

# 长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之 长信一带一路份额上市交易公告书

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2016年2月1日

公告时间：2016年1月27日

## 目录

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 一、重要提示与说明 .....            | 3  |
| 二、基金概览 .....               | 4  |
| 三、基金的募集与上市交易 .....         | 6  |
| 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 ..... | 9  |
| 五、基金主要当事人简介 .....          | 10 |
| 六、基金合同摘要 .....             | 16 |
| 七、基金财务状况 .....             | 43 |
| 八、基金投资组合 .....             | 45 |
| 九、重大事件揭示 .....             | 49 |
| 十、基金管理人承诺 .....            | 50 |
| 十一、基金托管人承诺 .....           | 51 |
| 十二、备查文件目录 .....            | 52 |

## 一、重要提示与说明

《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之长信一带一路份额上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）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内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人长信基金管理有限责任公司（以下简称“我公司”）的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人广发证券股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2015年6月23日登载于《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）以及长信基金管理有限责任公司网站（<http://www.cxfund.com.cn>）的本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

## 二、基金概览

1、基金名称：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

2、本次上市交易的基金份额场内简称及交易代码：

基础份额简称：带路分级；基金代码：502016

3、基金类型：股票型

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金份额分级

本基金的基金份额包括长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额（即“长信一带一路份额”）、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“长信一带一路A份额”）与长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“长信一带一路B份额”）。其中，长信一带一路A份额、长信一带一路B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

6、长信一带一路份额的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对长信一带一路份额进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合上海证券交易所风险控制要求的上海证券交易所会员单位，具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。

7、长信一带一路份额的跨系统转托管：基金份额持有人可以将持有的长信一带一路份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行跨系统转托管。

8、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的长信一带一路份额与长信一带一路A份额、长信一带一路B份额之间的配对转换，包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份长信一带一路份额的场内份额申请转换成1份长信一带一路A份额与1份长信一带一路B份额的行为；合并指基金份额持有人将其持有的每1份长信一带一路A份额与1份长信一带一路B份额申请转换成2份长信一带一路份额的场内份额的行为。本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并，场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

## 9、定期份额折算

在本基金存续期内，每年12月15日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日；若距离上一次基金份额折算不满3个月则可不进行折算），本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。

定期份额折算后长信一带一路A份额的基金份额参考净值调整为1.000元，基金份额折算基准日折算前长信一带一路A份额的基金份额参考净值超出1.000元的部分将折算为长信一带一路份额的场内份额分配给长信一带一路A份额持有人。长信一带一路份额持有人持有的每两份长信一带一路份额将按一份长信一带一路A份额获得新增长信一带一路份额的分配，经过上述份额折算后，长信一带一路份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的份额配比保持1:1的比例。

有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

## 10、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当长信一带一路份额的基金份额净值高至1.500元或以上；当长信一带一路B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下。

有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、基金份额总额：截至2016年1月25日，本基金的基金份额总额为21,973,583.54份，其中，一带一路基础份额16,604,865.54份，A类份额为2,684,359.00份，B类份额为2,684,359.00份。

12、本次上市交易的基金份额总额：截至2016年1月25日，一带一路基础份额为145,802.00份。

13、基金份额参考净值：截至2016年1月25日，一带一路基础份额净值为0.976元。

14、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

15、上市交易日期：2016年2月1日

16、基金管理人：长信基金管理有限责任公司

17、基金托管人：广发证券股份有限公司

18、上市推荐人：无

### 三、基金的募集与上市交易

#### (一) 本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2015年6月11日证监许可【2015】1212号

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2015年7月6日至2015年8月10日

5、发售期限：26个工作日

6、发售价格：1.00元人民币

7、发售方式：场外、场内认购

8、发售机构：

##### (1) 场内发售机构

具有基金代销业务资格的上海证券交易所会员单位(名单详见上海证券交易所网站)

