

# 长盛基金-智慧安迅混合型资产管理计划 投资说明书

长盛基金管理有限公司

## 目 录

一、 重要提示.....	4
二、 资产管理计划概况.....	4
(一) 资产管理计划基本要素 .....	4
(二) 资产管理计划投资 .....	6
(三) 资产管理计划的分级 .....	8
(四) 资产管理计划份额的初始销售 .....	12
(五) 资产管理计划的参与、退出和非交易过户 .....	13
(六) 资产管理计划的收益分配.....	14
(七) 资产管理计划的费用和税收.....	15
三、 资产管理合同主要内容.....	17
(一) 当事人及权利义务 .....	17
(二) 资产管理计划的备案 .....	21
(三) 资产管理计划的财产 .....	22
(四) 资产管理计划的估值和会计核算 .....	24
(五) 报告义务 .....	28
(六) 资产管理合同的变更与终止与财产清算 .....	30
(七) 争议的处理 .....	33
四、 资产管理人与资产托管人概况 .....	34
(一) 资产管理人概况.....	34
(二) 资产托管人概况.....	34
五、 投资风险揭示.....	35
(一) 市场风险 .....	35
(二) 管理风险 .....	36
(三) 流动性风险 .....	36
(四) 信用风险 .....	36
(五) 特定的投资方法及资产管理计划资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险.....	36
(六) 操作或技术风险.....	37
(七) 衍生品风险 .....	37
(八) 进取级受益人本金损失的风险.....	37
(九) 优先级受益人本金损失的风险.....	37
(十) 其他风险 .....	38
六、 拟任投资经理简介 .....	38
七、 对资产委托人的服务 .....	38
(一) 在线客服.....	39
(二) 投资业务咨询.....	39

---

(三) 投诉建议受理 .....	39
(四) 语音留言服务 .....	39
(五) 客服互动活动 .....	39
(六) 长盛客户服务中心联系方式 .....	39

## 一、重要提示

《长盛基金-智慧安迅混合型资产管理计划投资说明书》(以下简称“本投资说明书”)依据《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》(以下简称“《试点办法》”)、《长盛基金-智慧安迅混合型资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本计划资产管理合同”或“本合同”)及其他有关规定编写。资产管理人保证本投资说明书的内容真实、准确、完整,不得有任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

资产委托人在投资本资产管理计划之前,请仔细阅读资产管理合同和本投资说明书,全面认识本资产管理计划的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。资产管理计划的过往业绩并不预示其未来表现。资产管理人管理的证券投资基金、其他委托财产的业绩并不构成对本资产管理计划业绩表现的保证。资产管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划资产,但不保证资产管理计划一定盈利,也不保证最低收益。

本投资说明书已报中国证监会备案并获得备案登记,但中国证监会对长盛基金-智慧安迅混合型资产管理计划(以下简称“本资产管理计划”或“本计划”)销售的核准,并不表明其对本资产管理计划的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本资产管理计划没有风险。

## 二、资产管理计划概况

### (一) 资产管理计划基本要素

#### 1. 计划名称

长盛基金-智慧安迅混合型资产管理计划。

#### 2. 计划类型

混合型。

### 3. 运作方式

封闭型。

### 4. 资产管理计划的投资目标

本资产管理计划追求长期稳定的绝对回报。充分发挥资产管理人专业投资管理能力，谋求本计划资产单位风险的收益最大化。

### 5. 资产管理计划的存续期限

合同生效起 1 年。

### 6. 资产管理计划的最低资产要求

本资产管理计划成立时委托财产的初始资产净值不得低于 3000 万元人民币，但至多不得超过 50 亿人民币。单个资产委托人的初始资产管理计划资产不得低于 100 万元人民币（不含认购费用）。

### 7. 资产管理计划份额的初始销售面值

人民币 1.00 元。

### 8. 资产管理计划份额的分级

本资产管理计划通过本计划委托财产收益分配的安排，将计划份额分成预期收益与风险不同的三个级别，即优先级计划份额（计划份额简称为“长盛智慧安迅分级 A”）和进取级计划份额（计划份额简称为“长盛智慧安迅分级 B1”和“长盛智慧安迅分级 B2”）。

本资产管理计划的优先级计划份额设定为均等份额，每份长盛智慧安迅分级 A 具有同等的合法权益；本资产管理计划的进取级 B1 份额设定为均等份额，每份长盛智慧安迅分级 B1 具有同等的合法权益；本资产管理计划的进取级 B2 份额设定为均等份额，每份长盛智慧安迅分级 B2 具有同等的合法权益。

### 9. 三级份额的配比要求

长盛智慧安迅分级 A 与长盛智慧安迅分级 B1、长盛智慧安迅分级 B2 的认购确认份额数初始配比原则上在 5：0.5：1。

### 10. 资产管理计划的投资顾问

资产管理人可根据实际需要聘请投资顾问为本资产管理计划的投资提供投资建议。本资产管理计划的投资顾问为无锡智慧投资有限公司，是一家专注于投资大陆、香港地区优质上市公司股票及商品、股指期货等金融衍生品的投

资公司。

无论本合同其它条款如何约定，为履行投资顾问业务之目的，资产管理人可以向投资顾问披露本合同及/或其它相关文件，但应促使投资顾问对所获信息保密。资产管理人聘请投资顾问的相关费用由资产管理人支付，不再单独向资产委托人收取。

资产管理人有权选择、聘任、更换、解聘投资顾问。投资顾问更换或解聘的，资产管理人将通过其网站进行公告。

## (二) 资产管理计划投资

### 1. 投资目标

本资产管理计划追求长期稳定的绝对回报。充分发挥资产管理人专业投资管理能力，谋求本计划资产单位风险的收益最大化。

### 2. 投资范围

本计划主要投资于期货类金融衍生品和货币类金融工具（含货币型基金和回购）。如法律法规或监管机构以后允许特定客户资产管理计划投资于其他金融衍生品，资产管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本计划具体投资范围如下：

