

**长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型  
证券投资基金  
更新的招募说明书  
2016年第【1】号**

**基金管理人：长信基金管理有限责任公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**

**二〇一六年五月**

## 目 录

重要提示.....	2
第一章 绪言.....	3
第二章 释 义.....	4
第三章 风险揭示.....	7
第四章 基金的投资.....	12
第五章 基金投资组合报告.....	27
第六章 基金的业绩.....	38
第七章 基金管理人.....	40
第八章 境外投资顾问.....	52
第九章 基金的募集.....	53
第十章 基金合同的生效.....	54
第十一章 基金份额的申购和赎回.....	55
第十二章 基金的费用与税收.....	65
第十三章 基金的财产.....	67
第十四章 基金资产估值.....	68
第十五章 基金的收益与分配.....	71
第十六章 基金的会计与审计.....	73
第十七章 基金的信息披露.....	74
第十八章 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	78
第十九章 基金托管人.....	80
第二十章 境外托管人.....	82
第二十一章 相关服务机构.....	86
第二十二章 基金合同的内容摘要.....	99
第二十三章 基金托管协议的内容摘要.....	125
第二十四章 基金份额持有人服务.....	142
第二十五章 其他应披露事项.....	145
第二十六章 招募说明书存放及其查阅方式.....	147
第二十七章 备查文件.....	148
第二十八章 其他需投资者获悉的内容.....	149

## 重要提示

本基金经2010年11月9日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1586号文核准募集。

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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金主要投资于美国证券市场，基金净值会因为美国证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，并承担基金投资中出现的风险，一是投资风险，包括海外市场风险、政治风险等；二是运营风险，包括操作风险、会计核算风险、税务风险、法律风险等。请投资者充分关注这两类风险。投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读招募说明书及基金合同。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为2016年3月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日（财务数据经审计）。本基金托管人中国银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

## 第一章 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》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）以及《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

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。基金投资人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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二章 释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

本《基金合同》	指《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》及对该合同的任何有效的修订和补充
中国	指中华人民共和国（仅为《基金合同》目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
法律法规	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》
《试行办法》	指《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》
《通知》	《关于实施〈合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法〉有关问题的通知》
元	如无特指，指人民币
基金或本基金	指依据《基金合同》所募集的长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金
《招募说明书》	指《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书》，即供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新
托管协议	指基金管理人与基金托管人签订的《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
《发售公告》	指《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》
《业务规则》	指《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
外管局	指国家外汇管理局
基金管理人	指长信基金管理有限责任公司
基金托管人	指中国银行股份有限公司
境外托管人	指基金托管人委托的、负责基金境外财产的保管、存管、清算等托管服务的金融机构；
基金份额持有人	指根据《招募说明书》和《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
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基金销售与服务代理协议，代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指基金管理人直销机构及基金代销机构
基金销售网点	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点

注册登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司或接受长信基金管理有限责任公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受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
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人
机构投资者	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
投资者	指个人投资者、机构投资者和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
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
基金募集期	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月
存续期	指《基金合同》生效至终止之间的不定期期限
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所以及境外主要投资场所的正常交易日
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
T日	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日
T+n日	指自T日起第n个工作日（不包括T日）
认购	指在本基金募集期内投资者按照《基金合同》的规定购买本基金基金份额的行为
发售	指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	指《基金合同》生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为
赎回	指《基金合同》生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出本基金基金份额的行为
巨额赎回	单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回
基金账户	指注册登记机构给基金投资者开立的用于记录投资者持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销

	售机构托管到另一销售机构的行为
基金转换	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件, 申请将其持有的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其他基金的基金份额的行为
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
基金收益	指基金投资所得红利、股息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入
基金资产总值	指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产等形式存在的基金资产的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除基金负债后的净资产值
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
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额总额后得出的基金单位净值;
货币市场工具	指银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的金融工具
公司行为信息	指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动, 及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息, 包括但不限于权益派发、配股、提前赎回等信息
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体
不可抗力	指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况, 在基金管理人、基金托管人签署本基金合同之日后发生的, 使当事人无法全部或部分履行本基金合同的事件或因素, 包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害, 战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件

## 第三章 风险揭示

本基金主要投资于美国证券市场，基金净值会因为美国证券市场波动等因素而波动。基金投资中出现的风险分为如下三类，一是投资风险，包括但不限于海外市场风险、政治风险和政府管制风险、流动性风险、汇率风险、利率风险、信用风险、衍生品投资风险、税务风险、金融模型风险、成熟市场投资风险等；二是运营风险，包括但不限于操作风险、会计核算风险、交易结算风险、法律风险、证券借贷风险、基金托管人/境外托管人风险、证券经纪商风险等；三是与指数相关风险，包括但不限于指数的授权、编制、差错风险，由股价变化而导致指数实际运作中成员股权重不相等的风险等。

### 一、投资风险

主要是指由于证券市场变化所带来的风险。本基金的投资风险包括但不限于海外市场风险、政治风险和政府管制风险、流动性风险、汇率风险、利率风险、信用风险等。本基金将通过提高基金管理人员的业务水平、加强数量化的研究工作和严格执行风险控制政策来控制 and 降低投资风险。

#### （一）海外市场风险

由于本基金将投资于美国证券市场，美国经济所处的不同周期位置将对本基金的投资绩效产生影响。美国证券市场可能对于特定事件、该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反应较境内证券市场有诸多不同。并且美国证券交易市场对每日证券交易价格并无严格的涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间可能相对较大。以上所述因素可能带来市场的大幅度下跌，从而带来投资风险的增加。

#### （二）政治风险和政府管制风险

美国的政治经济等方面的重大事件和变革将对其证券市场产生影响，从而影响本基金的投资业绩。在特定的情况下，美国可能会通过该国或该地区的财政、货币、产业、地区发展等方面的政策进行管制，由此导致市场波动而影响本基金收益，产生风险。

#### （三）流动性风险

流动性风险是指金融资产不能迅速转变为现金而可能遭受折价损失的风险。



由于市场深度不够或者其他原因，导致投资机构不能在不影响市场价格的情况下买入或卖出证券。本基金面临的证券市场流动性风险主要表现在几个方面：基金资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的投资人大额赎回的风险；证券投资中个券和个股的流动性风险等。由于本基金主要投资美国超大市值蓝筹股票，因此每只成分股相对具有较好的流动性，变现成本也较低。

#### （四）汇率风险

由于本基金产品是以人民币销售与结算，主要投资于以美元标价的金融工具，并且来自该等资产的收入也将会以美元为单位，因此投资者面临汇率风险。也就是说，本基金投资在境外取得的美元计价的投资收益，可能会因为人民币升值被部分侵蚀，因此本基金的资产会受美元与人民币之间的汇率走势所影响。

#### （五）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损失。利率变化对美国股市有着重大影响，因此利率风险是本基金投资所面临的一个主要风险。另一方面，利率、息票利率、期限和到期收益率水平将对固定收益类证券有着决定性的作用，因此对本基金的资产配置产生影响。

#### （六）信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够按时足额还本付息的风险。一般认为国债的信用风险可以视为零或接近于零，而其它债券的信用风险可按专业机构的信用评级确定，信用等级的变化会迅速影响债券的价格，从而影响到基金资产。本基金所面临的信用风险主要来自于银行存款等货币市场金融工具。

#### （七）衍生品投资风险

由于衍生品的杠杆效应，投资衍生品的获利或损失将会被放大，由此会影响到基金资产的稳定性。由于本基金衍生品的投资主要是用于对冲风险和有效管理，而且所占比例相对较小，因此衍生品投资风险应当是有限的。本基金投资衍生品的目的是为了对冲风险，而不是投机，会通过控制规模、计算风险价值等手段来有效控制风险。

#### （八）税务风险

在投资不同国家和地区市场时，因税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向所在地区的税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能

会使得资产回报受到一定影响。

不同国家和地区的税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该等国家或地区缴纳基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

#### （九）金融模型风险

使用金融模型来进行资产定价、趋势判断、风险评估等来辅助做出投资决策，但因为模型错误、模型参数的估计错误、数据录入错误等原因，产生了错误的结论，从而给投资造成损失。

#### （十）成熟市场投资风险

本基金投资于美国成熟市场。成熟市场虽然制度较为健全，流动性较好，但近期由于受到次贷余波及全球金融危机的影响，其波动性风险有放大趋势，加大了成熟市场的投资风险。

## 二、运营风险

主要是指由于本基金后台运行和操作所带来的风险。本基金的运营风险包括但不仅限于操作风险、会计核算风险、交易结算风险、法律风险等。

#### （一）操作风险

操作风险是指本基金在交易和结算中，由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。具体包括两类：一是由于内部监管体系不完善、经营管理上出现漏洞、工作流程不合理等带来的风险；二是由于各种偶发性事故或自然灾害，如电脑系统故障、通讯系统瘫痪、地震、火灾、工作人员差错等给基金交易者造成损失的可能性。决定营运风险的形成及大小的主要因素包括管理漏洞和内部控制失当、交易员操作不当以及会计处理偏差等。

在具体操作上，公司坚持不断完善内部风险控制制度和作业流程，并严格执行；坚持业务复核原则和授权原则；建立集中交易制度；实行前后台分离，建立实时交易监测系统。此外，还注意不断提高风险管理人员的管理水平和业务水平；不断改进完善“长信基金风险管理与业绩评估系统”，加强投资决策的科学性；严格执行防火墙制度，保证基金资产的独立管理。

#### （二）会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险错

误，通常是指基金会计在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失。通过双会计制以及基金会计核算、托管方会计复核的方法可以有效控制会计核算风险。

### （三）交易结算风险

当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值等风险。本基金将通过国际性的专业清算公司统一进行交易结算，规避结算风险。

### （四）法律风险

指由于本基金交易合约的条款在法律上有缺陷或缺失法律的支持等原因可能导致的风险。本基金将本着审慎的原则按照中国证监会的要求选择交易对手，并借助于本基金聘请的律师严格履行合约的各项条款与内容，同时关注相应国家或地区法律环境的变化，有效规避法律风险。

### （五）证券借贷风险

证券借贷风险是指作为证券借出方，如果交易对手方违约，则本基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致本基金资产发生损失。

### （六）基金托管人/境外托管人风险

基金托管人/境外托管人风险是指基金托管人或境外托管人在托管基金资产的过程中，由于自身或外在因素，可能在资金调拨、证券交割和报表编制等环节出现差错，导致本基金资产受到损失。

### （七）证券经纪商风险

证券经纪商风险是指证券经纪商的财务状况与经营水平不断变化，当它们由于自身或外在的不利因素而出现薄弱环节时，会影响到本基金的投资管理与交易活动，可能导致本基金资产受到损失。本基金投资衍生品的目的是为了对冲风险，而不是投机，会通过控制规模、计算风险价值等手段来有效控制风险。

## 三、与指数相关的风险

主要是指由于本基金标的指数的特征和指数变化所带来的风险。本基金与指数相关风险包括但不限于指数的授权、编制、差错风险，由股价变化而导致指

数实际运作中成员股权重不相等的风险等。

#### （一）指数的授权、编制、差错风险

指数的授权、编制、差错风险是指标的指数提供商Standard & Poor's Financial Services LLC依据合作协议的相关条款停止编制发布标的指数或取消对本基金使用标的指数的授权，以及标的指数在编制发布和调整过程中发生的人为或系统性差错。

当标的指数提供商Standard & Poor's Financial Services LLC停止标的指数的编制发布或取消对本基金使用标的指数的授权等非因本基金管理人原因导致本基金无法继续使用标的指数的情形时，基金管理人按照维护基金份额持有人合法权益的原则，依据具体情况分析拟采用的标的指数变更方案是否会对基金份额持有人利益产生实质性不利影响，由此决定是否采用召开基金份额持有人大会的方式决定标的指数变更事宜。

针对标的指数提供商Standard & Poor's Financial Services LLC发布的因成分股公司行为或季度再平衡等原因导致的指数编制发布和调整，本基金将做相关计算和测试，由此降低或避免标的指数在编制发布和调整过程中发生的人为或系统性差错。

#### （二）权重不相等的风险

权重不相等的风险是指在基金实际运作中由于股价的变化导致指数成员股的权重不相等。本基金依据标的指数提供商 Standard & Poor's Financial Services LLC 有关指数权重调整的相关规定，每个季度对投资组合进行一次调整，由此降低指数成员股权重不相等的风险。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