##### (2) 场外发售机构

1) 直销机构：长信基金管理有限责任公司

2) 代销机构：

交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、长江证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、江海证券有限公司、中航证券有限公司、平安证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、西藏同信证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山

东) 有限责任公司、中山证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海汇付金融服务有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、大泰金石投资管理有限公司、上海联泰资产管理有限公司等。

9、验资机构名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

10、募集资金总额及入账情况：募集期间净认购金额 215,606,836.28 元人民币，该资金已于 2015 年 8 月 13 日全额划入本基金托管人在中国建设银行股份有限公司广州天河支行开立的本基金托管专户；认购资金的银行利息共计 61,351.31 元，已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户。本基金按照每份基金份额 1.00 元计算，募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计 215,668,187.59 份。募集期间基金管理人的从业人员认购的基金份额共计 2,290.76 份，占基金总份额比例占 0%，募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金 10,014,750.00 份，占基金总份额比例占 4.64%。

11、本基金募集备案情况：本基金于 2015 年 8 月 13 日验资完毕，2015 年 8 月 14 日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2015 年 8 月 17 日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2015 年 8 月 17 日。

13、基金合同生效日的基金份额总额 215,668,187.59 份。

## (二) 一带一路基础份额上市交易的主要内容：

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书 [2016]16 号

2、上市交易日期：2016 年 2 月 1 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、本次上市的基金份额简称及交易代码

基础份额简称：带路分级；

交易代码：502016

5、基金场内申购、赎回简称：带路分级

6、场内申购、赎回代码：502016

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更销售机构，并予以公告。

7、本次上市交易份额：基础份额为 145,802.00 份（截至 2016 年 1 月 25 日）

8、基金资产净值的披露：基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的基金份额参考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。

9、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的场外份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统持有人上海证券账户下后，即可在上海证券交易所上市交易。跨系统转托管及份额配对转换业务已于 2015 年 8 月 24 日开通。



## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### (一) 持有人户数

截至 2016 年 1 月 25 日, 本基金基础份额持有人户数为 1,185 户 (场外户数与拆分后的场内户数之和), 平均每户持有的基金份额为 14,012.54 份。其中, 场内基础份额持有户数为 331 户, 平均每户持有的基础基金份额为 440.49 份。

### (二) 持有人结构

截至 2016 年 1 月 25 日, 机构投资者持有的本次上市交易的场内基础基金份额为 234.00 份, 占本次基础份额上市交易基金份额比例为 0.16%; 个人投资者持有的本次上市交易的场内基础基金份额为 145,568.00 份, 占本次基础份额上市交易基金份额比例为 99.84%。

### (三) 前十名基金份额持有人的情况

截至 2016 年 1 月 25 日, 基础份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

| 序号 | 持有人名称 (全称) | 持有场内基础份额 (份) | 占场内基础份额比例 |
|----|------------|--------------|-----------|
| 1  | 李小亚        | 99,748.00    | 68.41%    |
| 2  | 莫伟南        | 2,246.00     | 1.54%     |
| 3  | 吴建生        | 2,244.00     | 1.54%     |
| 4  | 王皓         | 1,871.00     | 1.28%     |
| 5  | 李云梅        | 1,721.00     | 1.18%     |
| 6  | 吴柱培        | 1,371.00     | 0.94%     |
| 7  | 胡建彬        | 1,124.00     | 0.77%     |
| 8  | 冯薇         | 1,121.00     | 0.77%     |
| 9  | 庞万里        | 749.00       | 0.51%     |
| 10 | 孙凤环        | 749.00       | 0.51%     |

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：长信基金管理有限责任公司
- 2、法定代表人：叶烨
- 3、总经理：覃波
- 4、注册资本：1.5亿元人民币
- 5、注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基金字【2003】63号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：310101000315489
- 8、经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。