(1) 期货类金融衍生品：中国金融期货交易所上市交易的股指期货合约，隔夜持仓（按合约占用保证金计算）不超过资产管理计划资产净值的 50%。

(2) 货币类：包括一年以内（含一年）的大额存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、期限在一年以内（含一年）的央行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、货币型基金以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具，占资产管理计划资产净值的 0%-100%。

### 3. 投资策略

#### (1) 资产配置策略

本资产管理计划为混合型产品，大类资产配置具有一定的灵活性。本资产管理计划主要利用长盛资产配置评估体系确定资产配置比例，主要考虑如下因素：

#### A. 宏观经济因素

本资产管理计划对宏观经济形势变化趋势的考量，重点关注主要经济变量的变动趋势，这些变量包括但不限于通货膨胀率、GDP 增长率、基础货币与货币供应量增长率、用电量与货运量增长率等指标。

#### B. 政策因素

本资产管理计划将根据宏观经济形势变化趋势研判宏观经济与产业政策的未来变化，重点关注财政政策、税收政策、信贷与货币政策、产业政策等的变化趋势。

#### (2) 股指期货投资策略

在控制投资风险的基础上，利用趋势交易策略投资于股指期货，即利用价格的波动采取买空期指或卖空期指的交易赚取差价，追逐风险利润。并辅以积极的现金管理策略，实现委托资产的稳健增值。

#### 4. 投资限制

本计划投资于期货类衍生品的隔夜持仓（按合约占用保证金计算）占资产管理计划资产的比例不超过 50%。

#### 5. 投资禁止行为

为维护资产委托人的合法权益，本计划不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券。
- (2) 向他人提供担保。
- (3) 从事承担无限责任的投资。
- (4) 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。
- (5) 向资产管理人、资产托管人出资。
- (6) 依照法律、行政法规、本合同及国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

#### 6. 业绩比较基准

本资产管理计划不设业绩比较基准。

#### 7. 风险收益特征

本资产管理计划为混合型计划，属于资产管理计划中的中等风险品种，其预期风险与收益高于货币型资产管理计划、债券型资产管理计划，低于股票型资产管理计划。

### (三) 资产管理计划的分级

#### 1. 分级概要

本资产管理计划通过对本计划委托财产收益分配的安排，将计划份额分成预期收益与风险不同的三个级别，即优先级计划份额（计划份额简称为“长盛智慧安迅分级 A”）和进取级计划份额（计划份额简称为“长盛智慧安迅分级 B1”、“长盛智慧安迅分级 B2”）。长盛智慧安迅分级 A 和长盛智慧安迅分级 B1、B2 分别募集并按照合同约定的比例进行初始配比，所募集的三级份额的委托资产合并运作。

在合同终止，完成本资产管理计划委托财产清算并将财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用、交纳所欠税款并清偿计划债务后得到的清算后净资产，优先分配长盛智慧安迅分级 A 的本金和约定应得收益，即长盛智慧安迅分级 A 为低风险且预期收益相对稳定的计划份额。本资产管理计划在优先分配长盛智慧安迅分级 A 的本金和约定应得收益后的剩余清算净资产，若长盛智慧安迅分级 B1 收益率（收益/B1 本金）低于 10.05%，则剩余收益全部分配给长盛智慧安迅分级 B1 份额持有人；若长盛智慧安迅分级 B1 收益率高于 10.05%，则首先分配长盛智慧安迅分级 B1 的本金和收益[B1 本金×10.05%]，余下部分全部分配给长盛智慧安迅分级 B2，即长盛智慧安迅分级 B1、B2 为较高风险且预期收益相对较高的计划份额。

#### 2. 资产收益分配规则

合同终止清算时（包括到期终止和提前终止），长盛智慧安迅分级 A 和长盛智慧安迅分级 B1、长盛智慧安迅分级 B2 的资产及收益的分配规则如下：

（1）长盛智慧安迅分级 A 年约定收益率为 10%，其对应收益（称之为“约定应得收益”）分配金额以计划份额初始面值为基准进行计算，则约定应得收益具体计算公式如下：

长盛智慧安迅分级 A 约定应得收益=长盛智慧安迅分级 A 计划份额的初始面值×10 %。

（2）本资产管理计划优先分配长盛智慧安迅分级 A 的本金和约定应得收益后的剩余清算净资产，若长盛智慧安迅分级 B1 收益率（收益/B1 本金）低于 10.05%，则剩余收益全部分配给长盛智慧安迅分级 B1 份额持有人；若长盛智慧



安迅分级 B1 收益率高于 10.05%，则首先分配长盛智慧安迅分级 B1 的本金和收益[B1 本金 $\times$ 10.05%]，余下部分全部分配给长盛智慧安迅分级 B2，即长盛智慧安迅分级 B1、B2 为较高风险且预期收益相对较高的计划份额。

### 3. 三级份额的配比

本资产管理计划的三级计划份额的初始配比原则上为 5:0.5:1，资产管理人有权根据本计划的实际初始销售情况，将优先级与进取级 B1、B2 的份额配比在 4.8:0.5:1 至 5.2:0.5:1 之间进行调整。合同生效后，资产管理人将三类份额的最终配比通知资产委托人，份额配比数值保留至小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

### 4. 交易结构及止损策略

(1) 本计划预警线为 0.94 元，当本计划收盘资产净值跌至 0.94 元时，资产管理人将以电话、邮件、书面等形式向长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人发出预警。长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人可在收到预警后(以系统记录时间为准)2 个工作日内追加资金打入本资产计划银行账户，使本资产计划净值高于 0.94 元。在长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人按照上述要求追加资金之前，资产管理人不再发出增加持仓的投资指令。若长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人拒绝追加资金或在收到限仓通知后第 2 日收盘结束时资金未到账，则资产管理人将于发出限仓通知后第 2 日 15:00 后，控制本计划期货交易保证金比例不得超过本计划净资产的 20%。

