

# 长城积极增利债券型证券投资基金 招募说明书（更新）

（2012 年第 2 号）

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一二年十一月

长城积极增利债券型证券投资基金经2011年1月21日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】124号文批准发起设立。基金合同于2011年4月12日正式生效。

### 重要提示

（一）基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

（二）投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

（三）基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

（四）本招募说明书所载内容截止日为2012年10月11日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日（财务数据未经审计）。

（五）本招募说明书更新情况说明中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核。

## 目 录

一、绪言 .....	3
二、释义 .....	3
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	17
五、相关服务机构 .....	21
六、基金的募集与基金合同的生效 .....	36
七、基金份额的申购与赎回 .....	36
八、基金的投资管理 .....	45
九、基金的业绩 .....	54
十、基金的财产 .....	55
十一、基金资产的估值 .....	55
十二、基金的收益分配 .....	59
十三、基金的费用与税收 .....	61
十四、基金的会计与审计 .....	66
十五、基金的信息披露 .....	67
十六、风险揭示 .....	70
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	72
十八、基金合同的内容摘要 .....	74
十九、基金托管协议的内容摘要 .....	86
二十、对基金份额持有人的服务 .....	95
二十一、其他应披露的事项 .....	96
二十二、招募说明书的存放及查阅方式 .....	96
二十三、备查文件 .....	97

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售管理办法》”）等有关法律法规及《长城积极增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了长城积极增利债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指长城积极增利债券型证券投资基金
2. 基金管理人：指长城基金管理有限公司
3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《长城积极增利债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长城积极增利债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6. 招募说明书：指《长城积极增利债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7. 基金份额发售公告：指《长城积极增利债券型证券投资基金份额发售公告》
8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10. 《销售办法》：指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
14. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
15. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
16. 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
17. 机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
18. 合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
19. 投资者：指个人投资者、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者的合称
20. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者
21. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
22. 销售机构：指直销机构和代销机构
23. 直销机构：指长城基金管理有限公司

24. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
25. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
26. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、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
27. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为长城基金管理有限公司或接受长城基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构
28. 基金账户：指注册登记机构为投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
29. 基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户
30. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
31. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
32. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
33. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
34. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
35. T日：指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的工作日
36. T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
37. 开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
38. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
39. 《业务规则》：指《长城基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守
40. 认购：指在基金募集期内，投资者申请购买基金份额的行为
41. 申购：指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

42. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

43. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为

44. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

45. A 类基金份额：在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额

46. C 类基金份额：从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费用的基金份额

47. 定期定额投资计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

48. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

49. 元：指人民币元

50. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

51. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

52. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

54. 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

55. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

56. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行

本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人情况

1. 名称：长城基金管理有限公司
2. 住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
3. 办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
4. 法定代表人：杨光裕
5. 组织形式：有限责任公司
6. 设立日期：2001 年 12 月 27 日
7. 电话：0755-23982338                      传真：0755-23982328
8. 联系人：袁柳生
9. 管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金十六只基金

10. 客户服务电话：400-8868-666

11. 注册资本：1.5 亿元

12. 股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%



中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

## （二）基金管理人主要人员情况

### 1. 董事、监事及高管人员介绍

#### （1）董事

杨光裕先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任，长城证券有限责任公司副总裁，现任长城基金管理有限公司董事长。

何伟先生，中共党员，硕士研究生。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。现任长城证券有限责任公司总裁。

范小新先生，中共党员，经济学博士，高级经济师。1986年7月参加工作，历任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。现任长城证券有限责任公司董事会秘书兼纪委书记、党委委员。

梁宇峰先生，中共党员，复旦大学经济学博士。历任东方证券股份有限公司研究发展总部经理助理、办公室主任助理、研究所副所长，2006年4月至今任东方证券股份有限公司研究所所长。

姬宏俊先生，中共党员，研究生学历，工商管理硕士。历任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。现任中原信托有限公司副总裁。

陆妍女士，1991年毕业于天津理工学院管理信息系统专业，获工学学士学位，1997年毕业于天津大学管理学院，获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理、北方国际信托投资股份有限公司证券管理总部总经理，现任北方国际信托股份有限公司副总经理。

王连洲先生，山东人，1964年从山东财经学院财政金融专业本科毕业，分配中国人民银行总行印制管理局工作。1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办

公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员，是中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》起草工作的主要组织者和参与者，2000年退休。

谢志华先生，中共党员，经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院（现北京工商大学）副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘杉先生，经济学博士。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报财经新闻部主任，中国人民银行深圳分行金融日报社总编辑，中华工商时报社总编辑助理，现任中华工商时报社副总编辑，兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

鄢维民先生，经济学学士。历任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任，深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长，深圳市证券管理办公室公司审查处处长，招银证券公司副总经理。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。

熊科金先生，经济学硕士。历任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。2011年7月进入长城基金管理有限公司，现任公司董事、总经理。

## （2）监事

吴礼信先生，中共党员，会计师，中国注册会计师（非执业）。历任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券有限责任公司，任财务部总经理，现任长城证券有限责任公司财务总监，并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

王燕滨先生，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任内蒙银行学校教师、校团委书记、学生科科长、教研室主任，内蒙古证券公司发行部经理、上海业务部总经理、总经理助理、副总经理，海通证券天津、北京营业部总经理，北方信托业务二部总经理、公司总经理助理兼信托业务二部总经理。现任北方信托总经理助理兼资产管理部总经理。

张令先生，中共党员，研究生学历。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公

司资金财务管理总部总经理，现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。

孟凡君先生，中共党员，经济学学士，经济师。历任中国工商银行河南华信资金市场融资二部经理、总经理助理、中原信托投资有限公司开封证券营业部副经理、资产管理部经理，现任中原信托有限公司投资管理二部经理。

王燕女士，中共党员，江西财经大学会计学硕士。2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作。2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作，现任公司财务经理。

张静女士，中共党员，2005年毕业于南开大学，法学硕士。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员，2007年5月进入长城基金管理有限公司，现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。

### （3）高级管理人员

杨光裕先生，长城基金管理有限公司董事长，简历同上。

熊科金先生，长城基金管理有限公司董事、总经理，简历同上。

余骏先生，硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院，历任中国人民银行湖北省分行科室负责人，君安证券有限公司研究部宏观室负责人，长城证券有限责任公司营业部总经理，长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理，长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理和综合管理部总经理，长城基金管理有限公司副总经理兼市场开发部总经理，现任公司副总经理。