【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

- 9、存续期间：持续经营
- 10、股东及其出资比例：

|      | 股东名称         | 出资额       | 出资比例   |
|------|--------------|-----------|--------|
| 股权结构 | 长江证券股份有限公司   | 7350 万元   | 49%    |
|      | 上海海欣集团股份有限公司 | 5149.5 万元 | 34.33% |
|      | 武汉钢铁股份有限公司   | 2500.5 万元 | 16.67% |
|      | 总计           | 15000 万元  | 100%   |

### 11、内部组织结构及职能

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。我公司实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。根据我公司发展战略和组织管理原则，结合基金管理的业务特点，在经营管理层下设内部控制委员会、投资决策委员会等非常设委员会，以及投资管理部、研究发展部、交易管理部、固定收益部、量化投资部、产品开发部、专户理财部、基金事务部、零售服务部、机构业务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、国际业务部、电子商务部、财务管理部、机构服务部、专户理财部共 18 个部门，并设立了北京分公司、深圳分公司和武汉办事处。

#### 投资管理部

负责 A 股非固定收益类基金资产的投资运作和管理业务。

### **研究发展部**

负责投资组合的基础研究，主要负责收集、分析各类政治、经济与行业信息，研究宏观经济、资本市场、行业及上市公司的情况，为投资组合的投资决策提供建议和依据。

### **交易管理部**

负责制定交易管理的基本制度，核查指令的合规性，准确及时地执行交易指令，进行市场分析、询价，维护有关交易数据，协调与交易相关的业务关系等。

### **固定收益部**

负责分析和研究经济、货币政策和财政政策等有关信息，向投资决策委员会提供固定收益证券的投资策略和资产配置建议，负责公司固定收益类基金的投资运作和管理业务。

### **量化投资部**

负责各类投资组合的风险与业绩评估、数量分析研究、量化投资研究等工作。

### **产品开发部**

负责公司公募基金的产品设计开发工作和产品申报工作。

### **专户理财部**

负责特定客户资产管理业务的运作和管理工作。

### **基金事务部**

负责各类投资组合资产的清算、会计核算、注册登记、直销客户业务办理等业务。

### **零售服务部**

负责新基金发行以及基金日常持续营销的营销策划，营销方案实施，销售支持，品牌宣传，渠道维护，后台管理等工作，为客户提供增值服务。

### **机构业务部**

负责公司机构客户的开拓、维护、服务，为机构客户提供专业服务，根据客户需求提供各类产品和解决方案。

### **信息技术部**

负责提供信息系统支持，保障公司日常经营正常运转。

### **监察稽核部**

在公司内部行使监察稽核职能，负责公司的法律事务、信息披露、各项业务

的常规监察稽核和专项监察稽核等工作，在业务上接受督察长和内部控制委员会的指导和监督。

#### **综合行政部**

全面负责公司的行政后勤、人力资源的开发与管理等工作。

#### **国际业务部**

负责公司国际业务的开发和拓展工作。

#### **电子商务部**

负责公司电子商务平台建设，公司网站及网上直销系统功能策划，完善网站、微博及微信的营销、宣传、服务功能。

#### **财务管理部**

负责公司财务管理及自有资产管理等工作。

#### **机构服务部**

负责承接特定客户资产管理业务的支持性工作。

#### **专户投资部**

负责特定客户资产管理业务的投资运作等工作。

#### **北京分公司**

负责公司与中国证监会、托管银行等相关部门的沟通与联系，负责北方地区的各项业务的拓展工作。

#### **深圳分公司**

主要负责公司在华南地区的各项业务的拓展工作，同时负责公司与深圳证监局、总部设在华南的银行等相关部门的沟通与联系。

#### **武汉办事处**

负责公司在华中地区的各项联络性事务，不从事经营性活动。

#### **12、人员情况：**

截至 2016 年 1 月 25 日，公司现有正式员工 142 人，博士学历 3 人，占 2%；硕士学历 72 人，占 51%；本科学历 60 人，占 42%；专科学历 4 人，占 3%；其它 3 人，占 2%。