(2) 本计划止损线为 0.90 元，当本计划资产收盘份额净值跌至 0.90 元或以下时，资产管理人将以电话、邮件、书面等形式向长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人发出止损通知，提示长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人可以追加资金，以使追加后的资产管理计划财产净值不低 0.95，长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人收到止损通知后应及时向资产管理人确认是否追加资金。若长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人拒绝追加资金或 2 日内资金未到账，且资产管理计划净值仍低于 0.90 元，资产管理人将于第 3 日对资产管理计划的全部非固定收益类资产全部变现。在此期间，一旦本计划资产净值跌至 0.85 元，无论长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人是否同意追加资金，资产管理人都将对本计划持有的全部非固定

收益类资产变现。

(3) 长盛智慧安迅分级 B2 的资产委托人打入本资产计划银行账户资金于资金到账日计入本计划资产项下权益类平准金。追加的资金不享有该计划份额。当本计划资产净值超过 0.95 元后，长盛智慧安迅分级 B2 的资产委托人可向管理人申请退还权益类平准金，退还金额不超过初始转入的平准金金额，退还金额后本计划资产净值不低于 0.95 元。

(4) 资产管理人在警戒线或止损线附近进行减仓或平仓操作时，正负 1%-2% 的误差是合理的。

## 5. 运作期内计划份额参考净值的计算

资产管理人按照本计划收益分配规则，对优先级与进取级计划份额单独进行计划份额参考净值计算。

设第 T 日为分级运作期内的计划份额参考净值计算日，N 为本合同生效日至 T 日的运作天数，G 为 T 日收市后的计划资产净值， $F_A$  为 T 日优先级份额的份额，FB1 为 T 日进取级份额 B1 的份额，FB2 为 T 日进取级份额 B2 的份额， $NAV_A$  为第 T 日优先级份额的参考净值， $NAV_{B1}$  为第 T 日进取级份额 B1 的参考净值， $NAV_{B2}$  为第 T 日进取级份额 B2 的参考净值，R 为优先级份额的约定年收益率，B1、B2 为进取级 B1 和进取级 B2 份额的初始认购金额。

运作期内第 T 日，优先级份额和进取级份额的份额参考净值计算公式如下：

(1) 当  $G \leq F_A \times 1.00 \times (1 + R \times N / 365)$  时，则优先级份额与进取级份额在运作期内第 T 日份额参考净值为：

$$NAV_A = G / F_A;$$

$$NAV_{B1} = 0;$$

$$NAV_{B2} = 0;$$

(2) 当  $F_A \times 1.00 \times (1 + R \times N / 365) \leq G \leq F_A \times 1.00 \times (1 + R \times N / 365) + FB1 \times 1.00 \times (1 + 10.05\% \times N / 365)$  时，则优先级份额与进取级份额在运作期内第 T 日份额参考净值为：

$$NAV_A = 1.00 \times (1 + R \times N / 365);$$

$$NAV_{B1} = (G - NAV_A \times F_A) / F_{B1};$$

$$NAV_{B2} = 0$$

(3) 当  $F_A \times 1.00 \times (1 + R \times N / 365) + F_{B1} \times 1.00 \times (1 + 10.05\% \times N / 365) < G$  时, 则  
优先级份额与进取级份额在运作期内第 T 日份额参考净值为:

$$NAV_A = 1.00 \times (1 + R \times N / 365);$$

$$NAV_{B1} = 1.00 \times (1 + 10.05\% \times N / 365);$$

$$NAV_{B2} = [G - NAV_A \times F_A - F_{B1} \times 1.00 \times (1 + 10.05\% \times N / 365)] / F_{B2};$$

优先级份额与进取级份额参考净值的计算, 保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入。

#### 6. 合同终止时计划份额参考净值的计算

在合同终止时, 资产管理人按照本计划收益分配规则, 对优先级与进取级计划份额单独进行计划份额参考净值计算。

G 为合同终止日收市后的计划资产净值,  $F_A$  为合同终止日优先级份额的份额,  $F_{B1}$  为合同终止日进取级份额 B1 的份额,  $F_{B2}$  为合同终止日进取级份额 B2 的份额,  $NAV_A$  为合同终止日优先级份额的参考净值,  $NAV_{B1}$  为合同终止日进取级份额 B1 的参考净值,  $NAV_{B2}$  为合同终止日进取级份额 B2 的参考净值, R 为优先级份额的约定年收益率, B1、B2 为进取级 B1 和进取级 B2 份额的初始认购金额。

合同终止日, 优先级份额和进取级份额的份额参考净值计算公式如下:

(1) 当  $G \leq F_A \times 1.00 \times (1 + R)$  时, 则优先级份额与进取级份额在合同终止日  
份额参考净值为:

$$NAV_A = G / F_A;$$

$$NAV_{B1} = 0;$$

$$NAV_{B2} = 0;$$

(2) 当  $F_A \times 1.00 \times (1 + R) \leq G \leq F_A \times 1.00 \times (1 + R) + F_{B1} \times 1.00 \times (1 + 10.05\%)$  时,  
则优先级份额与进取级份额在合同终止日份额参考净值为:

$$NAV_A = 1.00 \times (1+R);$$

$$NAV_{B1} = (G - NAV_A \times F_A) / F_{B1};$$

$$NAV_{B2} = 0$$

(3) 当  $F_A \times 1.00 \times (1+R) + F_{B1} \times 1.00 \times (1+10.05\%) < G$  时, 则优先级份额与进取级份额在合同终止日份额参考净值为:

$$NAV_A = 1.00 \times (1+R);$$

$$NAV_{B1} = 1.105;$$

$$NAV_{B2} = [G - NAV_A \times F_A - F_{B1} \times 1.00 \times (1+10.05\%)] / F_{B2};$$