彭洪波先生，武汉大学（武汉测绘科技大学）工学学士，中南财经政法大学经济学硕士。曾就职于长城证券有限责任公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理，现任公司副总经理兼运行保障部总经理。

桑煜先生，中共党员，经济学学士。曾任职于中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理、综合管理部总经理、公司总经理助理，现任公司副总经理兼市场开发部总经理。

车君女士，中共党员，经济学硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。

现任公司督察长兼监察稽核部总经理。

## 2. 本基金基金经理简历

钟光正先生，经济学硕士。具有 8 年债券投资管理经历。曾就职于安徽安凯汽车股份有限公司、广发银行总行资金部、招商银行总行资金交易部。2009 年 11 月进入长城基金管理有限公司，曾任债券研究员，自 2010 年 2 月 24 日至 2011 年 10 月 18 日担任“长城货币市场证券投资基金”的基金经理，自 2010 年 2 月 24 日至 2011 年 11 月 13 日担任“长城稳健增利债券型证券投资基金”的基金经理，自 2011 年 4 月 12 日起任本基金的基金经理。自 2012 年 8 月 2 日起兼任“长城保本混合型证券投资基金”的基金经理。

## 3. 本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。

杨建华先生，投资决策委员会执行委员，公司总经理助理、公司投资总监兼基金管理部总经理。

杨毅平先生，投资决策委员会委员，公司首席策略分析师。

秦玲萍女士，投资决策委员会委员，公司研究部总经理。

4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

## （三）基金管理人的职责

### 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了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，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (8) 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、融券；
- (9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- (10) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- (11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (13) 依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、勤勉尽责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管理人的财产相互独立，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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 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；
- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (13) 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；
- (14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

- （15）按照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收益；
- （16）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；
- （17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- （18）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者实施其他法律行为；
- （19）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；
- （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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- （21）基金托管人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、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

#### （四）基金管理人承诺

##### 1. 基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

##### 2. 基金管理人的禁止性行为

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

#### （五）基金经理承诺

1. 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
2. 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
3. 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
4. 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### **（六）基金管理人的内部控制制度**

健全、完善的内部风险控制制度是规范公司行为，有效防范经营风险，实现公司持续、稳健发展的主要保证，也是公司经营管理水平的重要标志。为此，公司建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度。

##### **1. 风险控制的目标**

公司风险控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理实体。具体目标是：

- （1）确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行；
- （2）建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；
- （3）不断提高基金管理的效率和效益，在有效控制风险的前提下，努力实现基金份额持有人利益最大化；
- （4）努力将各种风险控制在规定的范围内，保障公司发展战略和经营目标的全面实施，维护公司股东的合法权益；
- （5）建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

##### **2. 建立风险控制制度的原则**

公司按照合法、合规、稳健的要求，制定明确的经营方针，建立合理的经营机制。在建立风险控制制度时应严格遵循以下原则：

- （1）全面性原则：风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；
- （2）审慎性原则：内部风险控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、

内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（3）独立性原则：公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行部门；风险控制委员会、合规审查委员会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查；

（4）有效性原则：风险控制制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行风险控制制度不能存在任何例外，公司任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力；

（5）适时性原则：内部风险控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

（6）防火墙原则：公司基金投资、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序。

### 3. 风险控制的主要内容

- （1）确立加强内部风险控制的指导思想，确定风险控制的目标和原则；
- （2）建立层次分明、权责明确的风险控制体系；
- （3）建立公司风险控制程序；
- （4）对公司内部风险进行全面、系统的评估，制定风险控制计划；
- （5）确定公司风险控制的路径和措施；
- （6）保障风险控制制度的持续性和有效性，制定可行的风险控制制度的评价和检查机制。

### 4. 风险控制体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构，并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系：

#### （1）一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险控制与审计委员会，负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。对公司内部控制制度的有效性进行评价，对公司经营管理和基金业务运作的合法合规性进行监督检查，协助董事会建立并有效维持公司内部控制系统，对公司经营中的风险进行研究、分析和评估，并提出风险防范措施和建议，保证公司的规范健康发展。风险控制与审计委员会的基本职能为：



- ①协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。
- ②审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。
- ③检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况，并出具评估意见或改正方案；
- ④定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报；
- ⑤检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见；
- ⑥评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险，检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性，并提出改进意见；
- ⑦检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序，与外部审计机构进行交流；
- ⑧对公司内部控制和风险管理工作进行考核；
- ⑨董事会安排的其他事项。

公司设督察长。督察长作为风险控制与审计委员会的执行机构，对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制与审计委员会的授权进行工作。

## （2）二级风险防范

二级风险防范是指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。

投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。其在风险控制中主要职责为：

- ①研究并确立公司的基金投资理念和投资方向；
- ②决定基金资产在现金、债券和股票中的分配比例；
- ③审核基金经理提出的投资组合方案，对其运作过程中的风险进行评估和控制；
- ④批准基金经理拟订的投资原则，对基金经理做出投资授权；
- ⑤对超出投资决策委员会执行委员及基金经理权限的投资项目作出决定。

监察稽核部在总经理的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。其在风险控制中主要职责是：

- ①根据各项风险的产生环节，和相关的业务部门一起，共同制定对风险的事前防范和事后审查方案；
- ②就各部门内部风险控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告及建议职能；

- ③调查公司内部的违规案件，协助监管机构处理相关事宜；
- ④对基金运作和公司内部管理进行日常监督与稽核，并向总经理汇报。

(3) 三级风险防范

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：

- ①一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；
- ②相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各部门和岗位分别在自己的授权范围内承担各自的职责，将风险控制的最小范围内。

5. 基金管理人关于内部合规控制声明书

- (1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

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：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：010-67595003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954

年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股（包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股）。

截至 2011 年 9 月 30 日，中国建设银行资产总额 117,723.30 亿元，较上年末增长 8.90%。截至 2011 年 9 月 30 日止九个月，中国建设银行实现净利润 1,392.07 亿元，较上年同期增长 25.82%。年化平均资产回报率为 1.64%，年化加权平均净资产收益率为 24.82%。利息净收入 2,230.10 亿元，较上年同期增长 22.41%。净利差为 2.56%，净利息收益率为 2.68%，分别较上年同期提高 0.21 和 0.23 个百分点。手续费及佣金净收入 687.92 亿元，较上年同期增长 41.31%。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球 13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行 33 家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011 年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的 50 多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011 年“世界银行品牌 500 强”中位列第 10，较去年上升 3 位；在美国《财富》世界 500 强中排名第 108 位，较去年上升 8 位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有