## 第四章 基金的投资

### 一、投资目标

本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和标普 100 等权重指数（本基金的标的指数）收益率之间的日均跟踪误差控制在 0.50% 以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94% 以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。

### 二、基准货币

人民币

### 三、投资范围

本基金主要投资于标普 100 等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为股票指数增强型基金，对标普 100 等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的 80%-95%；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的 5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的 0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

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

### 四、投资理念

本基金将采用“指数化投资为主、主动性投资为辅”的投资理念，在最小化

和控制跟踪误差的基础上通过有效的资产及行业组合和基本面研究力求投资收益能够有效跟踪并适度超越标的指数。

## 五、投资和组合管理策略

本基金为股票指数增强型基金，原则上不少于80%的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普100等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化、进行相应的调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生品投资管理等，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

对于不高于基金净资产15%的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

### （一）资产配置策略

本基金的资产配置体现了股票指数增强型基金的基本投资策略：在最小化跟踪误差的前提下力争获得超出标的指数回报。基金资产净值80%–95%的部分将投资于标普100等权重指数成份股；基金资产净值0%–15%的增强型部分将主要投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券等货币市场工具占基金资产净值的5%–20%。资产配置比例主要取决于基金管理人对于宏观经济、估值水平、技术因素等的分析和判断以及对本基金现金流的预计和管理，主要考虑因素包括但不限于以下几点：

- 1、经济的增长率；
- 2、利率政策和通胀水平；
- 3、各种资产的收益和风险比较；

- 4、各种资产的估值水平比较；
- 5、市场流动性；
- 6、本基金现金流。

## （二）股票投资策略

本基金的股票投资将遵循被动投资和主动投资的双重策略。被动投资将通过完全复制的指数化策略来实施，主要目标为控制和最小化跟踪误差；主动投资将以基本面研究为基础，力争取得优于标的指数的收益率。

### 1、指数化投资

不少于 80% 的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普 100 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化、进行相应的调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

#### （1）对标的指数的跟踪调整

标准普尔公司会定期和不定期根据成员变化、股价变化、并购、特殊分红等进行成份股及权重调整，本基金将根据标准普尔公司的公告并在规定时间内进行相应调整。

#### （2）跟踪误差的控制和再平衡调整

本基金追求基金净值增长率与标普 100 等权重指数收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在 0.50% 以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94% 以内），以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金采取跟踪误差和跟踪偏离度这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金每周计算上述跟踪误差。如果该指标接近或者超过 0.5%，并且跟踪偏离度小于 0，则本基金管理人将通过数量分析找出跟踪误差的来源，即考察某一阶段的跟踪误差指标分别来源于交易费用、投资组合与指数成份股所含股票的

差别和权重的偏离的比例，并在适当的时机进行再平衡调整操作，使得跟踪误差回复到最大容忍值以下。

## 2、主动型投资

对于不高于基金净资产 15% 的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

证券选择的起点是通过定量和定性方式初步筛选投资领域，以便发现值得深入研究的公司。在初步筛选阶段将以数量化模式为主要手段，具体筛选因素包括市值、流动性、现金流、负债率、估值水平、销售收入和净收入的增长等。

经过筛选的公司将以行业分类，结合对宏观经济和行业周期的研究和判断以及标普 100 等权重指数的行业配置比例，基金管理人将对主动投资基金净值作合理的行业配置。各个行业内的公司将以各种基本面指标进行综合评级，进一步筛选投资的目标公司，本基金管理人认为这样的公司往往据有以下特征：

- (1) 在市场及行业内拥有主导地位，并能获取超额利润；
- (2) 所处行业据有较高的成长潜力；
- (3) 公司的主导地位和竞争优势据有可延续性，市场进入壁垒较高；
- (4) 公司内在价值（intrinsic value）高于当前市场价值，并且下降空间有限，使得股票据有较强的风险和回报的特质。

当选择出具有上述特征的企业后，本基金将基于动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的评估方法，如自由现金流贴现法（DCF）、红利贴现法（DDM）、各部分累加法（Sum-of-the-Part）、市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）等，对入选股票进行价值评估，在此基础上选择股价没有充分反映价值的投资目标。

以基本面为基础的主动投资是本基金争取超值回报的主要手段，在适当的时机下基金管理人也将采取以下策略力争获取超越标的指数的收益率：

### 1) 适当调整成分股权重的主动性投资



本基金将依据宏观经济形势和经济周期各个阶段不同行业表现以及当前各个行业估值水平,并采用数量化分析与基本面研究相结合的方法对目标指数的成份股进行综合评分,在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后,本基金将适度增加排名靠前成份股的权重以及适度减少排名靠后成份股的权重。成分股权重的适当调整将在确保本基金的跟踪误差和跟踪偏离度在规定范围之内的前提下进行。

## 2) 前瞻性纳入部分备选成份股

如果预期目标指数的成份股将会发生调整,本基金管理人将视当时具体情况,在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上,决定是否提前纳入部分备选成份股。

## (三) 固定收益证券投资策略

本基金固定收益证券的投资以流动性管理需要和低风险为主要投资依据,收益率水平为辅助投资依据,由此给现金流管理提供良好的基础。本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势,并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析,评定各品种的投资价值,同时着重考虑基金的流动性管理需要,主要选取到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券和银行存款等货币市场证券将作为主要的投资工具。

## (四) 其他金融衍生品投资策略

在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生品对基金投资组合进行管理,以提高投资效率,管理基金投资组合风险水平,以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生品必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的,不得应用于投机交易目的,或用作杠杆工具放大基金的投资。

### 1、金融衍生品主要投资策略包括:

(1) 规避风险:本基金可利用货币远期和货币互换来对冲人民币和美元之间的汇率风险,避免汇率的波动性对基金的回报率和回报率的波动率产生负面影响;本基金也可利用相关的指数期货和指数期权及个股期权对市场的系统性风险和个股风险进行对冲。

(2) 有效管理：本基金在建仓期及发生大规模申购或赎回时，大量买入或卖出会造成股价的短期波动而抬高交易成本，可以利用金融衍生品的流动性和杠杆作用进行短期的替代，以降低交易成本。本基金也可将待投资的现金暂时投资于相关的指数期货，以此降低和标的指数的跟踪误差。

## 2、主要金融衍生品及简介

金融衍生品通常是指从基础资产 (Underlying Assets) 派生出来的金融工具，这种金融工具的回报率是根据基础资产和一些其它金融要素的表现情况衍生出来的，比如利率，汇率，波动性、各种指数（股票指数，消费者物价指数，以及天气指数）等。这些要素的表现将会决定一个衍生品的回报率和回报时间。金融衍生品的共同特征是保证金交易，即只要支付一定比例的保证金就可进行全额交易，不需实际上的本金转移，合约的了结一般也采用现金差价结算的方式进行，只有在满期日以实物交割方式履约的合约才需要买方交足贷款。所以金融衍生品具有杠杆性和高风险性。金融衍生品的主要类型有互换 (Swap)，权证 (Warrant)，期权 (Options)，期货 (Futures)、远期 (Forward) 等。

(1) 互换是指当事双方同意在预先约定的时间内，通过一个中间机构来交换一连串付款义务的金融交易，或者说是当事双方同意在预先约定的时间内用一种现金流交换另一种现金流。互换协议规定了现金流交换的时间和计算的方式。一般来说，互换协议中至少有一种现金流是由利率，汇率，股权价格，或商品价格来决定的。互换中的现金流通常是依照一个本金单位来计算的。本金单位一般不会在当事双方之间交换。比较常见的互换交易包含货币互换 (Currency Swap) 和利率互换 (Interest Rate Swap) 两种。现在互换是世界上交易量最大的金融产品之一。

(2) 权证是基础证券发行人或其以外的第三人发行的，约定持有人在规定期间内或特定到期日，有权按约定价格向发行人购买或出售标的证券，或以现金结算方式收取结算差价的有价证券。投资者付出权利金购买后，有权利（而非义务）在某一特定期间（或特定时点）按约定价格向发行人购买或者出售标的证券。很多时候权证被当作一种附于债券或者优先股的优惠券，使得债券或者优先股的发行者能够付更低的利息或者股息。权证也可以提高债券的收益，从而使得债券对投资者来说更具有吸引力。一般来说权证可以被拆分，独立于依附的债券或者

股票进行买卖。

(3) 期权合约是一种赋予权利而不是义务的标准化契约，即在某一段特定时间内，以期权合约成交时双方同意的期权费，买卖特定价格，特定数量与质量的相关产品。买入期权是指它给予期权的持有者在给定时间或在此时间以前的任一时刻按规定的价格买入一定数量某种资产或期货合约的权利的一种法律合同。卖出期权给予其持有者在给定时间或在此时间以前的任一时刻，按规定的价格卖出一定数量某种资产或期货合约的权利的一种法律合同。期权的持有者拥有该项期权规定的权利，持有者可以行使该权利，也可以放弃该权利，期权的出卖者则只有期权合约规定的义务。

(4) 期货一般指由期货交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。这个标的物，又叫基础资产，是期货合约所对应的现货，可以是某种商品，如铜或原油，也可以是某个金融工具，如外汇、债券，还可以是某个金融指标，如三个月同业拆借利率或股票指数。期货合约的买方，如果将合约持有到期，就有义务买入期货合约对应的标的物；而期货合约的卖方，如果将合约持有到期，就有义务卖出期货合约对应的标的物。期货合约的交易者还可以选择在合约到期前进行反向买卖来冲销这种义务。

(5) 远期又称远期合同，是指当事双方现在同意在将来的特定时间以特定价格买卖某种资产。远期合同是和现货合同相对应的，而现货合同是指同意当前以特定价格买卖某种资产。远期合同中当事双方同意的价格被称为交割价格。同意将来买入资产的一方被称为多方，同意将来卖出资产的一方被称为少方。在远期合同中，资产价格的交换发生在资产控制权的交换之前，因此远期是一种买卖交易发生在资产交换之前的合同。远期价格一般和现场价格相对应，现场价格是指当前资产交换的价格。远期价格和现场价格的差别一般叫做远期溢价或远期折价，通常是远期合同购买者的利润或损失。

### 3、金融衍生品风险管理机制

本基金根据金融衍生产品的高风险、高杠杆特性，制定了金融衍生品投资风险控制策略和严格的投资风险控制流程。金融衍生品投资风险控制策略分为事前风险识别、事中风险跟踪及控制和事后风险评估总结三个方面：

(1) 事前风险识别主要包括宏观环境分析、市场分析、衍生品合约细则的

认识和分析、衍生品流动性分析、衍生品波动率分析等。

(2) 事中风险跟踪及控制主要包括金融衍生品投资仓位的监控和预警、衍生品在值风险 (VaR) 估算和预测、情景分析、压力测试以及金融衍生品投资合规性的日常检查和警示等。

(3) 事后风险评估总结主要包括对金融衍生品投资盈利或损失的归因分析和总结。

#### 4、金融衍生品的投资方式及频率

本基金主要投资与在美国市场上市交易的金融衍生品, 当交易所没有本基金需要的金融衍生品时, 可采用场外交易市场 (OTC) 进行买卖。

本基金采用金融衍生品的时间和频率将根据投资策略、市场环境、申购赎回等因素决定。

随着美国证券市场投资工具的发展和丰富, 基金可相应调整和更新相关投资策略, 并在基金更新的招募说明书中披露。

在符合有关法律法规以及本基金基金合同规定的投资限制前提下, 本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资, 以提高收益。

## 六、投资决策依据与决策程序

### (一) 决策依据

- 1、国家和证监会有关法律法规和本《基金合同》的有关规定;
- 2、标的指数的编制方法及其调整;
- 3、宏观经济形势、货币和财政政策、利率走势和通货膨胀预期、市场流动性及行业周期;
- 4、各种资产的估值水平和预期收益及风险的比较。

### (二) 投资决策程序

公司在内部建立了包括投资决策委员会、国际业务部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、金融工程部以及交易管理部等部门在内的完整的投资决策程序。

本基金采用投资决策委员会指导下的基金经理负责制。

1、国际业务部是管理本基金的主要业务部门, 基金经理和研究员依托公司整体研究平台, 整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展宏观经济

及数量化的研究；在金融工程部的协助下开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据；

2、公司投资决策委员会依据国际业务部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，审议决策相关事项。国际业务部根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策；