优先级份额与进取级份额参考净值的计算, 保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入。

#### (四) 资产管理计划份额的初始销售

##### 1. 资产管理计划份额的初始销售期间、销售方式、销售对象

###### (1) 初始销售期间

资产管理计划自2013年8月2日至2013年8月21日进行初始销售, 初始销售期间自资产管理计划份额发售之日起不超过1个月。

如果在此期间提前满足《试点办法》第十三条规定的条件的, 且优先级和进取级 B1、B2 三级份额配比在 4.8:0.5:1 至 5.2:0.5:1 之间, 资产管理人可决定提前终止初始销售 日进行初始销售, 初始销售期间自资产管理计划份额发售之日起不超过 1 个月。

**资产管理人决定提前终止初始销售, 并在资产管理人网站及时公告, 即视为履行完毕提前终止初始销售的程序。资产管理人发布公告提前结束初始销售的, 本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。**

###### (2) 销售方式

本资产管理计划通过资产管理人进行销售。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的投资说明书为准。

本资产管理计划三级份额将先后分别进行初始销售。在初始销售期间, 先

行销售优先级份额；优先级份额销售结束后，再进行进取级 B1、B2 份额的销售。

三级份额各自具体的销售起始日和结束日以资产管理人网站公告为准。

### (3) 销售对象

委托投资单个资产管理计划初始金额不低于 100 万元人民币（不含认购费用），且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。

## 2. 资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金应以现金形式交付。投资者初始认购金额不低于 100 万元人民币（不含认购费用）。

## 3. 资产管理计划份额的认购费用

本资产管理计划无认购费用。

## 4. 初始销售期间的认购程序

(1) 认购程序。资产委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

(2) 认购申请的确认。认购申请受理完成后，投资者不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

## 5. 初始销售期间特定客户资金的管理

资产管理人应当将资产管理计划初始销售期间特定客户的委托资金存入专门资金账户，在资产管理计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。

## (五) 资产管理计划的参与、退出和非交易过户

### 1. 资产管理计划的参与、退出

本资产管理计划在存续期内不接受资产委托人的参与和退出申请，也不接受资产委托人的违约退出申请。

### 2. 非交易过户的认定及处理方式

(1) 资产管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指资产委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

(2) 办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

## (六) 资产管理计划的收益分配

### 1. 可供分配收益构成

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

资产管理计划收益包括：计划投资所得红利、债券利息、证券投资投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。

### 2. 收益分配原则

(1) 长盛智慧安迅分级 B2 每一计划份额享有同等分配权，长盛智慧安迅分级 A、长盛智慧安迅分级 B1 在本计划存续期内不参与收益分配。

(2) 当任意一个交易日后，本计划单位资产净值超过 1.20 元并持续 5 个交易日，则第 5 个交易日为收益分配基准日。若收益分配基准日的可供分配收益大于 0，则可以对长盛智慧安迅分级 B2 份额持有人进行收益分配；收益分配后的计划单位资产净值不得低于 1.10 元；每两次收益分配间隔不低于 2 个月

(3) 本资产管理计划收益分配方式为现金分红，收益分配时发生的银行转账等手续费由资产委托人自行承担。

(4) 收益分配的基准日为可供分配利润的计算截至日。



- (5) 若本合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。
- (6) 红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。
- (7) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。
- (8) 每年至多现金分红 4 次。

### 3. 收益分配方案的确定与通知

计划收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

计划收益分配方案由资产管理人拟定，并由资产托管人核实后确定，计划资产管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并告知资产委托人。

在收益分配方案公布后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向资产托管人发送划款指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行现金收益的划付。

本计划终止后的收益分配规则参照本合同第五章执行。

## (七) 资产管理计划的费用和税收

### 1. 资产管理计划费用的种类

- (1) 资产管理人的管理费。
- (2) 资产托管人的托管费。
- (3) 计划的证券交易费用。
- (4) 计划备案确认合同生效后与之相关的会计师费和律师费。
- (5) 资产管理计划资产的银行汇划费用。
- (6) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划资产中列支的其他费用。

### 2. 费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (1) 资产管理人的管理费

本计划的管理费按计划资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \underline{0.6\%} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的计划资产净值

本计划的管理费自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人于下季初五个工作日之内从资产管理计划资产中一次性支付给资产管理人。

#### (2) 资产托管人的托管费

本计划的托管费按计划资产净值的 0.2% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times \underline{0.2\%} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划资产净值

本计划的托管费自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人于下季初五个工作日之内从资产管理计划资产中一次性支付给资产托管人。

(3) 上述第 1 款中的 (3) 至 (6) 项下的费用根据有关法规及相应协议规定，列入当期费用，由资产托管人从计划资产中支付。

### 3. 不列入资产管理计划业务费用的项目

(1) 资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或计划资产的损失。

(2) 资产管理人和资产托管人处理与本资产管理计划运作无关的事项发生的费用。

(3) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

### 4. 费用调整

资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率和托管费率，并报中国证监会备案。

### 5. 资产管理业务的税收

本计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。组合根据实际从登记结算机构收到的股息、利息等相关收入直接确认收益。资产委托人应缴纳的税收，由资产委托人负责，资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。



### 三、资产管理合同主要内容

#### (一) 当事人及权利义务

##### 1. 资产委托人

###### (1) 资产委托人概况

签署本合同且合同正式生效的投资者即为本合同的资产委托人。资产委托人的详细情况在合同签署页列示。

###### (2) 资产委托人的权利

- A. 分享资产管理计划资产收益。
- B. 参与分配清算后的剩余资产管理计划资产。
- C. 按照本合同的约定参与和退出资产管理计划。
- D. 监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况。
- E. 按照本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的运作信息资料。
- F. 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

本资产管理计划的优先级计划份额设定为均等份额，资产委托人持有的每份长盛智慧安迅分级 A 具有同等的合法权益；本资产管理计划的进取级计划份额设定为均等份额，资产委托人持有的每份长盛智慧安迅分级 B1 具有同等的合法权益，资产委托人持有的每份长盛智慧安迅分级 B2 具有同等的合法权益。

###### (3) 资产委托人的义务

- A. 遵守本合同。
- B. 交纳购买资产管理计划份额的款项及规定的费用。
- C. 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。
- D. 及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况。
- E. 向资产管理人或销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人履行反洗钱义务。
- F. 不得违反本合同的约定干涉资产管理人的投资行为。
- G. 不得从事任何有损资产管理计划及其投资人、资产管理人管理的其他资