员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

## （四）基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## 2. 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

## 3. 内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2. 监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

名称：长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：杨光裕

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

#### 2. 代销机构

##### （1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：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：王洪章

联系人：张静

电话：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

##### （2）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王隽

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

##### （3）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人：蒋超良

联系人：吴双

电话：010-85108227

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

网站：www.abchina.com

（4） 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

联系人：宋亚平

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

（5） 招商银行股份有限公司

地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网站：www.cmbchina.com

（6） 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：黄滨

电话：010-85237046

传真：010-85238680

网址：www.hxb.com.cn

（7） 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫竹冰

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

（8）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：010-57092615

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（9）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

联系人：丰靖

电话：010-65550827

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

公司网站：<http://bank.ecitic.com/>

（10）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：徐伟

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

客户服务电话：95528

（11）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一



联系人：芮蕊

电话：0755-25879756

传真：0755-25879196

网址：<http://bank.pingan.com/>

客户服务电话：95511-3

（12）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：宁黎明

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

联系人：张萍

联系电话：021-68475888

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

（13）深圳农村商业银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区 3038 号合作金融大厦

办公地址：深圳市罗湖区 3038 号合作金融大厦

法定代表人：李伟

联系人：宋永成

联系电话：0755-25188266

客服电话：4001961200

公司网站：[www.961200.net](http://www.961200.net)

（14）东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路 2 号

办公地址：东莞市南城路 2 号

法定代表人：何沛良

联系人：何茂才

电话：0769-23394102

传真：0769-22320896

客服电话：0769-961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

（15）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

网站：www.csc108.com

客户服务电话：4008888108

（16）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

（17）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

客户服务电话：4008888666

（18）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：www.cgws.com

（19）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

电话：010-66568047

联系人：田徽

网站：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：4008-888-888

（20）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82960223

传真：0755-82943237

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

（21）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

客户服务电话：4008816168

网址：www.pingan.com

（22）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86868681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网站：www.avicsec.com

（23）华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

法定代表人：张慎修

联系人：杨玲

电话：0755-83025430

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

（24）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网站：www.guosen.com.cn

（25）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

联系电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-6515-988

网址：www.bhzq.com

（26）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

客户服务热线：95562

网站：www.xyzq.com.cn

（27）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（28）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

法定代表人：曾小普

联系电话：0791-86281305

联系人：陈明

客户服务电话：4008222111

网站：[www.gsstock.com](http://www.gsstock.com)

（29）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：汪建熙

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网站：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

（30）广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人：刘东

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

客户服务电话：020-961303

网站：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

（31）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

联系人：方文

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：[www.cscoc.com.cn](http://www.cscoc.com.cn)

（32）齐鲁证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

（33）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

客户咨询电话：0532-96577

（34）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

客服热线：4008001001

（35）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-68816000

传真：021-68815009

联系人：李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（36）东海证券有限责任公司

注册地址：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼

办公地址：上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

联系人：邵一明

客服电话：0519-8166222、0379-64912266

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（37）恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：张同亮

客服电话：0471-4961259

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

（38）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-83290845

联系人：肖亦玲

客户服务电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（39）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2257012

传真：0551—2272100

联系人：祝丽萍

客服电话：全国统一热线 4008888777，安徽省内热线 96888

网址：www.gyzq.com.cn

（40）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及

第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

（41）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

客服热线：029—87419999

联系人：崔轶梅

网址：www.westsecu.com.cn

（42）长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

（43）日信证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号



法定代表人：孔佑杰

联系人：陈韦杉、朱晓光

联系电话：010-88086830-730、010-88086830-737

传真：010-66412537

网址：www.rxzq.com.cn

（44）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号 27 层

法定代表人：陈林

联系人：袁月

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

（45）民生证券有限责任公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：余政

电话：010-85127622

传真：010-85127917

联系人：赵明

客户服务电话：4006198888

网址：www.msza.com

（46）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

网站：www.cs.ecitic.com

（47）天源证券经纪有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦 6 楼

法定代表人：林小明

联系人：王斌

联系电话：0755-33331188-8801

客服电话：4006543218

公司网站：[www.tyzq.com.cn](http://www.tyzq.com.cn)

（48）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

法定代表人：丁之锁

联系人：梁宇

联系电话：010-58568007

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118

公司网站：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

（49）国海证券股份有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

电话：0755-83702462

传真：0755-83700205

法定代表人：张雅锋

联系人：张亦潇

客服电话：95563

公司网站：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

（50）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

传真：0571-86065161

客户服务电话：0571-96598

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

（51）民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：赵明

客户服务热线：40088-95618

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

（52）大同证券经纪有限责任公司

注册地址：山西省大同市大北街 13 号

办公地址：山西省太原市长治路 111 号世贸中心 A 座 13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务热线：400-7121-212

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

（53）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客服电话：400-8888-993

公司网站：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

（54）信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（55）深圳众禄基金销售有限公司

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25 层

法定代表人：薛峰

联系人：张玉静

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（56）杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周嫵旻

联系电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

基金管理人可根据业务发展需要，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## （二）基金注册登记机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：杨光裕

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍

客户服务电话：400-8868-666

## （三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京国枫凯文律师事务所

注册地址：北京市西城区金融大街一号 A 座 12 层

负责人：张利国

经办律师：刘洪蛟、胡婷

电话：0755-23993388

传真：0755-86186205

联系人：胡婷

## （四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所

注册地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼(即东三办公楼) 16 层

法定代表人：葛明

经办注册会计师：梁成杰、周刚

联系人：李妍明

电话：010-58153000

传真：010-85188298

## 六、基金的募集与基金合同的生效

### （一）基金的募集

本基金经中国证券监督管理委员会 2011 年 1 月 21 日证监许可【2011】124 号文核准，由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及基金合同募集，募集期自 2011 年 3 月 10 日至 2011 年 4 月 8 日，共募集 1,678,311,238.01 份基金份额，募集户数为 16,484 户。

### （二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2011 年 4 月 12 日正式生效。

## 七、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金具体的销售机构情况详见本基金的基金份额发售公告。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。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，投资者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公告暂停申购、赎回时除外。

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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2. 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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体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