3、依据标的指数的组成和基本面研究，国际业务部以完全复制指数成份股的方法结合主动投资选股构建组合。在将跟踪误差和偏离度控制在规定范围内的前提下，基金经理将采取适当的策略追求优于标的指数的回报，同时控制投资风险；

4、交易管理部根据投资管理部的投资指令，进行基金资产的日常交易活动，对交易情况及时反馈，并对投资指令进行监督，遇有异常情况要及时向投资总监反映，同时对投资指令进行合规性检查；

5、国际业务部和金融工程部的风险与业绩评估人员定期对基金投资组合进行业绩和风险评估，提供基金业绩评估报告，确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，并提出风险控制意见，作为投资决策委员会调整风险控制策略和评估投资业绩的参考；

6、国际业务部将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数；

7、监察稽核部负责监督整个投资交易全过程是否有违反国家相关法律、法规和规章制度的规定，检查有无涉嫌内幕交易、侵犯持有人权益的行为；

8、国际业务部在确保基金持有人利益的前提下，有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

## **七、业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为：标准普尔 100 等权重指数总收益率

本基金为增强型股票指数基金，不低于基金资产净值 80% 的部分将投资于标准普尔 100 等权重指数成份股，不高于基金资产净值 15% 的增强型部分将主要投资于在美国公开上市的权益类证券。因此，本基金设置标准普尔 100 等权重指数

总收益率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、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业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 八、风险收益特征

本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

## 九、投资限制

（一）为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、购买不动产；
- 5、购买房地产抵押按揭；
- 6、购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- 7、购买实物商品；
- 8、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- 9、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- 10、参与未持有基础资产的卖空交易；
- 11、直接投资与实物商品相关的衍生品；
- 12、向基金管理人、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债券；
- 13、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
- 14、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 15、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述限制，在可适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

## （二）投资组合限制

1、对标普100等权重指数的成份股的投资不低于基金资产净值的80%。

2、基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

3、为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

4、基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

5、单只基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

6、基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。

7、基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。

8、本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：（1）所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；（2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；（3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

9、本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的10%，持有货币市场基金可以不受该等限制。

10、基金合同、中国法律法规及中国证监会规定的其他限制。

若基金超过上述2、4、5、9项规定的投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制的要求。

## （三）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

2、应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。

3、借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

4、除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

(1) 现金；

(2) 存款证明；

(3) 商业票据；

(4) 政府债券；

(5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

5、本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

6、基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

(四) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

2、参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

3、买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

4、参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

5、基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。



(五) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

(六) 若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### (七) 投资组合比例调整

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约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

### 十、基金管理人代表基金行使所投资证券产生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及债权人权利，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。

### 十一、基金的上市交易

若将来基金管理人认为有必要，基金管理人在履行适当程序后可将本基金相应调整为上市开放式基金（LOF）的模式，并对本基金的投资运作、基金估值等相关内容进行调整，届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会核准后在指定媒体上公告。

### 十二、代理投票

(一) 基金管理人作为基金投资者的代理人，将行使股票的代理投票权。在代理投票时，公司将本着投资者利益最大化的原则，按照增加股东利益、提高股东发言权的原则提出代理投票的建议。

(二) 代理投票权的决定将由基金经理做出。公司将保留代理投票的文件至

少三年以上。

(三) 基金管理人可委托境外境外托管人进行代理投票。

(四) 在某些中国以外的法域中,就基金组合内公司的股份行使投票权的股东可能被限制在股东大会召开日期前后的一段时间内对股票进行交易。由于此类交易限制会妨碍组合管理且可能导致基金的流动性受损,如果存在此类限制,基金管理人一般情况下将不行使代理投票权。此外,某些中国以外的法域要求投票的股东就不同的基金披露当前的持股情况,如果存在此类披露要求,基金管理人在一般情况下将不行使委托投票权,以保护基金持有信息。

(五) 基金将保留委托投票权的记录,至少保存3年以上。其中包括:

1、基金作为证券持有人收到的有报告义务的发行人的证券持有人会议相关的材料;

2、发行人的名称;

3、组合证券的交易所代码;

4、会议日期;

5、会议上需投票的事项的简要描述;

6、需投票的事项是否由发行人、其管理层或其他人或公司提出;

7、基金是否对该等事项进行了投票;

8、基金如何就该等事项进行了投票;

9、基金的投票是赞成还是反对发行人的管理层的提议。

### 十三、证券交易

(一) 券商的交易执行能力、研究实力和提供的研究服务,这是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准,包括以下几个方面:

交易执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有:是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响等;

研究机构的实力和水平。主要是指券商能否所提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告,报告内容是否详实,投资建议是否准确;

提供研究服务的质量。主要指券商承接调研课题的态度、协助安排上市公司

调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座。

(二)基金管理人根据上述标准对境外券商进行遴选,拟定交易量分仓比例,并每季度进行调整。

考核内容包括:服务质量、证券推荐的成功率、交易的执行力等因素。

考核采取打分制,打分采取加权平均的办法,主要有以下方面:交易执行能力(40%)、研究能力(30%)、服务质量(30%)。

(三)每家券商的分仓比例上限为50%,具体分仓计算公式为:50%×考核得分/5。

(四)对于在券商选择和分仓中存在或潜在的利益冲突,基金管理人应该本着维护持有人的利益出发进行妥善处理,并及时进行披露。

(五)交易佣金的返还。基金管理人每年年初根据对券商的评价和考核,与券商签订服务协议,在协议中规定详细的交易佣金的收取标准,严格禁止佣金返还的情况出现。

## 第五章 基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月复核了本报告中的财务指标、净值表现和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2015年12月31日(摘自本基金2015年年报)。

### 一、期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,650,983.85	77.98
	其中：普通股	15,650,983.85	77.98
	存托凭证	—	—
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	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	货币市场工具	—	—
8	银行存款和结算备付金合计	2,752,244.45	13.71
9	其他各项资产	1,667,227.62	8.31
10	合计	20,070,455.92	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

## 二、期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	15,650,983.85	82.09
合计	15,650,983.85	82.09

## 三、期末按行业分类的权益投资组合

### 1、期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
金融	2,673,789.72	14.02
保健	2,231,712.86	11.71
工业	2,182,918.98	11.45
信息技术	2,178,601.62	11.43
非必须消费品	2,172,818.17	11.40
必须消费品	1,745,198.03	9.15
能源	1,362,028.38	7.14
材料	456,999.31	2.40
公共事业	327,551.47	1.72
电信服务	318,834.13	1.67
合计	15,650,452.67	82.09

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 2、期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	531.18	0.00
合计	531.18	0.00

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 四、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

### 1、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所有权益投资 明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克	美国	219.00	170,310.50	0.89
2	ABBVIE INC	艾博维公 司	ABBV US	纽交所	美国	439.00	168,874.90	0.89
3	BIOGEN INC	百健艾迪	BIIB US	纳斯达克	美国	84.00	167,102.41	0.88
4	AMAZON.COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	纳斯达克	美国	38.00	166,780.45	0.87
5	EXELON CORP	Exelon公 司	EXC US	纽交所	美国	915.00	164,999.45	0.87
6	BLACKROCK INC	贝莱德有 限公司	BLK US	纽交所	美国	74.00	163,628.85	0.86
7	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地 产集团公 司	SPG US	纽交所	美国	129.00	162,877.41	0.85
8	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	纽交所	美国	242.00	162,755.20	0.85
9	SOUTHERN CO	南方	SO US	纽交所	美国	535.00	162,552.02	0.85
10	MONSANTO CO	孟山都	MON US	纽交所	美国	254.00	162,496.37	0.85
11	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克	美国	500.00	162,291.30	0.85
12	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电 气	EMR US	纽交所	美国	522.00	162,127.40	0.85
13	EXXON MOBIL CORP	艾克森美 孚石油	XOM US	纽交所	美国	320.00	161,976.36	0.85
14	CVS CAREMARK CORP	CVS公司	CVS US	纽交所	美国	255.00	161,894.21	0.85
15	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	Mondelez 国际公司	MDLZ US	纳斯达克	美国	555.00	161,601.03	0.85
16	AMGEN INC	安进	AMGN US	纳斯达克	美国	153.00	161,278.23	0.85
17	WALGREEN BOOTS ALLTANCE	Walgreen s Boots Alliance 公司	WBA US	纳斯达克	美国	291.00	160,912.12	0.84
18	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal控 股股份有 限公司	PYPL US	纳斯达克	美国	684.00	160,786.73	0.84
19	CHEVRON CORP	雪佛龙德	CVX US	纽交所	美国	275.00	160,645.17	0.84

		士古						
20	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	美国国际集团	AIG US	纽交所	美国	399.00	160,560.95	0.84
21	ALLERGAN PLC	眼力健有限公司	AGN US	纽交所	美国	79.00	160,310.75	0.84
22	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT US	纽交所	美国	363.00	160,193.74	0.84
23	CISCO SYSTEMS INC	思科系统	CSCO US	纳斯达克	美国	907.00	159,934.71	0.84
24	AT&T INC	美国电话电报集团	T US	纽交所	美国	715.00	159,763.01	0.84
25	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	纽交所	美国	165.00	159,634.44	0.84
26	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	WMT US	纽交所	美国	400.00	159,223.07	0.84
27	ALTRIA GROUP INC	高利特	MO US	纽交所	美国	421.00	159,134.82	0.83
28	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	纽交所	美国	1,739.00	159,109.50	0.83
29	UNITED TECHNOLOGIES CORP	联合技术	UTX US	纽交所	美国	255.00	159,079.24	0.83
30	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	纽交所	美国	371.00	159,074.56	0.83
31	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信	VZ US	纽交所	美国	530.00	159,071.12	0.83
32	MASTERCARD INC-CLASS A	万事达卡	MA US	纽交所	美国	251.00	158,686.44	0.83
33	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	纽交所	美国	784.00	158,584.10	0.83
34	FACEBOOK INC-A	Facebook 公司	FB US	纳斯达克	美国	233.00	158,351.50	0.83
35	INTL BUSINESS MACHINES CORP	国际商业机器	IBM US	纽交所	美国	177.00	158,175.91	0.83
36	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克	美国	439.00	158,156.30	0.83
37	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽交所	美国	360.00	158,051.63	0.83
38	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	纽交所	美国	135.00	157,996.11	0.83
39	METLIFE INC	大都会集团	MET US	纽交所	美国	504.00	157,780.45	0.83

40	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	纽交所	美国	243.00	157,668.24	0.83
41	COLGATE-PALMO LIVE CO	高露洁棕 榄	CL US	纽交所	美国	364.00	157,467.72	0.83
42	PCLN US	Pricelin e集团	PCLN US	纳斯达克	美国	19.00	157,301.29	0.83
43	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	纽交所	美国	305.00	157,275.32	0.82
44	MCDONALD' S CORP	麦当劳	MCD US	纽交所	美国	205.00	157,266.55	0.82
45	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	纽交所	美国	312.00	157,116.55	0.82
46	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	纽交所	美国	445.00	157,081.48	0.82
47	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫 里斯国际 集团	PM US	纽交所	美国	275.00	156,984.40	0.82
48	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施 贵宝	BMJ US	纽交所	美国	351.00	156,789.86	0.82
49	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	纽交所	美国	562.00	156,778.36	0.82
50	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽交所	美国	205.00	156,600.96	0.82
51	LOWE' S COS INC	劳氏	LOW US	纽交所	美国	317.00	156,526.15	0.82
52	GILEAD SCIENCES INC	Gilead科 学	GILD US	纳斯达克	美国	238.00	156,386.80	0.82
53	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	纽交所	美国	182.00	156,297.71	0.82
54	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	纽交所	美国	465.00	156,260.37	0.82
55	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批 发	COST US	纳斯达克	美国	149.00	156,258.74	0.82
56	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽交所	美国	234.00	156,083.29	0.82
57	TARGET CORP	Target百 货	TGT US	纽交所	美国	331.00	156,066.60	0.82
58	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	纽交所	美国	455.00	156,061.34	0.82
59	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	BERKSHIR E HATH-B	BRK/B US	纽交所	美国	182.00	156,049.52	0.82
60	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽交所	美国	535.00	156,020.75	0.82
61	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	纽交所	美国	285.00	155,937.96	0.82