#### **13、信息披露负责人及咨询电话：**

周永刚，（021）61009999

#### 14、基金管理业务情况简介：

目前公司已具有发起设立公募基金、特定客户资产管理业务和合格境内机构投资者（QDII）业务资格、受托管理保险资金业务资格。

截至 2016 年 1 月 25 日，我公司目前已有 39 只开放式基金获批，其中已成立 31 只，1 只已获批正在发行，1 只发行结束尚未成立，6 只已获批未发行。这 39 只已获批基金分别为：2 只货币型基金（其中 1 只已获批未发行）、14 只债券型基金（其中 1 只发行结束尚未成立，2 只已获批未发行）、16 只混合型基金（其中 1 只已获批正在发行，1 只已获批未发行）、6 只股票型基金（其中 2 只已获批未发行）、1 只 QDII 基金。专户理财业务方面，我公司现管理 14 只“一对一”资产管理计划和 25 只“一对多”资产管理计划。

公司最近一年内没有因违法违规行为收到行政处罚或者刑事处罚，没有因违法违规行为正在被监管机构调查，或者处于整改期间，不存在对基金运作已经造成或可能造成不良影响的重大变更事项，或者诉讼、仲裁等其他重大事项，不存在公司治理不健全、经营管理混乱、内部控制和 risk 管理制度无法得到有效执行、财务状况恶化等重大经营风险。

#### 15、本基金基金经理：

左金保，经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员，现任长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。

邓虎，经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员，2015 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼、7 楼、18 楼、19 楼、38 楼、39 楼、40 楼、41 楼、42 楼、43 楼和 44 楼

法定代表人：孙树明

成立时间：1994 年 1 月 21 日

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510 号

注册资本：人民币 7,621,087,664 元

存续期间：长期

托管部门负责人：刘洋

信息披露负责人：王玮

电话：020-87555888

## 2、托管部门主要人员情况

刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘先生于 2000 年 7 月获得北京大学理学学士，并于 2003 年 7 月获得北京大学经济学硕士学位。

## 3、托管业务主要经营情况

广发证券于 2014 年 5 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。

## （三）上市推荐人

无

## （四）基金验资机构

名称：毕马威华振会计师事务所

法定代表人：姚建华

注册地址：北京东长安街1号东方广场东2座8层

联系电话：(021) 22122888

经办注册会计师：石海云、陈启明

## 六、基金合同摘要

### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金份额持有人的权利义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额、长信一带一路份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- 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) 依照法律法规及基金合同的规定，依法转让其持有的长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额与长信一带一路 B 份额，依法申请赎回其持有的长信一带一路份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- 1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；



- 2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- 3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- 4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- 5) 在其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；
- 6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- 7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- 9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1) 依法募集资金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- 9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- 11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

13) 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;

14) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

16) 在符合有关法律、法规的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;

17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

1) 依法募集资金, 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、谨慎勤勉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基金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, 不得利用基金财产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) 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, 按有关规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值, 确定长信一带一路份额的基金份额净值和申购赎回价格、长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值;

- 9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- 11) 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；
- 12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 13) 按《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基金收益；
- 14) 按规定受理长信一带一路份额的申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15) 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；
- 16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- 17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
- 18) 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；
- 19) 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；
- 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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23) 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实施其他法律行为;

24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26) 建立并保存基金份额持有人名册;

27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

(1) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的权利包括但不限于:

1) 自《基金合同》生效之日起, 依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

2) 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;

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;

4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算;

5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

6) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;

7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的义务包括但不限于:

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

2) 设立专门的基金托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;

3) 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, 确

保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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、证券账户、期货账户及投资所需的其他账户，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；

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予以保密，不得向他人泄露；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、长信一带一路份额的基金份额净值和申购、赎回价格，长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值；

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10) 对基金财务会计报告、季度、半年度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；

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12) 保存基金份额持有人名册；

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14) 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；

15) 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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

17) 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；

18) 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监管机构，并通知基金管理人；

19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应分别由长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设立日常机构。