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3. 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
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。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下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体上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1. 申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者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，投资者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。

#### 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的当天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日后(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。基金销售机构对申购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。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的任何损失由投资者自行承担。

#### 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。

投资者赎回申请成功后，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。

### （五）申购和赎回的金额

1. 每笔申购申请不得低于 1000 元(含申购费)。本基金定期定额投资不受此最低申购金额限制。

2. 基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不受限制。投资者每个交易账户不设最低基金份额余额限制。

3. 基金管理人可以根据市场情况，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。基金管理人必须在调整前依照《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。

#### （六）申购和赎回的价格、费用及其用途

1. 由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

$T$  日某类别基金份额净值 =  $T$  日该类别基金资产净值 /  $T$  日发行在外的该类别基金份额总数。

本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 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3. 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准进行计算并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

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。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

#### （七）申购费用与赎回费用

##### 1. 申购费用

本基金申购采用“金额申购”的方式。本基金 A 类基金份额在申购时收取基金前端申购费用；C 类基金份额不收取申购费用。本基金 A 类基金份额的最高申购费率不超过 5%，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的申购费率如下表：

<b>A 类基金份额</b>
----------------

申购金额（M，含申购费）	前端申购费率
M < 50 万	0.80%
50 万 ≤ M < 200 万	0.50%
200 万 ≤ M < 500 万	0.30%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

C 类基金份额	
申购费率	0%

注：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提销售服务费，销售服务费年费率为 0.4%。

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

## 2. 赎回费用

本基金 A 类基金份额的最高赎回费率不超过 5%，赎回费率见下表：

A 类基金份额	
持有年限（Y）	赎回费率
Y < 1 年	0.10%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.05%
Y ≥ 2 年	0%

注：上表中，1 年按 365 天计算。

C 类基金份额	
赎回费率	持有期限在 30 日以内的基金份额，赎回费率为 0.10%；持有期限超过 30 日（含 30 日）的基金份额，不收取赎回费用。

注：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提销售服务费，销售服务费年费率为 0.4%。

赎回费总额扣除用于支付注册登记费和必要的手续费后余额计入基金财产，赎回费计入基金财产的比例不低于赎回费总额的 25%。

3. 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日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定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人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。

## （八）申购份额与赎回金额的计算



## 1. 申购份额的计算

（1）申购 A 类基金份额，基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，申购份额的计算公式为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率})$$

（注：对于 500 万(含)以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费用）

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类基金份额净值}$$

例：某投资者投资 20000 元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.100 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 20000 / (1 + 0.80\%) = 19841.27 \text{ 元}$$

$$\text{前端申购费用} = 20000 - 19841.27 = 158.73 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 19841.27 / 1.100 = 18037.52 \text{ 份}$$

即：投资者投资 20000 元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.100 元，则其可得到 18037.52 份基金份额。

（2）申购 C 类基金份额，不收取申购费用，申购份额的计算公式为：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类基金份额净值}$$

例：某投资者投资 20000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.100 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 20000 / 1.100 = 18181.82 \text{ 份}$$

即：投资者投资 20000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.100 元，则其可得到 18181.82 份基金份额。

## 2. 赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日（T 日）的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

（1）本基金 A 类基金份额赎回金额的计算：

例：某投资者赎回本基金 A 类基金份额 10000 份，持有时间为 50 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.200 = 12000 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12000 \times 0.10\% = 12 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12000 - 12.00 = 11988 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 10000 份，持有时间为 50 天，假设赎回当日 A 类

基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为 11988 元。

（2）本基金 C 类基金份额赎回金额的计算：

例：某投资者赎回本基金 C 类基金份额 10000 份，持有时间为 30 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 = 10000 × 1.200 = 12000 元

净赎回金额 = 12000 元

即：投资者赎回本基金 C 类基金份额 10000 份，持有时间为 30 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为 12000 元。

### （九）基金份额净值计算

由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

T 日某类基金份额净值 = T 日该类基金份额的基金资产净值 / T 日发售在外的该类基金份额总数

基金份额净值单位为元，计算结果保留在小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。由此产生的误差在基金财产中列支。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并不迟于 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

### （十）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

### （十一）拒绝或暂停申购的情形

**发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：**

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
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。

6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购的，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人，基金管理人，基金托管人、基金注册登记机构及基金销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。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，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登公告。

### （十二）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

**发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：**

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
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. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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，并在指定媒体上公告。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。

### （十三）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

#### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（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础计算赎回金额，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）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，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，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，同时在指定媒体上刊登公告。

## （十四）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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体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 日在指定媒体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 日在指定媒体上连续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。

## （十五）基金的转换

基金转换是指基金份额持有人可按规定申请将所持有的本基金份额转换为本基金管理人管理并在同一注册登记人登记的其它开放式基金份额。基金转换收取相应费用，费用详情请参见本招募说明书第十三部分“基金的费用与税收”。

基金管理人已开通本基金与长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证

券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金之间的基金转换业务。

#### （十六）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构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。

#### （十七）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

#### （十八）定期定额投资

“定期定额投资”是指投资者可通过本基金的销售机构提交申请，约定每月扣款时间、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

本基金管理人已通过建设银行、招商银行、农业银行、中国银行、华夏银行、上海银行、中信银行、北京银行、民生银行、浦发银行、深圳农村商业银行、东莞农村商业银行、中信建投证券、国泰君安证券、申银万国证券、海通证券、长城证券、银河证券、招商证券、兴业证券、国信证券、国盛证券、华泰证券、平安证券、齐鲁证券、广州证券、世纪证券、安信证券、长江证券、中信证券、恒泰证券、中信万通证券、日信证券、华宝证券、民生证券、天源证券、华融证券、中投证券、华西证券、国海证券、中信证券（浙江）、信达证券、深圳众禄基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司等机构为投资者提供本基金定期定额投资的服务，详情请查阅相关公告。

### （十九）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。

## 八、基金的投资管理

### （一）投资目标

本基金将在控制组合风险和保持资产流动性的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。

### （二）投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票（包括中小板与创业板）、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具及其衍生工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转债所产生的权证等，以及法律法规或监管机构允许基金投资的其他权益类金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产投资比例不低于基金资产净值的 80%，其中非政策性金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券等信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债除外）的投资比例不低于基金资产净值的 30%；股票等权益类资产投资比例不高于基金资产净值的 20%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