62	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	纽交所	美国	307.00	155,894.45	0.82
63	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通公司	AXP US	纽交所	美国	345.00	155,812.31	0.82
64	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约银行	BK US	纽交所	美国	582.00	155,781.72	0.82
65	US BANCORP	US Bancorp 公司	USB US	纽交所	美国	562.00	155,720.03	0.82
66	ALLSTATE CORP	全州保险	ALL US	纽交所	美国	386.00	155,630.42	0.82
67	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽交所	美国	740.00	155,113.92	0.81
68	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马丁	LMT US	纽交所	美国	110.00	155,109.38	0.81
69	INTEL CORP	英特尔	INTC US	纳斯达克	美国	693.00	155,027.23	0.81
70	BANK OF AMERICA CORP	美国银行	BAC US	纽交所	美国	1,418.00	154,969.37	0.81
71	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽交所	美国	310.00	154,841.19	0.81
72	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	纳斯达克	美国	397.00	154,754.89	0.81
73	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	纽交所	美国	173.00	154,309.24	0.81
74	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽交所	美国	340.00	153,995.72	0.81
75	BOEING CO/THE	波音	BA US	纽交所	美国	164.00	153,981.18	0.81
76	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲	ACN US	纽交所	美国	226.00	153,359.35	0.80
77	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	纽交所	美国	740.00	152,855.45	0.80
78	EMC CORP/MASS	EMC公司	EMC US	纽交所	美国	916.00	152,748.17	0.80
79	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	纽交所	美国	376.00	152,599.60	0.80
80	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	ups 公司	UPS US	纽交所	美国	244.00	152,470.51	0.80
81	TIME WARNER INC	时代华纳	TWX US	纽交所	美国	363.00	152,438.62	0.80
82	RAYTHEON COMPANY	雷神公司	RTN US	纽交所	美国	188.00	152,025.83	0.80
83	GENERAL MOTORS CO	通用汽车	GM US	纽交所	美国	687.00	151,722.12	0.80
84	ORACLE CORP	甲骨文公司	ORCL US	纳斯达克	美国	638.00	151,340.75	0.79
85	ANADARKO	阿纳达科	APC US	纽交所	美国	479.00	151,104.90	0.79

	PETROLEUM CORP	石油						
86	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF US	纽交所	美国	322.00	150,923.99	0.79
87	3M CO	3M公司	MMM US	纽交所	美国	154.00	150,642.17	0.79
88	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克	美国	410.00	150,237.88	0.79
89	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	纽交所	美国	422.00	150,195.80	0.79
90	WALT DISNEY CO/THE	沃尔特迪斯尼	DIS US	纽交所	美国	220.00	150,116.45	0.79
91	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽交所	美国	493.00	149,470.79	0.78
92	DOW CHEMICAL CO/THE	陶氏化学	DOW US	纽交所	美国	445.00	148,759.28	0.78
93	DEVON ENERGY CORPORATION	戴文能源	DVN US	纽交所	美国	707.00	146,911.21	0.77
94	NORFOLK SOUTHERN CORP	诺福克南方	NSC US	纽交所	美国	266.00	146,112.10	0.77
95	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	杜邦	DD US	纽交所	美国	337.00	145,743.66	0.76
96	APPLE INC	苹果电脑	AAPL US	纳斯达克	美国	210.00	143,538.43	0.75
97	HALLIBURTON CO	哈利伯顿	HAL US	纽交所	美国	642.00	141,909.06	0.74
98	KINDER MORGAN INC	特拉华州金德摩根公司	KMI US	纽交所	美国	1,424.00	137,963.54	0.72
99	Twenty-First Century Fox	二十一世纪福克斯公司	FOXA US	纳斯达克	美国	635.00	111,992.52	0.59
100	GOOGL US	谷歌公司	GOOGL US	纳斯达克	美国	16.00	80,833.37	0.42
101	GOOGLE INC-CLASS A	谷歌	GOOG US	纳斯达克	美国	16.00	78,845.81	0.41
102	FOX US	新闻集团	FOX US	纳斯达克	美国	224.00	39,607.84	0.21

## 2、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所有权益投资 明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净
----	----------	----------	------	------	----------	-------	------	--------

				市场				值比例 (%)
1	PHILLIPS 66	Phillips 66 公司	PSX US	纽交所	美国	1.00	531.18	0.00

## 五、报告期内权益投资组合的重大变动

### 1、累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	KINDER MORGAN INC	KMI US	302,103.77	1.22
2	CELGENE CORP	CELG US	214,187.42	0.87
3	ALLERGAN PLC	AGN US	201,187.25	0.81
4	PCLN US	PCLN US	165,808.43	0.67
5	BLACKROCK INC	BLK US	165,487.39	0.67
6	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	96,110.09	0.39
7	DEVON ENERGY CORPORATION	DVN US	92,158.34	0.37
8	HALLIBURTON CO	HAL US	78,884.06	0.32
9	CONOCOPHILLIPS	COP US	64,745.44	0.26
10	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	DD US	63,921.19	0.26
11	PAYPAL HOLDINGS INC	PYPL US	62,428.24	0.25
12	CHEVRON CORP	CVX US	61,339.07	0.25
13	CATERPILLAR INC	CAT US	53,565.46	0.22
14	QUALCOMM INC	QCOM US	46,310.71	0.19
15	UNION PACIFIC CORP	UNP US	42,476.71	0.17
16	FOX US	FOX US	41,907.2	0.17
17	INTL BUSINESS MACHINES CORP	IBM US	40,153.98	0.16
18	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	39,245.42	0.16
19	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	36,639.56	0.15
20	BIOGEN IDEC INC	BIIB US	36,430.03	0.15

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

### 2、累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	AMAZON.COM INC	AMZN US	210,749.96	0.85
2	STARBUCKS CORP	SBUX US	176,110.79	0.71
3	NIKE INC -CL B	NKE US	168,093.77	0.68
4	DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	DD US	165,738.40	0.67
5	LOWE'S COS INC	LOW US	155,545.80	0.63
6	HOME DEPOT INC	HD US	153,566.61	0.62
7	WALGREENE BOOTS ALLTANCE	WBA US	152,012.52	0.62
8	EBAY INC	EBAY US	151,009.68	0.61
9	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	BMY US	147,735.12	0.60
10	VISA INC-CLASS A SHARES	V US	147,067.95	0.60
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	UNH US	146,997.75	0.60
12	APACHE CORP	APA US	136,545.14	0.55
13	NATIONAL OILWELL VARCO INC	NOV US	132,411.28	0.54
14	ALTRIA GROUP INC	MO US	126,420.91	0.51
15	ACCENTURE PLC-CL A	ACN US	126,330.08	0.51
16	FACEBOOK INC-A	FB US	124,968.92	0.51
17	BAXTER INTERNATIONAL INC	BAX US	124,742.49	0.51
18	TEXAS INSTRUMENTS INC	TXN US	124,714.87	0.51
19	ELI LILLY & CO	LLY US	124,649.91	0.50
20	FREEMONT-MCMORAN COPPER	FCX US	122,679.30	0.50

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

### 3、权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,424,300.98
卖出收入（成交）总额	9,541,707.64

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 六、期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 七、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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 八、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 九、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 十、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 十一、投资组合报告附注

1、本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、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股票。

#### 3、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	1,347,328.10
3	应收股利	19,414.63
4	应收利息	101.43
5	应收申购款	300,383.46
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,667,227.62

#### 4、期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### (1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### (2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名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。

## 第六章 基金的业绩

本基金在业绩披露中将参照全球投资表现标准（GIPS）

- 一、在业绩表述中采用统一的货币；
- 二、参照GIPS的相关规定和标准进行计算。

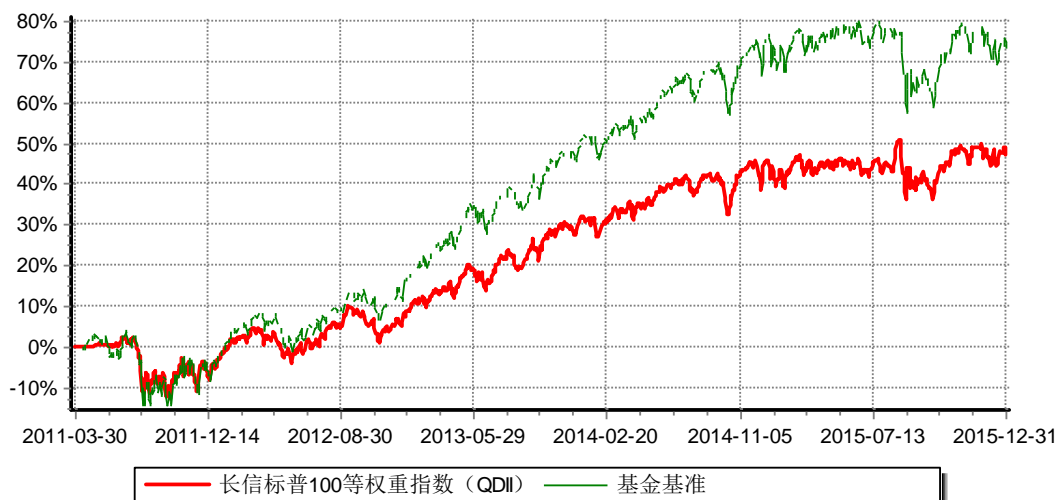
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
过去三个月	6.43%	0.99%	6.52%	1.21%	-0.09%	-0.22%
过去六个月	3.17%	1.08%	-0.91%	1.26%	4.08%	-0.18%
过去一年	2.33%	0.93%	-0.69%	1.06%	3.02%	-0.13%
过去三年	39.00%	0.74%	53.21%	0.84%	-14.21%	-0.10%
自基金合同生效 (2011年3月30日)起 至2015年 12月31日	47.01%	0.87%	72.98%	1.03%	-25.97%	-0.16%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2011年3月30日至2015年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。



## 第七章 基金管理人

### 一、基金管理人概况

基金管理人概况			
名称	长信基金管理有限责任公司		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼		
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼		
邮政编码	200120		
批准设立机关	中国证券监督管理委员会		
批准设立文号	中国证监会证监基金字[2003]63号		
注册资本	壹亿伍仟万元人民币		
设立日期	2003年5月9日		
组织形式	有限责任公司		
法定代表人	叶焯		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	魏明东		
存续期间	持续经营		
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】		
股权结构	<b>股东名称</b>	<b>出资额</b>	<b>出资比例</b>
	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%

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历
叶焯	董事长	男	中共党员，经济学硕士，中南财经大学工业经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。2015年6月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司董事长。曾任职君安证券有限公司石家庄营业部总经理、公司副总裁，国泰君安证券股份有限公司武汉分公司总经理、资产委托管理部总监，长信基金管理有限责任公司总经理，长城证券有限责任公司总经理，长江证券股份有限公司董事、总裁，长江证券承销保荐有限公司董事长。
陈谋亮	董事	男	中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，

			高级商务谈判师。现任上海海欣集团股份有限公司总裁。曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁。
邹继新	董事	男	中共党员，高级工程师，大学学历，硕士学位。现任武汉钢铁（集团）公司市委常委、副总经理、武汉钢铁股份有限公司总经理。曾任武汉钢铁股份有限公司三炼钢厂副厂长兼总工程师，武汉钢铁股份有限公司总经理助理兼武汉钢铁股份有限公司炼钢总厂厂长，武汉钢铁股份有限公司副总经理兼制造部部长，武汉钢铁（集团）公司副总经理，武汉钢铁（集团）公司副总经理兼武汉钢铁股份有限公司总经理。
覃波	董事	男	中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。
胡柏枝	独立董事	男	中共党员，大专，高级会计师，注册会计师，注册税务师。曾任湖北省财政厅副厅长、党组副书记，湖北省国有资产管理局副局长、局长，中国三峡总公司财务部主任、副总会计师，三峡财务公司总经理，财政部驻湖北省专员办监察专员、党组书记、巡视员，湖北省人大财经委、预工委副主任。
吴稼祥	独立董事	男	经济学学士，研究员。现任中国生物多样性保护与绿色发展基金会副理事长、中国体制改革研究会公共政策研究部研究员。曾任职中共中央宣传部和中共中央书记处办公室、华能贵诚信托投资公司独立董事。
谢红兵	独立董事	男	中共党员，学士。曾任营教导员、军直属政治处主任，交通银行上海分行杨浦支行副行长、营业处处长兼房地产信贷部经理、静安支行行长、杨浦支行行长，交通银行基金托管部副总经理、总经理，交银施罗德基金管理有限公司董事长，中国交银保险（香港）副董事长。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