产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动。

H. 按照本合同的约定承担资产管理费、托管费以及因资产管理计划资产运作产生的其他费用。

I. 接受资产管理人进行的尽职调查，应资产管理人要求提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

J. 保证购买资产管理计划份额的款项来源及用途合法。

K. 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## 2. 资产管理人

### (1) 资产管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

通信地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

联系人：张帆

联系电话：010-82019907

传真：010-82019811

网站：<http://www.csfunds.com.cn>

### (2) 资产管理人的权利

A. 按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划资产。

B. 按照本合同的约定，及时、足额获得资产管理人报酬。

C. 按照有关规定行使因资产管理计划资产投资所产生的权利。

D. 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人；对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划资产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，并报告中国证监会。

E. 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督。

F. 自行担任资产管理计划份额的注册登记机构。

G. 有权对资产委托人进行尽职调查，要求资产委托人提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

H. 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

(3) 资产管理人的义务

A. 办理资产管理计划的备案手续。

B. 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产。

C. 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划资产。

D. 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，保证所管理的资产管理计划资产与其管理的基金财产、其他委托财产和资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。

E. 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划资产。

F. 办理资产管理计划份额的登记事宜。

G. 按照本合同的约定接受资产委托人和资产托管人的监督。

H. 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

I. 按照《试点办法》和本合同的规定，编制并向资产委托人报送资产管理计划资产的投资报告，对报告期内资产管理计划资产的投资运作等情况做出说明。

J. 按照《试点办法》和本合同的规定，编制特定资产管理业务季度及年度报告，并向中国证监会备案。

K. 计算并根据本合同的约定向资产委托人报告资产管理计划份额净值。

L. 进行资产管理计划会计核算。

M. 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，但监管机构另有规定的除外。

N. 保存资产管理计划资产管理业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料。

0. 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划资产及其他当事人利益的活动。

P. 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

### 3. 资产托管人

#### (1) 资产托管人概况

名称：交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：裴学敏

联系地址：上海市仙霞路 18 号（邮编：200336）

联系方式：021-32169999-8722, peixm@bankcomm.com

#### (2) 资产托管人的权利

A. 按照本合同的约定，及时、足额获得资产托管费。

B. 根据本合同及其他有关规定，监督资产管理人对资产管理计划资产的投资运作，对于资产管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划资产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施。

C. 按据本合同的约定，依法保管资产管理计划资产。

D. 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

#### (3) 资产托管人的义务

A. 安全保管资产管理计划资产。

B. 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

C. 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划资产的完整与独立。

D. 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划资产。

E. 按规定开设和注销资产管理计划的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

- F. 复核资产管理计划份额净值（不包含分级的份额参考净值）。
- G. 复核资产管理人编制的资产管理计划资产的投资报告，并出具书面意见。
- H. 编制资产管理计划的年度托管报告，并向中国证监会备案。
- I. 按照本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。
- J. 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存资产管理计划资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料。
- K. 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划资产及其他当事人利益的活动。
- L. 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露。
- M. 按照法律法规及本合同的规定监督资产管理人的投资运作，资产托管人发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会；资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并及时报告中国证监会。
- N. 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## （二）资产管理计划的备案

### 1. 资产管理计划备案的条件

本资产管理计划初始销售期限届满，符合下列条件的，资产管理人应当按照规定办理验资和资产管理计划备案手续：

(1) 资产管理计划委托人至少 2 人，且不超过 200 人（但单笔委托金额在 300 万以上的投资者数量不受此限制），资产管理计划的初始资产合计不低于 3000 万元人民币，但至多不得超过 50 亿人民币，中国证监会另有规定的除外。

(2) 优先级和进取级三级份额配比在 4.8:0.5:1 至 5.2:0.5:1 之间。

### 2. 资产管理计划的备案

初始销售期限届满，符合资产管理计划备案条件的，资产管理人应当自初始销售期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告及客户资料表，办理相关备案手续。客户资料表应包括委托人名称、委托人身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、参与资产管理计划的金额和其他信息。

自中国证监会书面确认之日起，资产管理计划备案手续办理完毕，资产管理合同生效。资产委托人的认购款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归资产委托人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （三） 资产管理计划的财产

#### 1. 资产管理计划财产的保管与处分

(1) 资产管理计划资产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并由资产托管人保管。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划资产归入其固有财产。

(2) 资产管理人、资产托管人因资产管理计划资产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划资产。

(3) 资产管理人、资产托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划资产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划资产不属于其清算财产。

(4) 资产托管人对由于中金所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在中金所结算会员的资金不行使保管职责。

(5) 资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，国家有权机关要求执行的情况除外，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性。



## 2. 资产管理计划财产相关账户的开立和管理

(1) 资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的专用银行账户和专用证券账户，资产管理人应给予必要的配合。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。资产管理计划的其他相关账户，依照相关法律法规的规定，由资产托管人负责开立，并按相关规则进行管理。

(2) 资产托管人应以资产管理人、资产托管人、资产管理计划联名的名义在其营业机构开立计划财产专用银行账户，资产管理计划合同签署后并以此名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立计划财产专用证券账户。

计划财产专用银行账户的预留印鉴由资产托管人制作、保管和使用，并根据资产管理人符合本合同约定的指令办理资金收付。计划财产专用证券账户的开立和证券账户卡的保管由资产托管人负责，账户资产的管理和运用由资产管理人负责。

(3) 计划财产专用银行账户和专用证券账户的开立和使用，限于满足计划财产运用和管理的需要。资产托管人和资产管理人不得假借资产委托人或资产管理计划的名义开立任何其他银行账户或证券账户；亦不得使用计划财产的任何账户进行计划财产管理以外的活动。