### （三）投资策略

#### 1. 大类资产配置策略

本基金为债券型基金，债券等固定收益类资产投资比例不低于基金资产净值的 80%，股票等权益类资产投资比例不高于基金资产净值的 20%。本基金将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置，主要通过对宏观经济运行周期、财政政策、货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响资本市场的重要因素进行研究和预测，分析债券市场、债券品种、股票市场、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资

比例，以控制系统性风险。本基金将择机利用债券回购交易放大组合债券资产杠杆，在严格控制信用风险、流动性风险的基础上增强基金整体收益。

## 2. 固定收益类资产投资策略

本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。

本基金将在科学的大类资产配置及券种配置、完整的信用评价系统和严格的投资风险管理基础上获取基准收益，同时争取获得超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。本基金投资组合中固定收益类资产的超额收益主要通过以下几种策略实现：

### （1）久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。本基金的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标包括 GDP、CPI、PPI、固定资产投资、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量、新增贷款、新增存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将用于估计央行货币政策，以考察央行调整利率、存款准备金率，进行公开市场操作和窗口指导等操作对市场利率的影响程度。当预测利率和收益率水平上升时，建立较短平均久期组合或缩短现有固定收益类资产组合的平均久期；当预测利率和收益率水平下降时，建立较长平均久期组合或增加现有固定收益类资产组合的平均久期。本基金将在对市场利率变动进行充分分析的基础上，选择建立和调整最优久期固定收益类资产组合。

### （2）收益率曲线策略

本基金将在确定固定收益类资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

### （3）个券选择策略

利率产品和信用产品是债券市场构成的两个方面，为了捕捉这两类债券品种在不同市场环境可能出现的不同投资机会，突出基金管理人对于信用产品的整体配置能力和个券选择能力，本基金对于非政策性金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券等信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债除外）的投资比例不低于基金资产净值的30%。

在对利率产品和信用产品的资产配置上，本基金将综合对宏观周期、利率市场、行业基本面和企业基本面等方面的分析结果，考察信用产品相对利率产品的信用溢价，结合市场情绪，动态调整信用产品的配置比例，获取超越业绩基准的超额收益。具体在个券选择

方面，本基金将在信用风险管理基础上重点关注：预期信用评级上升的个券、具有某些特殊优势条款的个券、估值合理的个券、信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券、经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。本基金将通过对个券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。

#### （4）把握市场低效或失效状况下的交易机会

在市场低效或失效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对固定收益类资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。

##### 1) 新券发行溢价策略

在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。

##### 2) 信用利差策略

不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，将会出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。

##### 3) 套利策略

套利策略包括跨市场套利和跨期限套利。跨市场套利是指利用同一只固定收益类投资工具在不同市场（主要是银行间市场与交易所市场）的交易价差进行套利，从而提高固定收益类资产组合的投资收益。跨期限套利是指当短期回购利率低于长期回购利率时，可通过短期融资、长期融券实现跨期限套利。

#### （5）可转换债券投资策略

当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。

#### （6）债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求固定收益类资产的超额收益。

### 3. 权益类资产投资策略

本基金将以不高于基金资产净值 20% 的基金资产适度参与权益类资产投资。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转债所产生的权证等，以及法律法规或监管机构允许投资的其他权益类金融工具。

#### （1）新股申购策略



本基金将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。本基金组合的新股申购（含增发新股）策略主要是从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平，预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。

#### （2）权证投资策略

本基金不直接从二级市场买入权证，但可持有因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转换债券所产生的权证。本基金的权证投资策略主要是深入分析权证标的证券基本面，结合期权定价模型确定权证的投资价值。本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

如法律法规或监管机构今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。

### （四）投资决策依据及程序

#### 1. 决策依据

- （1）国家有关法律、法规以及《基金合同》等的有关规定。
- （2）《长城基金管理有限公司章程》的有关规定。
- （3）《长城基金管理有限公司投资管理制度》的有关规定。
- （4）《长城基金管理有限公司固定收益投资管理办法》的有关规定。

#### 2. 投资决策程序

（1）固定收益小组定期对宏观经济、投资策略、投资品种等提出分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供投资决策依据；对于可能对证券市场造成重大影响的突发事件，及时提出评估意见及决策建议。

（2）固定收益小组负责建立和维护公司固定收益券种库，提供各券种的基本面情况及投资要点分析。

（3）基金经理在对经济形势和市场运作态势进行分析后，在券种库的基础上拟定下一阶段基金投资持仓比例，明确投资组合的平均久期，在“既定久期风险调整后收益率最大化”的原则下，对个券基本面进行分析，最终确定重点持券券种，做出《资产配置提案》和重点券种投资方案，报投资决策委员会讨论。

（4）投资决策委员会在基金经理上报的资产配置提案的基础上，讨论并确定下一阶段的资产配置和重点券种投资决定，会议决定以书面形式下达给基金经理。

（5）根据投资决策委员会确定的资产配置决议和重点券种投资决定，基金经理负责在固定收益券种库中选择拟投资的券种，并制定投资组合方案。

（6）基金经理在信用类固定收益资产投资前，固定收益研究员需按照《长城基金管理有限公司固定收益投资管理办法》的规定对债券进行信用风险评价，符合信用标准的债券方可进行投资。

（7）在基金经理权限内的投资，由基金经理自主实施；超过基金经理权限的，根据规定须报投资决策委员会执行委员或投资决策委员会批准的，须经批准后实施。

### （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富指数

中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制和维护。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券，综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。

选择中债综合财富指数作为本基金的业绩比较基准，体现了基金产品本身的投资特征与目标客户群的风险收益偏好，且该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

### （六）风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为中低风险、中低收益的基金产品。

### （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）债券等固定收益类资产投资比例不低于基金资产净值的 80%，其中非政策性金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券等信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债除外）的投资比例不低于基金资产净值的 30%，股票等权益类资产投资比例不高于基金资产净值的 20%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

（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，不得超过该证券的 10%；

（4）本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（5）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%；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%；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%；

（6）本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的比例不得超过基金资产净值的 40%；

（7）本基金应投资于信用评级为 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三个月内予以全部卖出；

（8）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%；

（9）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发行规模的 10%；

（10）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%；

（11）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的比例，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（12）本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

（13）法律法规及中国证监会规定的其它比例限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。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。

## 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、中国证监会及《基金合同》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，则本基金投资由基金管理人在履行适当程序后不再受相关限制。