## 2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
余汉生	监事会主席	男	中共党员，本科，正高职高级会计师。现任武汉钢铁股份有限公司总会计师。曾任武钢实业公司审计处处长、武钢实业公司财务处处长、武汉钢铁（集团）公司计划财务部会计处处长、武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长、武汉钢铁股份有限公司副总会计师兼计划财务部部长。
陈水元	监事	男	硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司执行副总裁、财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理总裁特别助理。
杨爱民	监事	男	中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

## 3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
覃波	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。

宋小龙	副总经理	男	理学硕士，北京大学计算机软件专业研究生毕业，具有基金从业资格。2012年10月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会主任委员，兼任长信金利趋势混合基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理。曾任北京北大青鸟公司项目经理、富国基金管理公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
李小羽	副总经理	男	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、固定收益部总监，长信利丰债券基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利保债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信利广混合基金的基金经理。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年加入长信基金管理有限责任公司，先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债基金和长信纯债一年定开债券基金的基金经理、总经理助理。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

#### 4、基金经理

本基金历任基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
薛天	基金经理	本基金基金合同生效当日至今	美国哥伦比亚大学公共卫生学硕士和工商管理硕士，具有美国 SEC 证券业务从业资格和英国 SFA 证券与金融衍生品从业资格和中国基金从业资格。薛天先生在美国有超过 10 年的基金管理和投资研究工作。2009 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司国际业务部投资总监，兼任本基金的基金经理。曾任法国巴黎银行（伦敦/纽约）股票分析师、花旗集团投资部基金经理、美国 Empyrean Capital Partners 基金经理和合伙人，一直从事证券研究和

			投资管理工作的。
--	--	--	----------

## 5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理
宋小龙	副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利趋势混合基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理
谈洁颖	投资管理部总监、投资决策委员会执行委员、长信双利优选混合基金、长信新利混合基金、长信多利混合基金和长信睿进混合基金的基金经理
李小羽	副总经理、固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利保债券基金、长信利广混合基金和长信金葵纯债一年定开债券基金的基金经理
薛天	国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信标普100等权重指数基金(QDII)的基金经理
黄建中	专户投资部投资经理、投资决策委员会执行委员
朱君荣	专户投资部副总监、投资经理
高远	研究发展部副总监
易利红	股票交易部副总监
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>	

注：自2016年4月28日起，谈洁颖女士不再担任长信新利混合基金的基金经理。

### (三) 内部组织结构及员工情况

内部组织结构及员工情况	
股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司组织管理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。	
公司经营管理层下设的委员会	内部控制委员会、投资决策委员会
公司内部组织结构	量化投资部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、股票交易部、债券交易部、基金事务部、零售服务部、机构业务部、机构服务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、财务管理部、专户理财部、国际业务部、产品开发部、电子商务部、财务管理部
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉办事处
员工总数	151人（截至2016年3月30日）

## 四、基金管理人的职责

根据《基金法》、《运作办法》及其他法律、法规的规定，基金管理人应履行以下职责：

(一) 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；

(二) 办理基金备案手续；

(三) 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

(四) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时足额向基金份额持有人分配收益；

(五) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(六) 编制基金季度、半年度和年度报告；

(七) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(八) 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(九) 召集基金份额持有人大会；

(十) 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；

(十一) 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；

(十二) 选择、更换或撤销境外投资顾问；

(十三) 有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

## **五、基金管理人和基金经理的承诺**

(一) 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止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有关规定的行为发生。

(二) 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- 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谋取利益；
- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

(三) 本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵

守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1、越权或违规经营；
- 2、违反基金合同或托管协议；
- 3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6、玩忽职守、滥用职权；
- 7、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，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；
- 8、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- 9、贬损同行，以抬高自己；
- 10、以不正当手段谋求业务发展；
- 11、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- 12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- 13、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

（四）基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、购买不动产；
- 5、购买房地产抵押按揭；
- 6、购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- 7、购买实物商品；
- 8、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- 9、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- 10、参与未持有基础资产的卖空交易；

- 11、直接投资与实物商品相关的衍生品；
- 12、向基金管理人、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债券；
- 13、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
- 14、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 15、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

#### （五）基金经理承诺

- 1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉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、基金合同和中国证监会的有关规定，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

基金管理人高度重视内部风险控制，建立了完善的风险管理体系和控制体系，从制度上保障本基金的规范运作。

#### （一）公司内部控制的总体目标

- 1、保证公司经营管理活动的合法合规性；
- 2、保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- 3、实现公司稳健、持续发展、维护股东权益；
- 4、促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

#### （二）内部控制制度遵循的原则

- 1、合法合规性原则：公司内部控制制度应当符合国家法律法规和各项规定。
- 2、全面性原则：内部控制制度应当覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工。
- 3、有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护



内控制度的有效执行，内部控制制度应当具有高度的权威性，任何员工不得拥有超越制度约束的权利。

4、独立性原则：公司在精简的基础上设立能够充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立。公司固有财产、基金财产和其他财产的运作应当分离。

5、相互制约原则：公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

6、防火墙原则：公司基金投资、交易、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，应当制定严格的审批程序和监管措施。

7、审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

8、适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

9、成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

10、保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上。

11、定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

### （三）内部风险控制体系结构

公司内控体系由不同层面的构成。公司董事会、经营管理层（包括督察长）、内部控制委员会、监察稽核部及公司其他部门、各岗位在各自职责范围内承担风险控制责任。

1、董事会：全面负责公司的风险控制工作，对建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；

2、经营管理层：负责日常经营管理中的风险控制工作，对内部控制制度的有效执行承担责任；督察长：负责对公司内部管理、资产运作以及经营管理层、内部各部门、各岗位执行制度及遵纪守法情况进行监督和检查，并对公司内部风

险控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价；

3、内部控制委员会：协助经营管理层负责公司风险控制工作，主要负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制定相应的控制制度，协调处理突发性重大事件或危机事件。内部控制委员会由公司总经理、副总经理、监察稽核部总监、基金事务部总监、市场开发部总监和部分从事内部控制方面的业务骨干组成；

4、监察稽核部：负责检查评价公司内部控制制度的合法性、合规性、完备性、有效性以及执行情况；对公司经营业务和基金运作情况进行日常稽核；对各部门、各岗位、各项业务的风险控制情况实施全面的监督检查，并及时报告检查结果。监察稽核部独立行使检查权并对经营管理层负责；

5、业务部门和公司各岗位：公司业务部门根据公司各项基本管理制度，结合部门具体情况制定本部门的管理办法和实施细则，加强对各项业务和各业务环节的风险控制；公司各岗位：根据岗位职责和业务操作流程，按业务授权规范操作，严格控制操作风险。

#### （四）内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的内部风险控制制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成，按照其效力大小分为四个层面：

第一个层面是公司章程。

第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司自定各项规章制度的基础和依据，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

第三个层面是公司基本管理制度，它包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源制度、业绩评估考核制度和危机处理制度，等等。

第四个层面是公司各部门业务规章、实施细则等。部门业务规章、实施细则是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### （五）内部风险管理体系

基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险以及不可抗力风险。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理程序，具体包括以下内容：

- 1、投资风险；
- 2、交易风险管理；
- 3、巨额赎回风险管理；
- 4、基金注册登记风险管理；
- 5、基金核算风险管理；
- 6、市场开发风险管理；
- 7、信息披露风险管理；
- 8、不可抗力风险管理。

#### （六）风险管理和内部控制的措施

1、建立内控结构，完善内控制度：建立、健全了行之有效的内控制度，确保各项业务活动都有适当的授权和明确的分工，确保监察稽核活动的独立性、权威性；

2、建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立了明确的岗位分离制度，做到研究、决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，同时进行空间隔离，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密，从制度上降低和防范风险；

3、建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每位员工都明确自己的任务、职责，及时上报各自工作领域中发现的风险隐患，以防范和化解风险；

4、建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了内部控制委员会，使用适合的程序和方法，确认和评估公司经营管理和基金运作中的风险；建立自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策，减少风险造成的损失；

5、建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如计算机预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

6、使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

7、提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，不断提高员工素质和职业技能，防范和化解风险。

（七）基金管理人关于内部合规控制声明书

- 1、基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- 2、基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制。

## 第八章 境外投资顾问

本基金暂不设境外投资顾问。

## 第九章 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定，并经2010年11月9日中国证监会证监许可【2010】1586号文件核准募集。

本基金募集期为2011年2月28日至2011年3月25日。经会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，基金募集期共募集508,424,713.40份基金份额，有效认购户数为1,370户。

## 第十章 基金合同的生效

一、根据《基金法》、《运作办法》和基金合同的有关规定，本基金符合基金合同生效的条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2011年3月30日获得中国证监会书面确认，基金合同从该日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 第十一章 基金份额的申购和赎回

### 一、申购与赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人的直销机构和基金管理人委托的代销机构。具体的销售机构将由基金管理人在《招募说明书》、《基金份额发售公告》或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告、向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。投资者可以在销售机构网点或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

本基金的申购、赎回自基金合同生效日后不超过三个月开始办理。本基金（基金代码：519981[前端模式]）于2011年5月10日开始办理日常申购赎回业务。

基金管理人尚未开放本基金[后端模式]日常申购赎回业务，具体办理申购赎回业务的时间基金管理人应提前2个工作日在指定媒体及基金管理人网站刊登相关公告。

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。投资者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、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

### 三、申购与赎回的原则

（一）“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日的基金份额净值（折算为人民币）为基准进行计算；

（二）基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（三）基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

（四）当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销；



(五) 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施两日前在指定媒体上公告。

#### 四、申购与赎回的程序

##### (一) 申购与赎回申请的提出

投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构(网点)必须有足够的基金份额余额。

##### (二) 申购与赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记机构在T+2日内为投资者对该交易的有效性进行确认。投资者应在T+3日(包括该日)后及时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。因投资者未及时进行该查询而造成的后果由其自行承担。

##### (三) 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起T+10日内划往投资者银行账户，当遇基金主要投资场所休市或暂停交易时顺延。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

#### 五、申购与赎回的数额限制

(一) 自2014年5月15日起，投资者通过场外申购时，首次申购的单笔最低金额为人民币1元(含申购费)，追加申购的单笔最低金额为人民币1元(含申购费)；超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台申购本基金遵循上述规则；各基金代理销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理申购业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

(二) 投资者将当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

(三) 投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额的比例或数量不

设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

(四) 自2014年5月15日起,投资者通过场外赎回时,本基金的最低赎回份额调整为1份,即投资者可将其全部或部分基金份额赎回,赎回的最低份额为1份;投资者当日持有份额减少导致在销售机构同一交易账户保留的基金份额不足1份的,注册登记机构将全部剩余份额自动赎回。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台赎回本基金遵循上述规则;各基金代理销售机构有不同规定的,投资者在该销售机构办理赎回业务时,需同时遵循销售机构的相关业务规定。

(五) 基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述对申购金额和赎回份额的数量限制,基金管理人必须在三个工作日内在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

## 六、申购费用和赎回费用

(一) 本基金申购,赎回费率分别不高于1.7%和0.5%,并随申购金额和申请赎回份额持有时间的增加而递减,具体费率如下表所示:

1、前端申购费率为:

申购金额(万)	前端申购费率
$M < 100$	1.40%
$100 \leq M < 500$	0.80%
$500 \leq M$	1000元/笔

注: M为金额

2、后端申购费率为:

持有期(年)	后端申购费率
$N < 1$	1.70%
$1 \leq N < 3$	1.40%
$3 \leq N < 5$	1.00%
$N \geq 5$	0

注: N为年份

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。

3、赎回费率为:

持有期(年)	赎回费率
$N < 1$	0.50%

$1 \leq N < 3$	0.35%
$3 \leq N < 5$	0.20%
$N \geq 5$	0

注：N为年份

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用的25%应当归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(二)基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施两日前在指定媒体上公告。

(三)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况下根据市场情况制定基金促销计划，经代销机构同意后，针对投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调整基金申购费率、赎回费率和转换费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

(一)基金申购份额的计算公式

### 1、前端收费模式

净申购金额=申购金额/(1+前端申购费率)

前端申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

例：某投资者投资10万元申购本基金，采用前端收费模式，对应费率为1.4%，假设申购当日基金份额净值为1.016元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=100000/(1+1.4%)=98619.33元