### 1、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、基金托管人或单独或合计持有长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)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》，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；

2) 更换基金管理人；

3) 更换基金托管人；

4) 转换基金运作方式，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；

5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；

6) 变更基金类别；

7) 本基金与其他基金的合并，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；

8) 变更基金投资目标、范围或策略，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；

9) 变更基金份额持有人大会程序，但法律法规和中国证监会另有规定的除外；

10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

11) 终止长信一带一路 A 份额与长信一带一路 B 份额的运作；

12) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；

13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(2) 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

1) 调低基金管理费、基金托管费或其他应由基金承担的费用；

2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整长信一带一路份额的申购费率、赎回费率，或在基金持有人利益无实质性不利影响或不提高现有基金份额持有人适用费率的前提下，调整收费方式、增加新的基金份额类别；

4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

5) 对《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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

6) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；

7) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

8) 按照法律法规和《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、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《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；

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集；

(3) 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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(4) 单独或合计持有长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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，单独或合计持有长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）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。

(5) 单独或合计持有长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计持有长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。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。

(6) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。



### 3、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) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托证明的内容要求（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；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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，不影响表决意见的计票效力。

### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- 1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》

和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自基金份额应占权益登记日各自基金总份额的 50%以上（含 50%）。

(2) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自基金份额应占权益登记日各自基金总份额的 50%以上（含 50%）；

4) 上述第（3）项中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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

(3) 重新召集基金份额持有人大会的条件

若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第 1 款第（2）项、第 2 款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者所持有的有效长信一带一路份额、长信

一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自基金份额应占权益登记日各自基金总份额的三分之一（含三分之一）。

（4）在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（5）基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## 5、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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。

### （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下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议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）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人

姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，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 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额的各自基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额类别内有一票表决权。

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，一般决议须经参加大会的长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会的长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额各自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）通过方可做出。除本合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，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。

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。

## 7、计票

### (1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，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选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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒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。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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的决议。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。

本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### （三）基金收益分配原则、执行方式

在存续期内，本基金（包括长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额、长信一带一路 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会备案后，如果终止长信一带一路 A 份额与长信一带一路 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### 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）《基金合同》生效后的指数使用许可费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券、期货交易或结算费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）基金上市费用；
- （10）证券/期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- （11）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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款指令，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。如遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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款指令，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取。如遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### (3) 《基金合同》生效后的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用许可费。如上述指数使用许可协议约定的指数使用许可费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数使用许可费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，计算方法如下：

指数使用许可费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下

限为每季度 5 万元。指数使用许可费将按照上述指数使用许可协议的约定进行支付。

(4) 除基金管理费、基金托管费和基金的指数使用许可费之外的基金费用，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。

上述“1、基金费用的种类中第（4）—（11）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

(1) 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；

(2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

(3) 《基金合同》生效前的相关费用；

(4) 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基金费用的项目。

### 4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 5、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。调低费率不需要基金份额持有人大会决议通过，调高费率（但根据法律法规的要求调高该等报酬费率标准的除外）需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

## **（四）基金财产的投资方向和投资限制**

### 1、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、



权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以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。

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

## 2、投资限制

### （1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；

2) 本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

3) 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%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

5) 本基金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%；

6) 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%；

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规模的 10%；

9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

14) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%；

15) 基金投资流通受限证券时，遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字【2006】141 号）及相关规定执行；

16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。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。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，但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

## (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) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 5) 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；
- 6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## (五) 基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券/期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 2、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券、股指期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 3、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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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，按最近交易日的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估值方法估值；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估值方法估值；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) 本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(6) 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。

(7) 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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 4、估值程序

(1) 长信一带一路份额的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，长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值均精确到 0.001 元，小数点后第 4 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长信一带一路份额的基金份额净值，以及长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值，并按规定公告。

基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路 A 份额和长信一带一路 B 份额的基金份额参考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。

#### 5、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。当长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路 A 份额的基金份额参考净值或长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生估值错误时, 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) 估值错误类型