**（八）基金管理人代表基金行使股东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权利，保护基金份额持有人的利益；
2. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3. 有利于基金财产的安全与增值；
4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

**（九）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）投资组合报告**

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年11月1日复核了本基金招募说明书更新中的投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2012年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

**1、报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,370,190.00	0.62
	其中：股票	5,370,190.00	0.62
2	固定收益投资	712,556,612.00	82.62
	其中：债券	712,556,612.00	82.62
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	11,000,136.50	1.28
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	119,096,393.36	13.81
6	其他资产	14,478,967.67	1.68
7	合计	862,502,299.53	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,729,630.00	0.23
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	350,200.00	0.05
C5	电子	11,080.00	0.00
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,368,350.00	0.18
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,334,710.00	0.31
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	25,950.00	0.00
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	1,237,600.00	0.16
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	42,300.00	0.01
M	综合类	-	-
	合计	5,370,190.00	0.71

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002620	瑞和股份	90,000	2,312,100.00	0.31
2	000651	格力电器	64,000	1,334,400.00	0.18
3	601555	东吴证券	140,000	1,237,600.00	0.16
4	002648	卫星石化	20,000	350,200.00	0.05
5	601929	吉视传媒	5,000	42,300.00	0.01
6	002663	普邦园林	500	22,610.00	0.00
7	300306	远方光电	500	20,500.00	0.00
8	300302	同有科技	500	14,435.00	0.00
9	300307	慈星股份	500	13,450.00	0.00
10	300297	蓝盾股份	500	11,515.00	0.00

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	127,677,030.80	16.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	540,578,444.70	71.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,269,000.00	1.36
7	可转债	34,032,136.50	4.50
8	其他	-	-
9	合计	712,556,612.00	94.21

**5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	636,230	68,051,160.80	9.00
2	1280052	12 伊旗城投债	500,000	52,920,000.00	7.00
3	122840	11 临汾债	500,010	51,511,030.20	6.81
4	1180106	11 准国资债	500,000	51,275,000.00	6.78
5	1080137	10 句容福地债	500,000	49,770,000.00	6.58

**6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**8、投资组合报告附注**

（1）本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

（2）基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,851,905.39
5	应收申购款	627,062.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	14,478,967.67
---	----	---------------

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	15,013,372.50	1.99
2	110015	石化转债	14,986,500.00	1.98

注：本基金本报告期末持有的工行转债（113002）处于转股期，转股期为 2011-03-01 至 2016-08-31；

本基金本报告期末持有的石化转债（110015）处于转股期，转股期为 2011-08-24 至 2017-02-23。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 九、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较（截止 2012 年 6 月 30 日）

长城积极增利债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日	-4.00%	0.17%	4.50%	0.09%	-8.50%	0.08%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	9.38%	0.18%	3.00%	0.07%	6.38%	0.11%
自基金合同生效日起至今	5.00%	0.18%	7.64%	0.08%	-2.64%	0.10%

长城积极增利债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日	-4.30%	0.17%	4.50%	0.09%	-8.80%	0.08%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	9.20%	0.18%	3.00%	0.07%	6.20%	0.11%
自基金合同生效日起至今	4.50%	0.18%	7.64%	0.08%	-3.14%	0.10%

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 十、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、基金销售机构和注册登记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。

## 十一、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. 证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（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，确定公允价格。

（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，确定公允价格；

（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，按最近交易日债券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。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，确定公允价格；

（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）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后，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. 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。

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

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0.001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. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个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

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. 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、或注册登记机构、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当事人（“受损方”）的直接损失按下述“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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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直接损失。

(7) 按法律法规规定的其它原则处理差错。

### 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。

### 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0.25%时，基金管理人应当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。

(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；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；
4. 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。

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，基金管理人和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。

## **十二、基金的收益分配**

### **(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）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

2. 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除权后的单位净值自动转为基金份额；

3. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的25%；

4. 若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权后的单位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. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；

7. 基金收益分配后每一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；

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收益分配基准日以及该日的可供分配利润、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。

### 十三、基金的费用与税收

#### （一）与基金运作有关的费用

##### 1. 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) 销售服务费：本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- (4) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (5) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 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。

##### 3. 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0.65%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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5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0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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5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) 销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。

在通常情况下，本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

基金销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

基金销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

(4) 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。

(二) 与基金销售有关的费用

1. 申购费用

(1) 申购费率

本基金申购采用“金额申购”的方式。本基金A类基金份额在申购时收取基金前端申购费用；C类基金份额不收取申购费用。本基金A类基金份额的最高申购费率不超过5%，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金的申购费率如下表：

A类基金份额	
申购金额（M，含申购费）	前端申购费率
M < 50 万	0.80%
50 万 ≤ M < 200 万	0.50%
200 万 ≤ M < 500 万	0.30%
M ≥ 500 万元	1000 元/笔

C类基金份额	
申购费率	0%

注：本基金从C类基金份额的基金财产中计提销售服务费，销售服务费年费率为0.4%。

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项

费用，不列入基金财产。

(2) 申购份额的计算

① 申购 A 类基金份额，基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，申购份额的计算公式为：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率})$$

（注：对于 500 万(含)以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费用）

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类基金份额净值}$$

例：某投资者投资 20000 元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.100 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 20000 / (1 + 0.80\%) = 19841.27 \text{ 元}$$

$$\text{前端申购费用} = 20000 - 19841.27 = 158.73 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 19841.27 / 1.100 = 18037.52 \text{ 份}$$

即：投资者投资 20000 元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.100 元，则其可得到 18037.52 份基金份额。

② 申购 C 类基金份额，不收取申购费用，申购份额的计算公式为：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类基金份额净值}$$

例：某投资者投资 20000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.100 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 20000 / 1.100 = 18181.82 \text{ 份}$$

即：投资者投资 20000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.100 元，则其可得到 18181.82 份基金份额。

2. 赎回费用

(1) 赎回费率

本基金 A 类基金份额的最高赎回费率不超过 5%，赎回费率见下表：

A 类基金份额	
持有年限 (Y)	赎回费率
Y < 1 年	0.10%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.05%
Y ≥ 2 年	0%

注：上表中，1 年按 365 天计算。

C 类基金份额
---------



赎回费率	持有期限在 30 日以内的基金份额，赎回费率为 0.10%；持有期限超过 30 日（含 30 日）的基金份额，不收取赎回费用。
------	---

注：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提销售服务费，销售服务费年费率为 0.4%。

赎回费总额扣除用于支付注册登记费和必要的手续费后余额计入基金财产，赎回费计入基金财产的比例不低于赎回费总额的25%。

### (2) 赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日（T 日）的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