前端申购费用=100000-98619.33=1380.67元

申购份额=98619.33/1.016=97066.27份

### 2、后端收费模式

申购份额=申购金额/申购当日基金份额净值

例2：某投资人投资10万元申购本基金，采用后端收费模式，假定申购当日基金份额净值为1.016元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.016=98425.20份。

申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金财产。

## (二) 基金赎回金额的计算

### 1、前端收费模式

如果投资者在申购（认购）时选择交纳前端申购（认购）费用，则赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

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

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

### 2、后端收费模式

如果投资者在申购时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

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

$$\text{后端申购费用} = \text{赎回份额} \times \text{申购日基金份额净值} \times \text{后端申购费率}$$

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

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{后端申购费用} - \text{赎回费用}$$

例 3：某投资者赎回持有期未满足一年本基金 1 万份基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.022 元，其在申购时已交纳前端申购费用，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10000 \times 1.022 = 10220 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10220 \times 0.5\% = 51.10 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10220 - 51.10 = 10168.90 \text{ 元}$$

例 4：某投资者申购本基金份额当日的基金份额净值为 1.100 元，该投资者选择交纳后端申购费用，并在持有期未满足一年时赎回 1 万份，对应的赎回费率为 0.5%，对应的后端申购费率为 1.7%，假设赎回当日基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

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

$$\text{后端申购费用} = 10000 \times 1.100 \times 1.7\% = 187 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12000 \times 0.5\% = 60 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 12000 - 187 - 60 = 11753 \text{ 元}$$

赎回金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入，由此产生的收益和损失由基金财产承担。

### 3、本基金基金份额净值的计算

本基金的估值日为每个工作日，基金份额净值应当在估值日后 2 个工作日内披露。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。其计算公式为：

基金份额净值=计算日基金资产净值÷计算日基金总份额

本基金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。

### 4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，上述涉及基金份额的计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分按四舍五入方法计算；上述涉及金额的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。

### 5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

## 八、申购和赎回的注册登记

（一）经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

（二）投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额。

（三）投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

（四）基金管理人可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，并最迟于开始实施 3 个工作日前在指定媒体上公告。

## 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- 2、本基金主要投资场所的交易所交易时间临时停市；

- 3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 4、基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种；
- 5、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的利益的情形；
- 6、本基金已经达到监管机构核定的本基金的规模；
- 7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- 8、法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当在当日向中国证监会备案，并及时在指定媒体上公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并及时在指定媒体上公告。

#### **十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式**

（一）在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2、本基金主要投资市场的交易所交易时间或外汇市场交易时间临时停市或非正常停市，导致基金管理人无法准确计算当日基金资产净值和基金份额净值；
- 3、发生连续巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；
- 6、法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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，并及时在指定媒体上公告。

(二) 暂停基金的申购、赎回，基金管理人应在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

(三) 暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并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。

## 十一、巨额赎回的认定及处理方式

### (一) 巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回。

### (二) 巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

1、接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

3、当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在两个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上公告。

4、暂停接受和延缓支付：本基金连续两个或两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过二十个工作日，并应当在指定媒体上公告。

## 十二、重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一个开放日，基金管理人将于重新开放日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一个开放日但少于十个开放日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过十个开放日，暂停期间，基金管理人应每十个开放日至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过 20 个开放日时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日在指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

### 十三、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费。基金转换的程序及相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定报中国证监会备案后在指定媒体上公告。

### 十四、定期定额投资计划

本基金已为基金投资者提供定期定额投资计划服务，具体可办理定期定额投资业务的渠道详见基金管理人发布的相关公告。

### 十五、转托管

基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，应办理已持有基金份额的转托管。本基金份额转托管采用一步转托管的形式完成，具体按各销售机构要求办理。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在转托管业务确认成功后转入其指定的销售机构（网点）。

### 十六、基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行、国有资产无偿划转、机构合并或分立及基金注册登记



机构认可的其他行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

（一）“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；

（二）“捐赠”仅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的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体；

（三）“司法强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织；

（四）“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；

（五）“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转。

#### **十七、基金的冻结与解冻**

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。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一律转为基金份额并冻结。

## 第十二章 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- (一)基金管理人的管理费(如基金管理人委托投资顾问,包括投资顾问费);
- (二)基金托管人的托管费(如基金托管人委托境外托管人,包括向其支付的相应服务费);
- (三)基金的证券交易费用、在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用;
- (四)基金合同生效以后的信息披露费用;
- (五)基金份额持有人大会费用;
- (六)基金合同生效以后的会计师费、律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用;
- (七)基金的资金汇划费用;
- (八)代表基金投票的费用;
- (九)外汇兑换交易的相关费用;
- (十)基金依照有关法律法规应当缴纳的,购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税(以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用);
- (十一)更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移至新基金托管人所引起的费用;
- (十二)经生效的司法文书判决或裁定明确应由基金资产承担的与基金有关的诉讼、追索费用;
- (十三)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (一)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 1.10%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 1.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### （二）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 0.3% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

（三）上述“一、基金费用的种类”中第（三）—（十三）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。

### 三、不列入基金费用的项目

本章第一款约定以外的其他费用，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。

### 四、基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### 五、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

## 第十三章 基金的财产

### 一、基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

本基金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

本基金根据相关法律法规、规范性文件在境内开立人民币和外币资金账户，在境外开立外币资金账户及证券账户，与基金管理人、基金托管人和境外托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

### 四、基金财产的保管及处分

（一）本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和境外托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人和境外托管人不得将基金财产归入其固有财产。

（二）基金托管人和境外托管人应安全保管基金财产。

（三）基金管理人、基金托管人、境外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，归基金财产。

（四）基金托管人或境外托管人按照规定或境外市场惯例开设基金财产的资金账户和证券账户。

（五）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。

（六）基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。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范围。

（七）非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十四章 基金资产估值

### 一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，确定基金资产净值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### 二、估值频率

基金合同生效后，每个工作日对基金资产进行估值，T+1日完成T日估值。

### 三、估值对象

本基金所拥有的证券和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

### 四、估值方法

#### （一）上市流通股票：

如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。

如估值日无市价，且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了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

#### （二）未上市股票：

送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次公开发行且未上市的股票，按成本价估值。

首次发行且有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市后的同一股票的市价估值。

#### （三）金融衍生品：

1、上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2、未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

3、衍生品的估值，可以参照国际会计准则进行。

（四）基金持有的债券、交易型开放式指数基金（ETF）等其他有价证券，上市交易的有价证券按估值日的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

（五）开放式基金以估值时点能够取得的最新基金份额净值进行估值。

（六）非流动性资产或暂停交易的证券估值方法：

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可以根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（七）估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及美元、港币对人民币汇率的，采用当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。

（八）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（一）-（七）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（一）-（七）小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（九）国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

## 五、估值程序

基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。基金管理人将估值结果以书面形式发送基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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。在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

## 六、暂停估值的情形

- (一) 遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (二) 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人、境外托管人、投资顾问无法准确评估基金资产价值时；
- (三) 中国证监会认定的其它情形。

## 七、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每个工作日将计算的前一工作日的基金份额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。

基金份额净值的计算精确到0.001人民币，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## 八、估值错误的处理

(一) 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

(二) 基金份额净值计算差错小于基金份额净值0.5%时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；当计价错误达到或超过基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

(三) 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

## 九、特殊情形的处理

(一) 基金管理人按本条四估值方法中的第(八)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

(二) 由于交易机构或独立价格服务商发送的数据错误，或有关会计制度变化以及由于其他不可抗力原因，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可以免除赔偿责任。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。

(三) 对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。

## 第十五章 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金合同项下基金利润即为基金收益。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。

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。

### 二、收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的期末可供分配利润按基金份额进行比例分配。

(一) 基金的每份基金份额享有同等分配权；

(二) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

(三) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者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，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；

(四) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

(五) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(六) 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净值分配金额后不能低于面值；

(七) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。

法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### 三、收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、



分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

#### 四、收益分配方案的确定与公告

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体和基金管理人网站公告。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

#### 五、收益分配中发生的费用

（一）收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

（二）收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当投资者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基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十六章 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- (一) 基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- (二) 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币为记账单位。
- (三) 会计制度按国家有关的会计制度执行。
- (四) 本基金独立建账、独立核算。
- (五) 本基金会计责任人为基金管理人。
- (六) 基金管理人应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，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以书面方式确认。

### 二、基金年度审计

- (一) 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人、境外托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- (二) 会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- (三) 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通知基金托管人。基金管理人应在更换会计师事务所后在2个工作日内在指定媒体上公告。

## 第十七章 基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 一、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

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，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的 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。

### 二、基金份额发售公告

基金管理人应当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。

### 三、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

### 四、基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。如本基金投资衍生品，应当在每个工作日计算并披露基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或赎回之后，基金管理人应当在 T+2 日（T 日为开放日）通过网站、基金份额发售网点以及其他指定媒体，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日后 2 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媒体和网站上。

### 五、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。

(一) 基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，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。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

(二) 基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，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。

(三) 基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，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。

基金合同生效不足两个月的，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。

## 六、临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两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。

前款所称重大事件，是指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下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、提前终止基金合同；
- 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、减少基金代销机构;
- 20、基金更换基金注册登记机构;
- 21、基金开始办理申购、赎回;
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付;
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- 26、更换投资顾问、境外托管人;
- 27、基金运作期间如遇投资顾问主要负责人员变动,基金管理人认为该事件有可能对基金投资产生重大影响;
- 28、中国证监会规定的其他事项。

## 七、公开澄清

在基金合同期限内,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。

## 八、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件

复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

有关交易管理、佣金返还安排、代理投票政策、流程记录的文件公布后，应当分别置于基金管理人、基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

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。

## 第十八章 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

(一) 变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同第九部分第(二)点规定的对基金合同当事人权利义务产生重大影响的事项应经基金份额持有人大会决议通过。

(二) 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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(三) 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

### 二、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- (一) 基金份额持有人大会决定终止；
- (二) 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- (三) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- (四) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 三、基金财产的清算

(一) 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关法律、法规规定对基金财产进行清算。

#### (二) 基金财产清算组

1、自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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。

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。

### （三）清算程序

- 1、基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2、基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3、基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4、对基金财产进行评估和变现；
- 5、制作清算报告；
- 6、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；
- 7、将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 8、对基金财产进行分配。

### （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

### （五）基金剩余财产的分配

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、2、3项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### （六）基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

### （七）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。



## 第十九章 基金托管人

### 一、基金托管人的基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### 二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### 三、证券投资基金托管情况

截至2016年3月31日，中国银行已托管446只证券投资基金，其中境内基金416只，QDII基金30只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居

同业前列。

#### 四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2015年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### 五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金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，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第二十章 境外托管人

### 一、中银香港概况

名称：[中国银行(香港)有限公司]  
 住所：[香港花园道 1 号中银大厦]  
 办公地址：[香港花园道 1 号中银大厦]  
 法定代表人：[岳毅总裁]  
 成立时间：[1964 年 10 月 16 日]  
 组织形式：[股份有限公司]  
 存续期间：[持续经营]  
 联系人：[黄晚仪 副总经理 托管业务主管]  
 联系电话：[852-3982-3753]

中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）早于 1964 年成立，并在 2001 年 10 月 1 日正式重组为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司（“中银香港(控股)”）-则于 2001 年 2 日在香港注册成立，并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市，2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至 2015 年 12 月月底，中银香港(控股)有限公司的总资产超过 23,678 亿港元，资本总额超过 1,979 亿港元，总资本比率为 17.86%。中银香港的财务实力及双 A 级信用评级，可以媲美不少大型全球托管银行。中银香港(控股)最新信评如下(截至 2016 年 3 月 31 日)：

	穆迪投资服务	标准普尔	惠誉国际评级
评级展望	负面	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P-1	A-1	F1
展望	负面	稳定	稳定

中银香港作为香港第二大银行集团，亦为三家本地发钞银行之一，拥有最庞

大分行网络与广阔的客户基础。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一，目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类 QDII 及其理财产品等)，亦素有经验，于行业处于领先地位，包括于 2006 年被委任为国内首只银行类 QDII 产品之境外托管行，及于 2007 年被委任为国内首只券商类 QDII 集成计划之境外托管行等，其业务专长及全方位的配备，令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行，亦是唯一荣获「亚洲投资人杂志」颁发奖项的中资托管行(2012 年服务提供者奖项「最佳跨境托管亚洲银行奖」)，并在 2013 年荣获《银行家》(The Banker) 选为「香港区最佳银行奖」以及财资杂志(The Asset) 颁发资产服务奖项之「最佳 QFII 托管银行奖」。