本基金运作过程中, 如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误, 导致其他当事人遭受损失的, 过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿, 承担赔偿责任。

上述估值错误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。

#### (2) 估值错误处理原则

1) 估值错误已发生, 但尚未给当事人造成损失时, 估值错误责任方应及时协调各方, 及时进行更正, 因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担; 由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误, 给当事人造成损失的, 由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任; 若估值错误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。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认, 确保估值错误已得到更正。

2) 估值错误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, 并且仅对估值错误的有关直接当事人负责, 不对第三方负责。

3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”), 则估值错误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估值错误责任方。

4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

5) 估值错误责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，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资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。如果基金管理人委托的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

### (3) 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### (4) 基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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) 错误偏差达到长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路 A 份额的基金份额参考净值或长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值的 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；错误偏差达到长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路 A 份额的基金份额参考净值或长信一带一路 B 份额的基金份额参考净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

3) 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。

## 6、暂停估值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人不能出售基金资

产或无法准确评估基金资产价值时；

(3) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### 7、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的基金份额参考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、长信一带一路份额的基金份额净值、长信一带一路A份额和长信一带一路B份额的基金份额参考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。

#### 8、特殊情形的处理

(1) 基金管理人按估值方法的第6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) 由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

### (六) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

#### 1、《基金合同》的变更

(1) 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

(2) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

#### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，并在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、



新基金托管人承接的；

(3) 《基金合同》约定的其他情形；

(4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3) 对基金财产进行估值和变现；

4) 制作清算报告；

5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

7) 对基金剩余财产进行分配；

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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小组优先从基金剩余财产中支付。

### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算长信一带一路份额、长信一带一路 A 份额与长信一带一路 B 份额各自的应计分配比例，并据此由长信

一带一路份额、长信一带一路 A 份额与长信一带一路 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 7、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。

#### （七）争议解决方式

双方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费、律师费由败诉方承担。

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。

《基金合同》受中国法律管辖。

#### （八）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金截至 2016 年 1 月 25 日的资产负债表如下：

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2016年1月25日 | 负债和所有者权益      | 本期末<br>2016年1月25日 |
|-------------|-------------------|---------------|-------------------|
| <b>资 产：</b> |                   | <b>负 债：</b>   |                   |
| 银行存款        | 15,621,260.89     | 短期借款          | —                 |
| 结算备付金       | 27,566.48         | 交易性金融负债       | —                 |
| 存出保证金       | 35,944.02         | —             | —                 |
| 交易性金融资产     | 6,065,543.40      | 卖出回购金融资产款     | —                 |
| 其中：股票投资     | 6,065,543.40      | 应付证券清算款       | —                 |
| 基金投资        | —                 | 应付赎回款         | 7,362.74          |
| 债券投资        | —                 | 应付管理人报酬       | 25,039.96         |
| 资产支持证券投资    | —                 | 应付托管费         | 5,508.80          |
| 贵金属投资       | —                 | 应付销售服务费       | —                 |
| 衍生金融资产      | —                 | 应付交易费用        | 12,960.97         |
| 买入返售金融资产    | —                 | 应交税费          | —                 |
| 应收证券清算款     | —                 | 应付利息          | —                 |
| 应收利息        | 18,185.42         | 应付利润          | —                 |
| 应收股利        | —                 | 递延所得税负债       | —                 |
| 应收申购款       | 3,789.54          | 其他负债          | 264,531.04        |
| 递延所得税资产     | —                 | 负债合计          | 315,403.51        |
| 其他资产        | —                 | <b>所有者权益：</b> |                   |
|             |                   | 实收基金          | 21,816,278.64     |
|             |                   | 未分配利润         | -359,392.40       |

|      |               |            |               |
|------|---------------|------------|---------------|
|      |               | 所有者权益合计    | 21,456,886.24 |
| 资产总计 | 21,772,289.75 | 负债和所有者权益总计 | 21,772,289.75 |