#### ① 本基金 A 类基金份额赎回金额的计算：

例：某投资者赎回本基金 A 类基金份额 10000 份，持有时间为 50 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 = 10000 × 1.200 = 12000 元

赎回费用 = 12000 × 0.10% = 12 元

净赎回金额 = 12000 - 12.00 = 11988 元

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 10000 份，持有时间为 50 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为 11988 元。

#### ② 本基金 C 类基金份额赎回金额的计算：

例：某投资者赎回本基金 C 类基金份额 10000 份，持有时间为 30 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 = 10000 × 1.200 = 12000 元

净赎回金额 = 12000 元

即：投资者赎回本基金 C 类基金份额 10000 份，持有时间为 30 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为 12000 元。

### 3. 转换费用

(1) 基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

#### ① 如转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额=转出金额-转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率-转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差

转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差

例：某投资者持有本基金A类基金份额10万份，持有期为100天，决定转换为长城久泰沪深300指数证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金A类基金份额）份额净值是1.185元，转入基金（长城久泰沪深300指数证券投资基金）份额净值是1.5800元，转出基金对应赎回费率为0.1%，申购补差费率为0.7%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.185=118,500元

转出基金赎回费=118,500×0.1%=118.50元

转入总金额=118,500-118.50=118,381.50元

转入基金申购费补差=118,381.50-118,381.50/(1+0.7%)=822.91元

转入净金额=118,381.50-822.91=117,558.59元

转入份额=117,558.59/1.58=74,404.17份

基金转换费=118.50+822.91=941.41元

②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

基金转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

例：某投资者持有长城久泰沪深300指数证券投资基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为本基金A类基金份额，假设转换当日转出基金（长城久泰沪深300指数证券投资基金）份额净值是1.5800元，转入基金（本基金A类基金份额）份额净值是1.185元，转出基金对应赎回费率为0.5%，申购补差费率为0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.58=158,000元

转出基金赎回费=158,000×0.5%=790元

转入总金额=158,000-790=157,210元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=157,210-0=157,210元

转入份额=157,210/1.185=132,666.66份

基金转换费=158,000×0.5%=790元

(2)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金)，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金

申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为0。

(3) 转出基金赎回费的25%计入转出基金资产。

(4) 计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

### （三）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。

（四）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、基金托管费率和销售服务费率。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。调低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。

### （五）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。

## 十四、基金的会计与审计

### （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。

## 十五、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发售的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发售的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）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。

### （四）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效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说明基金募集情况。

### （五）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（或自然日）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（或自然日）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。

### （六）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。

### （七）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. 基金定期报告应当按有关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。

### （八）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. 基金募集期延长；
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. 基金更换注册登记机构；
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. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### （九）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。

（十）基金份额持有人大会决议

（十一）中国证监会规定的其他信息

（十二）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印件或复印件。

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。

## 十六、风险揭示

本基金为债券基金，不参与股票二级市场投资，但将适度参与新股申购或增发新股等权益类投资。本基金以不低于80%的基金资产投资于固定收益类金融工具，不高于20%的基金资产投资于权益类金融工具。本基金面临的投资风险主要包括以下几个：

### （一）市场风险

广义的市场风险指与利率、股票价格、商品价格等相关的风险，主要与不同市场的供需情况紧密联系。其中，利率风险是本基金面临的最大的市场风险。利率风险主要是指由宏观经济形势、货币财政政策以及债券市场资金供求关系的变化所带来的市场利率水平的波动，并因此产生的投资风险。市场利率水平与债券市场价格呈负相关关系。当市场利率水平上升时，债券的市场价格下跌，将进一步影响到基金资产净值。本基金不参与股票二级市场投资，但将适度参与新股申购或增发新股等权益类投资。本基金所投资新股价格波动将对基金收益率产生影响。

### （二）信用风险

信用风险指由于交易对手或债务人无法按照约定交割资产而导致基金资产损失的风险，主要指违约风险。本基金的信用风险分析主要针对债券资产，具体包括以下几个方面：

1. 债券发行人出现违约，无法支付到期本息引起的损失。
2. 债券发行人信用评级下降导致的个券价格下跌损失。
3. 交易对手出现违约或违规投资操作而引起的损失。

### （三）流动性风险

流动性风险指金融资产变现的难易程度。一些情况下，市场无法有效执行交易头寸需要，将使得金融资产无法在价格平稳变动的基础上被购入或者卖出，极端情形下市场上可能缺少交易对手。本基金面临的流动性风险来自两个方面：

1. 大额赎回：本基金是开放式基金，有发生集中大额赎回的可能性。集中大额赎回可能导致基金资产变现难度加剧，从而产生流动性风险。本基金规定非政策性金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券等信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债除外）的投资比例不低于基金资产净值的30%。信用产品的发行规模和交易活跃度弱于利率产品，在出现极端情形时如果本基金配置了较大比例的信用产品，可能存在无法及时找到交易对手的情形，进而将对基金整体的流动性产生影响。

2. 特殊的市场情形：在特殊市场情形下，如市场资金紧张时，市场整体流动性降低，将可能导致个券的变现能力减弱，从而产生流动性风险。特殊的个券特征，例如信用评级的下降、含选择权等因素，也会导致个券变现能力的减弱，从而产生流动性风险。

#### （四）操作风险

操作风险指由于我司信息系统、投资运作系统或其他外部事件导致的操作失灵或失误带来基金资产损失的风险。这一风险主要来自于计算机系统失灵（如病毒、软件错误）、人为失误和公司以外的不可控因素。

#### （五）模型风险

模型风险指投资估值模型的参数错误或模型运用不当带来的基金资产损失风险。在利用定价模型对金融资产，尤其是金融衍生产品进行定价的过程中，容易出现模型风险。

#### （六）法律/合同风险

法律/合同风险指合同签约的一方无法履行合同规定的义务，造成另外一方损失时可能发生的法律诉讼风险。

#### （七）通货膨胀风险

通货膨胀风险指物价水平上升导致本基金的名义收益率在剔除通货膨胀因素影响后降低的风险。在本基金运作过程中，通货膨胀风险也表现为物价水平上升导致中、短期固定收益证券或者回购交易的实际收益率远低于名义收益率的情况。