截至 2015 年 12 月 31 日止，中银香港(控股)的托管资产规模达 7,766 亿港元。

## 二、托管部门人员配备、安全保管资产条件的说明

### (一) 主要人员情况

托管业务是中银香港的核心产品之一，由管理委员会成员兼副总裁林景臻先生直接领导。针对国内机构客户而设的专职托管业务团队现时有二十名骨干成员，职级均为经理或以上，分别主理结算、公司行动、账务(Billing)、对账(Reconciliation)、客户服务、产品开发、营销及网管理等方面。骨干人员均来自各大跨国银行，平均具备 15 年以上的专业托管工作经验(包括本地托管及全球托管)，并操流利普通话，可说是香港最资深的托管团队。

除配备专职的客户关系经理，中银香港更特设为内地及本地客户服务的专业托管业务团队，以提供同时区、同语言的高素质服务。

除上述托管服务外，若客户需要估值、会计、投资监督等增值性服务，则由中银香港的附属公司中银国际英国保诚信托有限公司(“中银保诚”)提供。作为「强制性公积金计划管理局」认可的信托公司，中银保诚多年来均提供国际水平的估值、会计、投资监督等服务，其专职基金会计与投资监督人员达 50 多名，人员平均具备 10 年以上相关经验。

中银香港的管理层对上述服务极为重视，有关方面的人员配置及系统提升正不断加强。另外，其它中/后台部门亦全力配合及支持托管服务的提供，力求以最高水平服务各机构性客户。

## （二）安全保管资产条件

在安全保管资产方面，为了清楚区分托管客户与银行拥有的资产，中银香港目前已以托管人身份在本港及海外存管或结算机构开设了独立的账户以持有及处理客户的股票、债券等资产交收。

除获得客户特别指令或法例要求外，所有实物证券均透过当地市场之次托管人以该次托管人或当地存管机构之名义登记过户，并存放于次托管人或存管机构内，以确保客户权益。至于在异地市场进行证券交割所需之跨国汇款，除非市场/存托机构/次托管行等另有要求，否则中银香港会尽可能在交收日汇入所需款项，以减少现金停留于相关异地市场的风险。

先进的系统是安全保管资产的重要条件。

中银香港所采用的托管系统名为” Custody & Securities System” 或简称 CSS，是中银香港聘用一支科技专家、并结合银行内部的专才，针对机构性客户的托管需求在原有的零售托管系统上重新组建而成的。CSS 整个系统构建在开放平台上，以 IBM P5 系列 AIX 运行。系统需使用两台服务器，主要用作数据存取及支持应用系统软件，另各自附有备用服务器配合。此外，一台窗口服务器已安装 NFS (Network File System, for Unix) 模块，负责与 AIX 服务器沟通。

新系统除了采用尖端科技开发，并融合机构性客户的需求与及零售层面的系统优势，不单符合 SWIFT-15022 之要求，兼容 file transfer 等不同的数据传输，亦拥有庞大的容量(原有的零售托管系统就曾多次证实其在市场买卖高峰期均运作如常，反观部分主要银行的系统则瘫痪超过 1.5 小时)。

至于基金估值、会计核算以及投资监督服务，则采用自行研发的 FAMEX 系统进行处理，系统可相容多种货币、多种成本定价法及多种会计算法，以满足不同机构客户及各类基金的需要。系统优势包括：多种货币；多种分类；实时更新；支持庞大数据量；简易操作，方便用户。系统所支持的核算方法包括：权重平均(Weighted Average)；后入先出(LIFO)；先入先出(FIFO)；其它方法可经与客户商讨后实施。系统所支持的估值方法有：以市场价格标明(Marking to Market)；成本法；成本或

市场价的较低者； 入价与出价(Bid and offer)； 分期偿还(Amortization)； 含息或除息(Clean/dirty)； 及其它根据证券类别的例外估值等。

## 第二十一章 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

<b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼	
法定代表人：叶烨	联系人：王瑞英
电话：021-61009916	传真：021-61009917
客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
<b>2、场外代销机构</b>	
<b>（1）中国农业银行股份有限公司</b>	
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号	
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号	
法定代表人：刘士余	联系人：刘一宁
传真：010-85109219	
客户服务电话：95599	网址：www.abchina.com
<b>（2）中国工商银行股份有限公司</b>	
注册地址：中国北京复兴门内大街55号	
办公地址：中国北京复兴门内大街55号	
法定代表人：姜建清	联系人：李鸿岩
电话：010-66105662	
客户服务电话：95588	网址：www.icbc.com.cn
<b>（3）中国银行股份有限公司</b>	
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	
法定代表人：田国立	联系人：宋亚平
电话：010-66593657	
客户服务电话：95566	网址：www.boc.cn
<b>（4）交通银行股份有限公司</b>	
注册地址：上海市银城中路188号	
办公地址：上海市银城中路188号	
法定代表人：牛锡明	联系人：张宏革
电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
<b>（5）招商银行股份有限公司</b>	
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦	

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
法定代表人：李建红	联系人：邓炯鹏
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
(6) 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	联系人：唐苑
电话：021-61618888	传真：021-63604199
客户服务电话：95528	网址：www.spdb.com.cn
(7) 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	联系人：姚健英
电话：010-58560666	传真：010-57092611
客户服务电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
(8) 重庆银行股份有限公司	
注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
法定代表人：马千真	联系人：孔文超
电话：023-63799379	传真：023-63792412
客户服务电话：(023)63836229	网址：www.cqcbank.com
(9) 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 号华夏银行大厦	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
法定代表人：吴建	联系人：刘军祥
电话：010-85238667	传真：010-85238680
客户服务电话：010-95577	网址：www.hxb.com.cn
(10) 汉口银行股份有限公司	
注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号	
法定代表人：陈新民	联系人：李星
电话：027-82656224	传真：027-82656236
客户服务电话：(027) 96558, 4006096558	网址：www.hkbchina.com
(11) 杭州银行股份有限公司	
注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	



法定代表人：吴太普	联系人：严峻
电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
客户服务电话：96523，400-8888-508	网址：www.hzbank.com.cn
(12) 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：张莉
电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
(13) 厦门银行股份有限公司	
注册地址：福建省厦门市思明区湖滨北路101号商业银行大厦	
办公地址：福建省厦门市思明区湖滨北路101号商业银行大厦	
法定代表人：吴世群	联系人：林黎云
电话：0592-5365735	传真：0592-5061952
客户服务电话：400-858-8888	网址：www.xmbankonline.com
(14) 安信证券股份有限公司	
注册地址：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	
法定代表人：牛冠兴	联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
客户服务电话：4008-001-001	网址：www.essence.com.cn
(15) 长城证券股份有限公司	
注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层	
办公地址：深圳市深南大道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：0755-83516289	传真：0755-83515567
客户服务电话：400-6666-888	网址：www.cgws.com
(16) 长江证券股份有限公司	
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦	
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦	
法定代表人：杨泽柱	联系人：李良
电话：027-65799999	传真：027-85481900
客户服务电话：95579 或 4008-888-999	网址：www.95579.com
(17) 大通证券股份有限公司	
注册地址：辽宁省大连市中山区人民路24号	
办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层	
法定代表人：张智河	联系人：谢立军

电话：0411-39673202	传真：0411-39673219
客户服务电话：4008-169-169	网址：www.daton.com.cn
(18) 德邦证券有限责任公司	
注册地址：上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼	
办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼	
法定代表人：姚文平	联系人：王志琦
电话：021-68761616	传真：021-68767032
客户服务电话：400-8888-128	网址：www.tebon.com.cn
(19) 第一创业证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层	
办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼	
法定代表人：刘学民	联系人：钟兴
电话：0755-25832852	传真：0755-25831754
客户服务电话：400-888-1888	网址：www.firstcapital.com.cn
(20) 东莞证券有限责任公司	
注册地址：东莞市莞城区可园南路1号	
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼	
法定代表人：张运勇	联系人：乔芳
电话：0769-22112062	传真：0769-22119423
客户服务电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn
(21) 东吴证券股份有限公司	
注册地址：苏州工业园区星阳街5号	
办公地址：苏州工业园区星阳街5号	
法定代表人：范力	联系人：陆晓
电话：0512-62938521	传真：0512-65588021
客户服务电话：400 860 1555	网址：www.dwzq.com.cn
(22) 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：薛峰	联系人：刘晨
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：4008888788、10108998、95525	网址：www.ebscn.com
(23) 广州证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼	
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼	
法定代表人：邱三发	联系人：林洁茹
电话：020-88836999	传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303		网址：www.gzs.com.cn	
(24) 华福证券有限责任公司			
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层			
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层			
法定代表人：黄金琳		联系人：张腾	
电话：0591-87383623		传真：0591-87383610	
客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）		网址：www.hfzq.com.cn	
(25) 广发证券股份有限公司			
注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼			
办公地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼			
法定代表人：孙树明		联系人：黄岚	
电话：020-87555888 转各营业网点		传真：020-87557985	
客户服务电话：95575 或致电各地营业部		网址：www.gf.com.cn	
(26) 国都证券股份有限公司			
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10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10层			
法定代表人：常喆		联系人：李弢	
电话：010-84183389		传真：010-84183311-3389	
客户服务电话：400-818-8118		网址：www.guodu.com	
(27) 国金证券股份有限公司			
注册地址：成都市东城根上街95号			
办公地址：成都市东城根上街95号			
法定代表人：冉云		联系人：刘一宏	
电话：028-86690126		传真：028-86690126	
客户服务电话：4006600109		网址：www.gjzq.com.cn	
(28) 国联证券股份有限公司			
注册地址：江苏省无锡市县前东街168号			
办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702			
法定代表人：雷建辉		联系人：沈刚	
电话：0510-82831662		传真：0510-82830162	
客户服务电话：95570		网址：www.glsc.com.cn	
(29) 国盛证券有限责任公司			
注册地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）			
办公地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）			
法定代表人：曾小普		联系人：陈明	
电话：0791-6281061		传真：0791-6281061	
客户服务电话：4008-222-111		网址：www.gsstock.com	

(30) 国泰君安证券股份有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼	
法定代表人：杨德红	联系人：芮敏祺
电话：021-38676666	传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666	网址：www.gtja.com
(31) 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 号国信证券大厦十六层至二十六层	
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
法定代表人：何如	联系人：周杨
电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
客户服务电话：95536	网址：www.guosen.com
(32) 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	联系人：李飞
电话：05551-2615542	传真：0551-2634906
客户服务电话：955784008-888-777	网址：www.gyzq.com.cn
(33) 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	联系人：李笑鸣
电话：021-23219000	传真：021-23219100
客户服务电话：400-8888-001 或 95553	网址：www.htsec.com
(34) 华安证券股份有限公司	
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号	
办公地址：合肥市蜀山区南二环 959 号 B1 座华安证券	
法定代表人：李工	联系人：汪燕
电话：0551-5161666	传真：0551-5161600
客户服务电话：96518、400-80-96518	网址：www.hazq.com
(35) 华宝证券有限责任公司	
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
法定代表人：陈林	联系人：刘闻川
电话：021-68777222	传真：021-68777822
客户服务电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com

(36) 华龙证券股份有限公司	
注册地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦21楼	
办公地址: 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦	
法定代表人: 李晓安	联系人: 邓鹏怡
电话: 0931-4890208	传真: 0931-4890628
客户服务电话: 4006898888	网址: www.hlzqgs.com.cn
(37) 华泰证券股份有限公司	
注册地址: 南京市中山东路90号华泰证券大厦	
办公地址: 南京市中山东路90号华泰证券大厦	
法定代表人: 吴万善	联系人: 郭琳
电话: 025-83290979	传真: 025-84579763
客户服务电话: 95597	网址: www.htsc.com.cn
(38) 江海证券有限公司	
注册地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
法定代表人: 孙名扬	联系人: 高悦铭
电话: 0451-82336863	传真: 0451-82287211
客户服务电话: 400-666-2288	网址: www.jhjq.com.cn
(39) 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	
办公地址: 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: 王宜四	联系人: 戴蕾
电话: 0791-86768681	传真: 0791-86770178
客户服务电话: 400-8866-567	网址: www.avicsec.com
(40) 平安证券有限责任公司	
注册地址: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼	
办公地址: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)	
法定代表人: 杨宇翔	联系人: 石静武
电话: 0755-22626391	传真: 0755-82400862
客户服务电话: 95511-8	网址: www.stock.pingan.com
(41) 中泰证券股份有限公司	
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: 李玮	联系人: 王霖
电话: 0531-68889155	传真: 0531-68889752
客户服务电话: 95538	网址: www.qlzq.com.cn
(42) 上海证券有限责任公司	