## 八、基金投资组合

截至 2016 年 1 月 25 日，本基金的投资组合如下：

### (一) 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                  | 6,065,543.40  | 27.86        |
|    | 其中：股票                 | 6,065,543.40  | 27.86        |
| 2  | 基金投资                  | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资                | -             | -            |
|    | 其中：债券                 | -             | -            |
|    | 资产支持证券                | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资                 | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资               | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产              | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 15,648,827.37 | 71.87        |
| 8  | 其他资产                  | 57,918.98     | 0.27         |
| 9  | 合计                    | 21,772,289.75 | 100.00       |

注：截至2016年1月25日，本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### (1) 指数投资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  | 采矿业              | 723,873.00   | 3.37         |
| C  | 制造业              | 3,167,322.40 | 14.77        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | 1,457,221.00 | 6.79         |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 578,103.00   | 2.69         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 127,864.00   | 0.6          |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| J | 金融业           | -            | -     |
| K | 房地产业          | -            | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | -            | -     |
| M | 科学研究和技术服务业    | 11,160.00    | 0.05  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -            | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -            | -     |
| P | 教育            | -            | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -            | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -            | -     |
| S | 综合            | -            | -     |
|   | 合计            | 6,065,543.40 | 28.28 |

## (2) 积极投资按行业分类的股票投资组合

截至2016年1月25日，本基金未积极投资股票。

## 2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

截至2016年1月25日，本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

## (三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 1、报告期末指数投资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  | 601106 | 中国一重 | 55,700.00 | 368,734.00 | 1.72         |
| 2  | 600028 | 中国石化 | 43,500.00 | 195,750.00 | 0.91         |
| 3  | 000063 | 中兴通讯 | 12,200.00 | 192,760.00 | 0.90         |
| 4  | 601857 | 中国石油 | 25,200.00 | 187,236.00 | 0.87         |
| 5  | 601668 | 中国建筑 | 34,000.00 | 184,280.00 | 0.86         |
| 6  | 601669 | 中国电建 | 24,600.00 | 172,938.00 | 0.81         |
| 7  | 601766 | 中国中车 | 16,100.00 | 171,465.00 | 0.80         |
| 8  | 601186 | 中国铁建 | 15,300.00 | 170,442.00 | 0.79         |
| 9  | 601989 | 中国重工 | 21,600.00 | 167,400.00 | 0.78         |
| 10 | 601390 | 中国中铁 | 18,700.00 | 164,934.00 | 0.77         |

### 2、报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

截至2016年1月25日，本基金未积极投资股票。

## (四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

截至2016年1月25日，本基金未持有债券。

## (五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

**细**

截至2016年1月25日，本基金未持有债券。

**(六) 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资产支持证券投资明细**

截至2016年1月25日，本基金未持有资产支持证券。

**(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

截至2016年1月25日本基金未持有贵金属。

**(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

截至2016年1月25日，本基金未持有权证。

**(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

截至2016年1月25日，本基金未投资股指期货。

**(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

截至2016年1月25日，本基金未投资国债期货。

**(十一) 投资组合报告附注**

1、截至2016年1月25日，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、截至2016年1月25日，本基金投资的前十名股票中不存在投资于超出基金合同规定备选股票库的情形。

**3、其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 35,944.02 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 18,185.42 |
| 5  | 应收申购款   | 3,789.54  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 57,918.98 |

**4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

截至2016年1月25日，本基金未持有债券。

#### **5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

截至2016年1月25日，本基金指数投资前十名的股票、积极投资前五名的股票中不存在流通受限情况。

#### **6、投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。



## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，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。

## 十二、备查文件目录

本基金备查文件包括以下文件：

（一）中国证监会关于准予长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册募集的文件；

（二）《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》；

（三）《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》；

（四）《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所

查阅方式：基金投资者可在办公时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（<http://www.cxfund.com.cn>）查阅。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

长信基金管理有限责任公司

2016年1月27日