#### （八）不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力的出现将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；金融市场危机、行业竞争、托管行违约等超出基金管理人自身控制能力之外的风险，也可能导致基金或基金持有人的利益受损。



## 十七、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）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。但根据适用的相关规定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、收费方式或调低赎回费率；
- （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重大变化；
- （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. 中国证监会规定的其他情况。

### （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。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （7）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （8）参加与基金财产有关的民事诉讼；
- （9）公布基金财产清算结果；
- （10）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。

## 十八、基金合同的内容摘要

### （一）基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

（8）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、融券；

（9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（10）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（11）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（13）依法召集基金份额持有人大会；

（14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- （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、勤勉尽责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管理人的财产相互独立，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）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- （9）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；
- （10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- （11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- （12）编制中期和年度基金报告；
- （13）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；
- （14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- （15）按照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收益；
- （16）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；
- （17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- （18）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者实施其他法律行为；
- （19）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；
- （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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- （21）基金托管人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。

### 3. 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，对于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，应及时呈报中国证监会，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。

### 4. 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、中期和年度基金报告出具意见，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）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；
- （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，其赔偿责任不因其退任而免除；
- （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。

#### 5. 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）依法申请转让、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、基金份额发售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。

## 6. 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不当得利；
- （7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

### （二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

#### 2. 召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- 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，但法律法规要求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。

（2）出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 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、收费方式或调低赎回费率；
- 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重大变化；

- 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。

### 3. 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

(4) 代表基金份额10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

### 4. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- 6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；



9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### 5. 基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定。

##### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

##### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%，下同)；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金注册登记机构持有的注册登记资料相符。

##### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③ 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效

力；

④本人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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上；

⑤直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## 6. 议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

1) 议事内容为本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表决的提案。

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、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个工作日在公证机关及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。

## 7. 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)所持表决权过半数通过方为有效，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) 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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

(6) 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。

## 8. 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。

## 9. 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定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。关于本章第2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经中国证监会核准后方可执行，关于本章第2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日内在指定媒体公告。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，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10. 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。

## （三）基金合同解除和终止的事由、程序

### 1. 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。但根据适用的相关规定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、收费方式或调低赎回费率；
- 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。

## 2. 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）中国证监会规定的其他情况。

## 3. 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。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- 9) 公布基金财产清算结果；
- 10) 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。

### （四）争议解决方式

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。

#### （五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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。

1. 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。基金合同的有效期限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。

2. 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。

3. 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。

4. 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。

## 十九、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1. 基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

邮政编码：518026

法定代表人：杨光裕

成立日期：2001年12月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务

## 2. 基金托管人

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

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004年09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

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票（包括中小板与创业板）、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具及其衍生工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转债所产生的权证等，以及法律法规或监管机构允许基金投资的其他权益类金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：



(1) 债券等固定收益类资产投资比例不低于基金资产净值的80%，其中非政策性金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券等信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债除外）的投资比例不低于基金资产净值的30%，股票等权益类资产投资比例不高于基金资产净值的20%；现金或者到期日在1年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%；

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；

(3) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(4) 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%；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%；

(5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的比例不得超过基金资产净值的40%；

(6) 本基金应投资于信用评级为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三个月内予以全部卖出；

(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发行规模的10%；

(9) 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%；

(10) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的10%；

(11) 法律法规及中国证监会规定的其它比例限制。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。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。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行

为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(1) 本基金投资的受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票

网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资受限证券，不得预付任何形式的保证金。

(2) 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

(3) 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。

4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

(4) 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

(5) 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

- 1) 本基金投资受限证券时的法律法规遵守情况。
  - 2) 在基金投资受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
  - 3) 有关比例限制的执行情况。
  - 4) 信息披露情况。
- (6) 相关法律法规对基金投资受限证券有新规定的，从其规定。
6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。
    7. 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。
    8. 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。
    9. 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。
    10. 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人应对基金托管人的业务核查

1. 基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以电话提醒或书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

3. 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### （四）基金财产的保管

##### 1. 基金财产保管的原则

- （1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （2）基金托管人应安全保管基金财产。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人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。
- （5）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- （6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

（7）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### 2. 基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

（2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### 3. 基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4. 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### 5. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

### 6. 其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后15年。

### （五）基金资产净值计算与复核

#### 1. 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。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，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。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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。

3. 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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担

责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

### （七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，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，仲裁地点为北京市，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。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

### （八）托管协议的修改与终止

#### 1. 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

#### 2. 基金托管协议终止出现的情形

- （1）基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）账单服务

1、基金份额持有人可登陆本基金管理人网站账户查询系统查阅对账单。

2、基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人定制对账单。基金管理人根据基金份额持有人的对账单定制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司旗下基金份额的持有人定期或不定期发送对账单，但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息（包括姓名、手机号码、电子邮箱、邮寄地址、邮政编码等）导致基金管理人无法送出的除外。



（二）客户服务中心（Call Center）电话服务

1、24 小时自动语音应答服务，为投资者提供基金净值查询、基金账户查询、基金信息查询等服务。

2、工作时间由专门客服人员为投资者提供全面业务咨询（包括公司信息、基金信息、基金投资指南等）及投诉受理等服务。

公司网站：www.ccfund.com.cn

客服邮箱：support@ccfund.com.cn

客服电话：400-8868-666

二十一、其他应披露的事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于东兴证券增加为代销机构及开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2012 年 7 月 13 日
2	长城基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2012 年 7 月 20 日
3	关于信达证券增加为代销机构及开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2012 年 7 月 20 日
4	长城基金管理有限公司关于开通工商银行借记卡基金网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2012 年 9 月 10 日
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务方式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2012 年 9 月 19 日
6	关于深圳众禄基金增加为代销机构及开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告 0919	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2012 年 9 月 19 日
7	关于杭州数米基金销售有限公司增加为代销机构及及实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2012 年 9 月 21 日
8	在本报告期内刊登的其他公告		

二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。招募说明书条款及内容应以招募说明书正本为准。

投资者还可以登录基金管理人的网站（<http://www.ccfund.com.cn>）查阅和下载本招募说明书。

## 二十三、备查文件

- （一）中国证监会批准长城积极增利债券型证券投资基金设立的文件
- （二）《长城积极增利债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城积极增利债券型证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）中国证监会规定的其他文件

长城基金管理有限公司

二〇一二年十一月二十四日