到备案材料后5个工作日内办理基金经理变更手续。

协会在收到变更申请后向中国证监会相关派出机构征求意见，并在自接受申请10个工作日内以电子邮件或传真等方式告知公司是否同意变更申请的意见，同意申请的办理基金经理变更手续。

第十六条 基金经理与公司解除劳动合同离职的，公司应当在做出拟解聘基金经理决议或决定之日起3个工作日内向协会办理注销手续，报送下列注销申请材料：

基金经理转任公司其他工作岗位的，按照本规则第三章的有关规定办理变更手续。如该基金经理2年内重新管理基金，无需重新注册，但仍需办理变更手续；超过2年没有再管理基金的，协会注销其基金经理注册。

第十七条 协会在收到公司报送的注销申请材料后向中国证监会相关派出机构征求意见，并在10个工作日内办理注销手续。

第十八条 公司解聘基金经理的，应当在对外公告之日起2个工作日内向协会报送对外公告的信息。协会在收到公告信息后3个工作日内在其网站上公告。