(4) 资产托管人可以通过申请开通本计划财产专用银行账户的交通银行企业网上银行办理计划财产的资金结算汇划业务。

(5) 资产管理人应租用一个或多个上海和深圳专用交易单元，用于计划财产项下的上海、深圳证券交易所证券投资运作。

(6) 资产托管人根据资产管理人的投资需求开立场外交易所需账户，仅限于满足计划财产运作和管理的需要，开立账户需提供相关的资料，由资产托管人通知资产管理人。

(7) 资产管理人、资产托管人根据与期货公司三方签订的相关期货投资操作备忘录约定开立相关期货账户。

## 3. 募集资金的移交验证

本计划初始销售期限届满，客户委托的初始资产合计不低于人民币 3000 万元、但不得超过人民币 50 亿元，委托人数不超过 200 人（但单笔委托金额在

300 万元人民币以上的投资者数量不受限制), 同时, 优先级和进取级三级份额配比在 4.8:0.5:1 至 5.2:0.5:1 之间, 本计划即符合备案的条件。资产管理人应将属于资产管理计划财产的全部资金划入资产托管人开立的计划财产专用银行账户。资产管理人应当自初始销售期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资, 自收到验资报告之日起 10 日内, 向中国证监会提交验资报告及客户资料表, 办理相关备案手续。

自中国证监会书面确认之日起, 资产管理计划备案手续办理完毕, 资产管理合同生效。资产委托人的认购参与款项(不含认购费用)加计其在初始销售期形成的利息在资产管理合同生效后折算成相应的资产管理计划份额归资产委托人所有, 其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

若资产管理计划初始销售期限届满, 未能达到资产管理合同生效的条件, 由资产管理人按规定办理退款等事宜。

#### (四) 资产管理计划的估值和会计核算

##### 1. 估值目的

计划资产估值的目的是客观、准确地反映计划资产的价值。

计划资产按照法律法规和本合同规定的估值方法和程序进行。计划资产净值是指计划资产总值减去负债后的净资产值。计划资产净值的计算保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入。

##### 2. 估值时间

本资产管理计划的估值日为本资产计划成立后的每个工作日(如遇节假日, 则以节假日前最近一个工作日为估值日)或本合同以及中国证监会规定的其它日期, 资产管理人在每个估值日对资产管理计划资产进行估值, 并由资产托管人复核。

##### 3. 估值依据

本计划资产的估值依据为《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则(试行)》及其他相关法律、法规的规定。

##### 4. 估值方法

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值



A. 交易所上市的有价证券(包括股票、权证、金融衍生品、上市流通的基金等), 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;

B. 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;

C. 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;

D. 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:

A. 送股、转增股、配股和公开增发的新股, 按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;

B. 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;

C. 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) 基金估值

A. 同一基金分别在两个或两个以上市场交易、登记的, 按照所处市场的公允价值分别估值。

B. 在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF 基金、场内登记的 LOF 基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。在场外交易、登记的开放式基金（含场外登记的 LOF 基金）按前一日基金份额净值估值；如果估值日分红确认，则按前一日基金份额净值减单位分红额后的差额估值。前一日未公布基金份额净值的，以最近公布的基金份额净值估值；在基金首次公布份额净值之前按照购入成本估值。

C. 未上市的封闭式基金按估值日的净值估值，若估值日未公布净值，按最近公布的净值估值。

D. 货币市场基金按照该基金公布的每万份收益逐日计提收益。

如管理人认为上述估值方法对产品财产进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人在综合考虑市场各因素的基础上，可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### (4) 股指期货估值

股指期货合约，以估值当日结算价进行估值；估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(5) 因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值。

(6) 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。

(7) 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。

(8) 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，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(9) 其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

(10) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。

(11) 未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。

## 5. 估值对象

资产管理计划所拥有的股指期货、证券投资基金、债券和银行存款本息、

应收款项、其它投资等资产。

## 6. 估值程序与资产管理计划份额净值的确认

资产管理计划资产的估值由资产管理人同资产托管人一同进行。资产管理人在估值日对计划资产估值后，将计划份额净值结果发送资产托管人，资产托管人按照合同规定的估值方法、时间与程序进行复核；资产托管人复核无误后将复核结果反馈给资产管理人。

计划份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，相关法律法规另有规定的，从其规定。

## 7. 估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现资产管理计划估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

根据有关法律法规，资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由资产管理人承担。本计划的会计责任方由资产管理人担任。因此，就与本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，仍无法达成一致意见，以资产管理人的意见为准，资产托管人不承担由此导致的损失。

当计划资产估值出现错误时，资产管理人和资产托管人应该立即协商采取更正措施，并按本合同约定的报告方式向委托人及时披露。

## 8. 暂停估值的情形

(1) 资产管理计划投资所涉及的证券交易场所、登记结算公司及期货交易所结算会员遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划资产价值时；

(3) 占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，资产管理人为保障客户的利益决定暂停估值的；

(4) 中国证监会认定的其他情形。

## 9. 特殊情形的处理

(1) 资产管理人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为资产管理计划资产估值错误处理；

(2) 由于不可抗力原因,或由于证券交易场所及登记结算公司发送的数据错误,资产管理人和资产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,由此造成的资产管理计划资产估值错误,资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### 10. 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行:

- (1) 资产管理人为本计划的会计责任方。
- (2) 本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
- (3) 本计划核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

(4) 本计划单独建账、独立核算;资产管理人及资产托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,编制会计报表。资产托管人应定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

### (五) 报告义务

#### 1. 推介期报告

##### (1) 投资说明书

资产管理人应当在正式办理资产管理计划推介业务前,将投资说明书在资产管理人网站上公布。

##### (2) 计划生效公告

资产管理人应当在资产管理计划备案手续办理完毕,获中国证监会书面确认的次日在资产管理人网站上公告。

#### 2. 运作期报告

##### (1) 资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间

###### A. 年度报告

资产管理人应当在每年结束之日起3个月内,编制完成计划年度报告并经资产托管人复核,向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人应于每年结束之日起45日内完成年度报告,并将年度报告提供资产托管人复核,资产托管人在收到后45日内完成复核,并将复核结果书面通知资

产管理人。资产管理计划合同生效未满 3 个月，不编制当期的年度报告。

#### B. 季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成计划季度报告并经资产托管人复核后，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。

资产管理人应于每季度结束之日起 8 个工作日内完成季度报告，并将季度报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理计划合同生效未满 2 个月，不编制当期的季度报告。

#### C. 净值报告

资产管理人每月至少应向资产委托人报告一次经资产托管人复核的计划份额净值。

D. 上述向资产委托人提供的报告中涉及证券投资明细的报告，原则上每季度至多报告一次。

#### (2) 资产管理人向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照《试点办法》及其他有关规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、本合同约定的方式进行。

##### A. 网站

《资产管理合同》、《投资说明书》、定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在资产管理人网站上披露，资产委托人可随时查阅。

##### B. 邮寄服务

资产管理人向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

##### C. 传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件等方式将报告信息通知资产委托人。

#### (3) 资产托管人向资产委托人提供计划财产托管情况查询的方式

资产托管人按照规定定期向资产委托人提供资产托管报告，置于托管人办公地点备查，委托人可在营业时间前来查询。

### 3. 向监管机构提供的报告

(1) 资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务。资产托管报告由资产托管人向资产管理人提供，由资产管理人与特定资产管理业务管理年度报告一并报中国证监会备案。

(2) 资产管理人应当公平地对待所管理的不同资产，建立有效的异常交易日常监控制度，对不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易（包括交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等）进行监控，并定期向中国证监会报告。

(3) 资产管理人应当主动避免可能的利益冲突，对于资产管理合同、交易行为中存在的或可能存在利益冲突的关联交易应当进行说明，并向中国证监会报告。

(4) 资产管理人应当分析所管理的证券投资基金和委托财产投资组合的业绩表现。在一个委托投资期间内，若投资目标和投资策略类似的证券投资基金和委托财产投资组合之间的业绩表现有明显差距，应当出具书面分析报告，由投资经理、督察长、总经理分别签署后报中国证监会备案。

## (六) 资产管理合同的变更与终止与财产清算

### 1. 资产管理合同的变更

资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更。

资产管理合同约定资产管理人有权变更合同内容的情形可由资产管理人根据相关法律法规规定及资产管理合同的约定办理合同变更，包括：

(1) 投资经理的变更。

(2) 资产管理计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更。

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对资产管理合同进行变更。

(4) 对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生变化。

(5) 对资产管理合同的变更对资产委托人利益无实质性不利影响。



## 2. 合同变更的备案

对本合同任何形式的变更、补充，资产管理人应当在变更或补充发生之日起 5 个工作日内报中国证监会备案。

## 3. 资产管理合同的终止

资产管理合同终止的情形包括下列事项：

- (1) 资产管理合同存续期限届满而未延期的；
- (2) 资产管理合同的委托人人数少于 2 人；
- (3) 资产管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的；
- (4) 资产管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- (5) 资产托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- (6) 经全体委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的；
- (7) 当本计划资产份额净值跌至 0.86 元或以下时，本计划提前终止。
- (8) 法律法规和本合同规定的其他情形。

## 4. 资产管理计划资产的清算

(1) 本合同终止时，应当按法律法规和本合同的有关规定对计划资产进行清算。

### (2) 资产管理计划资产清算小组

A. 资产管理计划资产清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

B. 资产管理计划资产清算小组负责资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。计划资产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### (3) 清算程序

- A. 计划合同终止情形发生后，由计划资产清算小组统一接管计划资产。
- B. 计划资产清算小组根据计划资产的情况确定清算期限。
- C. 计划资产清算小组对计划资产进行清理和确认。
- D. 对计划资产进行变现

合同终止后，资产管理计划仍持有可流通非现金资产的，在 5 个交易日内（含合同终止日当日）由资产管理人进行强制变现处理；资产管理计划持有的流通受限证券，如未到期回购等，自限制条件解除日起（含解除当日）3 个交

易日内完成变现。未变现资产于清算期间损益由全体资产委托人享有或承担。未变现资产在清算期间不提取管理费、托管费等相关费用。

#### E. 制作清算报告

资产管理人编制清算报告交资产托管人复核后，由资产管理人向中国证监会备案。

#### F. 对计划资产进行分配

##### (4) 清算费用

清算费用是指计划资产清算小组在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由计划资产清算小组优先从计划资产中支付。清算费用包括但不限于：

- A. 聘请会计师、律师，以及其他工作人员所发生的报酬；
- B. 资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- C. 信息披露所发生的费用；
- D. 诉讼仲裁所发生的费用；
- E. 其他与清算事项有关的费用。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由资产管理人向资产托管人出具指令，由资产托管人复核后办理支付。

##### (5) 计划剩余财产的分配

依据资产管理计划资产清算的分配方案，将资产管理计划资产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划资产清算费用及各项负债后，按资产管理计划的投资人持有的计划份额比例进行分配。计划资产按下列顺序清偿：

- A. 支付清算费用。
- B. 交纳所欠税款。
- C. 清偿计划债务。
- D. 按资产管理合同第五章第（二）项约定的分配机制计算三类份额在合同终止日各自净资产总额，以剩余资产为限按优先级份额净资产总额优先对优先级份额进行分配，其余资产分配给进取级份额，然后再在三类份额各自的总分配金额内按持有的份额比例进行分配。

如存在资产管理计划资产未能及时变现的，资产管理人应在清算报告中列



明与未变现资产相关的估值方法、费用计提及分配方法等的处理程序。

计划资产未按前款 A、B、C 项规定清偿前，不分配给计划份额持有人。

(6) 计划资产清算报告的告知安排

资产管理人编制清算报告交资产托管人复核后，由资产管理人向中国证监会备案，销售机构应向资产委托人履行告知义务。

(7) 计划资产清算账册及文件由计划资产管理人保存 15 年以上。

5. 资产管理计划资产相关账户的注销

在证券资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内，资产管理人将委托资产托管人注销资产管理计划资产证券账户的通知书及其他销户资料寄送资产托管人，资产托管人原则上应于收到资产管理人、资产委托人提供资料后的 10 个工作日内完成证券账户注销。

资产管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向资产托管人出具销户确认通知书。

计划资产清算完毕后，资产托管人注销资产管理计划的资金账户，资产管理人应给予必要的配合。

## (七) 争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，应提交北京仲裁委员会进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

## 四、资产管理人与资产托管人概况

### (一) 资产管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：010-82019907

传真：010-82019811

长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”或“我公司”）是我国最早成立的基金管理公司之一，也是最早取得全国社保基金投资管理人资格和特定客户资产管理业务资格的基金管理公司之一，是中外合资的基金管理公司。公司治理结构完善、财务稳健、投资业绩优异，资产管理总规模在行业内处于中上水平。公司的使命是“专业理财 造福百姓”；愿景是“长胜百年 百年长盛”；核心价值观是“同德同智 同益同盛”；品牌口号是“长相报，盛行远”。

在多年的受托投资过程中，公司历经牛熊轮回，积累了丰富的投资经验，创造了良好的投资业绩，赢得了客户尤其是全国社保理事会的高度认可，公司管理的社保组合规模一直位居行业前列。

### (二) 资产托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

法定代表人：牛锡明

联系人：裴学敏

电话：021-95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于 2005 年 6 月和 2007 年 5 月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国 2010 年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志（The Asset）“2010 年全球最佳交易银行评选”中，交通银行荣膺“最佳次托管银行”大奖。根据英国《银行家》杂志发布 2012 年全球千家最大银行报告，交通银行一级资本位列第 30 位，连续第四年跻身全球商业银行 50 强。截至 2012 年 12 月 31 日，交通银行资产总额达到人民币 5.27 万亿元，实现净利润人民币 583.73 亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## 五、投资风险揭示

计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使计划资产面临潜在的风险。市场风险可以分为期货投资风险和债券投资风险。

#### 1. 期货投资风险主要包括：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

（3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

#### 2. 债券投资风险主要包括：

(1) 市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

(2) 债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

(3) 债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

## (二) 管理风险

在实际操作过程中，资产管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的投资品种的业绩表现不一定持续优于其他投资品种。

## (三) 流动性风险

在市场流动性不足的情况下，资产管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对计划收益造成不利影响。

在资产委托人提出追加或减少资产管理计划资产时，可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

此外，本资产管理计划不开放参与退出，也不接受资产委托人违约退出，资产委托人在资产管理计划存续期内面临一定流动性风险。

## (四) 信用风险

本计划交易对手方发生交易违约或者计划持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致资产管理计划财产损失。

## (五) 特定的投资方法及资产管理计划资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本计划采取的投资策略可能存在使计划收益不能达到投资目标或者本金损失的风险。

## （六） 操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

## （七） 衍生品风险

衍生品本身是一种权利，其价值是从一些基础资产价格、参考利率或指数中派生出来的，其评价主要源自于对标的资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险和操作风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使资产管理计划财产面临损失风险

## （八） 进取级受益人本金损失的风险

进取级受益人以其进取级资金保证优先级资金的安全，若计划清算时财产在支付管理费、托管费、税费并优先向优先级受益人分配利益后的剩余利益小于进取级资金，则进取级受益人遭受本金损失的风险。

## （九） 优先级受益人本金损失的风险

进取级受益人以其进取级资金保证优先级资金的安全，但是如果因管理计划单位净值低于止损线致使管理人对计划持有的证券资产进行变现，变现资金在支付管理费、托管费、税费后小于优先级资金的，优先级受益人遭受本金损失的风险。

## (十) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致资产委托人利益受损。

## 六、拟任投资经理简介

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定，且本投资经理与资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理不得相互兼任。

本资产管理计划投资经理为赵赫先生和杜位移先生。

投资经理简历：

赵赫先生，北京航空航天大学硕士。历任 AIG 公司助理副总裁，嘉实基金管理有限公司基金经理助理、中信证券投资经理等职。具有证券从业经验 8 年。

杜位移先生，货币银行学硕士。历任大成基金管理有限公司研究部副总监、市场部副总监，富国基金管理有限公司研究部副经理，东方基金管理有限公司投资部经理、基金经理、投委会委员。现任长盛基金管理有限公司专户理财部投资经理。具有证券从业经验 14 年。

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知资产委托人。资产管理人提前 3 个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

## 七、对资产委托人的服务

资产管理人承诺为资产委托人提供一系列的服务，以下是主要的服务项目，资产管理人根据资产委托人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，有权增加、修改服务项目：

## （一）在线客服

访问我公司网站“www.csfunds.com.cn”，登陆在线客服，与投资者网上面对面答疑解惑。

## （二）投资业务咨询

资产管理人拥有一支训练有素、专业知识全面的投资管理队伍，为更好地与资产委托人进行沟通，资产管理人的客户服务代表在工作时间内回答客户提出的问题，提供关于资产管理计划资产投资全方位的咨询服务。

## （三）投诉建议受理

如果对资产管理人提供的各种服务感到不满或有其他需求，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等各种方式随时向资产管理人提出，也可直接与客户服务人员联系，资产管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉；同时，资产委托人的合理建议是资产管理人发展的动力与方向。

## （四）语音留言服务

为加强沟通和联系，资产管理人在任何时间均提供语音留言服务，将资产委托人疑问或意见保存，客户服务人员将及时进行处理。

## （五）客服互动活动

资产管理人为资产委托人举办各种互动活动，如资产委托人见面会、理财讲座等，以加强资产委托人与资产管理人之间的互动联系。

## （六）长盛客户服务中心联系方式

长盛基金管理有限公司客户服务热线：（010）62350088；



400-888-2666（免长途话费）

长盛基金管理有限公司传真电话：（010）82274129

长盛基金管理有限公司网址：[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)

长盛基金管理有限公司客户服务电子信箱：[services@csfunds.com.cn](mailto:services@csfunds.com.cn)