注册地址：上海市西藏中路 336 号上海证券	
办公地址：上海市西藏中路 336 号	
法定代表人：龚德雄	联系人：许曼华
电话：021-53519888	传真：021-53519888
客户服务电话：4008918918、021-962518	网址：www.962518.com
(43) 申万宏源证券有限公司	
注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	
办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	
法定代表人：李梅	联系人：黄莹
电话：021-33389888	传真：021-33388224
客户服务电话：95523 或 4008895523	网址：www.swhysc.com
(44) 天风证券股份有限公司	
注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
办公地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
法定代表人：余磊	联系人：翟璟
电话：027-87618882	传真：027-87618863
客服电话：028-86711410	网址：www.tfzq.com
(45) 天相投资顾问有限公司	
注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701	
办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层	
法定代表人：林义相	联系人：尹伶
电话：010-66045529	传真：010-66045518
客户服务电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
(46) 西藏同信证券股份有限公司	
注册地址：拉萨市北京中路 101 号	
办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号	
法定代表人：贾绍君	联系人：汪尚斌
电话：021-36533017	传真：021-36533017
客户服务电话：400-8811-177	网址：www.xzsec.com
(47) 湘财证券有限责任公司	
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
法定代表人：林俊波	联系人：钟康莺
电话：021-68634518	传真：021-68865680
客户服务电话：400-888-1551	网址：www.xcsc.com
(48) 日信证券有限责任公司	
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号	

办公地址：北京西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层	
法定代表人：孔佑杰	联系人：陈文彬
电话：010-83991743	传真：010-66412537
客户服务电话：010-83991888	网址：www.rxzq.com.cn
(49) 兴业证券股份有限公司	
注册地址：福州市湖东路268号	
办公地址：浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21层	
法定代表人：兰荣	联系人：夏中苏
电话：021-38565785	
客户服务电话：400-8888-123	网址：www.xyzq.com.cn
(50) 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38-45层	
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层	
法定代表人：宫少林	联系人：黄婵君
电话：0755-82960223	传真：0755-82943121
客户服务电话：95565 或 400-8888-111	网址：www.newone.com.cn
(51) 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	
办公地址：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：陈有安	联系人：宋明
电话：010-66568888	传真：010-66568990
客户服务电话：4008-888-888	网址：www.chinastock.com.cn
(52) 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：王常青	联系人：张颢
电话：010-85130588	传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108	网址：www.csc108.com
(53) 中信证券股份有限公司	
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座	
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦	
法定代表人：王东明	联系人：侯艳红
电话：010-60838888	传真：010-60833739
客户服务电话：95558	网址：www.citics.com
(54) 中信证券（山东）有限责任公司	
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层（266061）	
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20层（266061）	

法定代表人：杨宝林	联系人：吴忠超
电话：0532-85022326	传真：0532-85022605
客户服务电话：95548	网址：www.citicssd.com
(55) 中山证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层	
办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层	
法定代表人：吴永良	联系人：罗艺琳
电话：0755-83734659	传真：0755-82960582
客户服务电话：4001022011	网址：www.zszq.com.cn
(56) 信达证券股份有限公司	
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
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：张志刚	联系人：鹿馨方
电话：010-63081000	传真：010-63080978
客服热线：95321	网址：www.cindasc.com
(57) 西南证券股份有限公司	
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号	
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦	
法定代表人：余维佳	联系人：张煜
电话：023-63786633	传真：023-63786212
客服热线：4008096096	网址：www.swsc.com.cn
(58) 杭州数米基金销售有限公司	
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室	
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼	
法定代表人：陈柏青	联系人：韩爱彬
电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
(59) 上海长量基金销售投资顾问有限公司	
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室	
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层	
法定代表人：张跃伟	联系人：马良婷
电话：021-20691832	传真：021-20691861
客户服务电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com
(60) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司	
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室	
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801	
法定代表人：汪静波	联系人：徐诚



电话：021-38602377	传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
(61) 上海好买基金销售有限公司	
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室	
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室	
法定代表人：杨文斌	联系人：苗汀
电话：021-58870011	传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com
(62) 和讯信息科技有限公司	
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层	
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层	
法定代表人：王莉	联系人：吴卫东
电话：021-68419822	传真：021-20835779
客户服务电话：400-920-0022	网址：www.licaike.com
(63) 上海天天基金销售有限公司	
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼	
法定代表人：其实	联系人：朱钰
电话：021-54509998	传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188	网址：fund.eastmoney.com
(64) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司	
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809	
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809	
法定代表人：沈伟桦	联系人：程刚
电话：010-52855713	传真：010-85894285
客户服务电话：4006099400	网址：www.yixinfund.com
(65) 浙江同花顺基金销售有限公司	
注册地址：杭州市文二西路1号903室	
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼	
法定代表人：凌顺平	联系人：吴强
电话：0571-88911818	传真：0571-86800423
客户服务电话：4008-773-772	公司网站：www.5ifund.com
(66) 上海汇付金融服务有限公司	
注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼	
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼	
法定代表人：冯修敏	联系人：陈云卉
电话：021-33323999-5611	传真：021-33323830

客户服务电话：4008202819	网址：www.chinapnr.com
(67) 上海陆金所资产管理有限公司	
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元	
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼	
法定代表人：郭坚	联系人：宁博宇
电话：021-20665952	传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031	网址：www.lufunds.com
(68) 大泰金石投资管理有限公司	
注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室	
办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼	
法定代表人：袁顾明	联系人：朱真卿
电话：021-22267943	传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266	网址：www.dtfortune.com
(69) 上海联泰资产管理有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室	
办公地址：上海长宁区福泉北路518号8座3楼	
法定代表人：燕斌	联系人：凌秋艳
电话：021-52822063	传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788	网址：www.66zichan.com
(70) 海银基金销售有限公司	
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元	
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号6楼	
法定代表人：刘惠	联系人：毛林
电话：021-80133597	传真：021-80133413
客户服务电话：4008081016	网址：www.fundhaiyin.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

## 二、与本基金有关的注册登记机构、律师事务所、会计师事务所信息：

信息类型	注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	上海源泰律师事务所	毕马威华振会计师事务所
注册地址	北京市西城区太平桥大街17号	上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室	北京东长安街1号东方广场东2座8层
办公地址	北京市西城区太平桥大街17号	上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室	上海南京西路1266号恒隆广场50楼



法定代表人	金颖	廖海（负责人）	姚建华
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-22122888
传真	010-59378907	021-51150398	021-62881889
联系人	崔巍	廖海、刘佳	王国蓓（王国蓓、虞京京为 经办注册会计师）

## 第二十二章 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金管理人

##### 1、基金管理人基本情况

名称：长信基金管理有限责任公司

住所：上海市银城中路68号9楼

法定代表人：田丹

成立日期：2003年5月9日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]63号

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  
(涉及许可经营的凭许可证经营)

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期间：持续经营

##### 2、基金管理人的权利

(1) 依法申请并募集基金，办理基金备案手续；

(2) 依照法律法规和基金合同运用基金财产；

(3) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

(4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理人报酬，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；

(5) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；

(6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合

同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行承担基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(16) 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并确定有关费率；

(17) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(18) 选择、增补、更换基金投资顾问，并对其行为进行必要的监督；

(19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 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；

(21) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

### 3、基金管理人的义务

- (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) 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；
- (3) 办理基金备案手续；
- (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、分别记帐，进行证券投资；
- (6) 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；
- (7) 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；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督，并向基金托管人提供与本基金有关的基金资产投资所在国家及地区法律的相关规定及限制；
- (10) 提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；
- (11) 编制季报、半年报和年度基金报告；
- (12) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；
- (13) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (14) 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；
- (15) 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以保密，不得向他人泄露；
- (16) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表、代表基金签订的重大合同和其他相关资料；

(18) 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；

(19) 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；

(20) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(22) 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；

(23) 基金管理人对其委托的投资顾问（如聘用，下同）及其他第三方机构的行为承担责任；

(24) 中国证监会规定的其他职责。

## **(二) 基金托管人**

### **1、基金托管人基本情况**

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；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

险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

## 2、基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 选择、更换境外托管人并为之签署有关协议；
- (7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

## 3、基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；
- (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，负责基金财产境内托管事宜；
- (3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (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；
- (5) 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和独立；
- (6) 保管（或委托境外托管人）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；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照有关法律法规、基金合同的约定，执行基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；



- (9) 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以保密，不得向他人泄露；
- (10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、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；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 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，确保基金份额净值按照有关法律法规、基金合同规定的方法进行计算；
- (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) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；除法律法规或中国证监会另有规定外，基金托管人不承担连带责任；
- (19) 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；
- (20) 对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任；
- (21) 保护投资者利益，按照规定对本基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、国家外汇局报告；
- (22) 确保本基金按照有关法律法规、基金合同约定的投资目标和限制进行管理；
- (23) 确保基金按照有关法律法规、基金合同的规定进行申购、认购、赎回等日常交易；
- (24) 确保基金根据有关法律法规、基金合同确定并实施收益分配方案；

(25) 按照有关法律法规、基金合同的规定以受托人名义或其指定的代理人名义登记资产；

(26) 每月结束后7个工作日内，向中国证监会和国家外汇局报告境内机构投资者境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

(27) 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### (三) 基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的权利

- (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) 依法转让或者申请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、销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### 3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (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利益的活动；

- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 基金份额持有人应遵守基金管理人及其代理销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (8) 法律法规及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

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。

(二) 有以下事由情形之一时，应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、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会程序；
- 8、本基金与其它基金合并；
- 9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 10、法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三) 以下情况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；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 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；
- 6、经中国证监会允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规

规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

#### **(四) 召集方式：**

1、除法律法规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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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、代表基金份额百分之十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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

4、代表基金份额百分之十以上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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

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。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权

益登记日。

### （五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项；
- 3、投票委托书的内容（包括但不限于代理人身份、授权范围、授权的有效期限等）送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、权益登记日；
- 6、如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

### （六）开会方式

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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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，基金管理人或基金托管人不派代表出席的，不影响表决效力；通讯方式开会指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面或召开通知认可的其他形式在表决截止日以前提交至召集人指定的地址。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和提前终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

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和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；
- 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，全部有效凭证所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的50%（含50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公告会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人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；

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代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的50%（含50%）；

4、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其它代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和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；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在25个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### （七）议事内容与程序

#### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额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：

1) 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。

2) 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作出决定。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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%或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，或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，未获得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，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 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

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

### (八) 表决

1、基金份额持有人所持每份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) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

#### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或提前终止基金合同应当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，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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。

3、采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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。

### （九）计票

#### 1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）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中推举三名基金份额持有人担任监票人。

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

（3）如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议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，会议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。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

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。



## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：由大会召集人聘请的公证机关的公证员对计票进行监督。

### （十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五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。

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、基金托管人均有法律约束力。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的决定。

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒体公告。

4、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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

（十一）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 三、基金受益分配原则、执行方式

### （一）基金利润的构成

本基金合同项下基金利润即为基金收益。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。

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。

### （二）收益分配原则

基金收益分配是指按规定将基金的期末可供分配利润按基金份额进行比例分配。

1、基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金

红利；

3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者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，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

5、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

6、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净值分配金额后不能低于面值；

7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。

法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配方案的确定与公告

在不影响投资者利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒体和基金管理人网站公告。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

### （五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当投资者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基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务

规则》执行。

#### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费（如基金管理人委托投资顾问，包括投资顾问费）；
- 2、基金托管人的托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）；
- 3、基金的证券交易费用、在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费、律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用；
- 7、基金的资金汇划费用；
- 8、外汇兑换交易的相关费用；
- 9、代表基金投票的费用；
- 10、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）；
- 11、更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移至新基金托管人所引起的费用；
- 12、经生效的司法文书判决或裁定明确应由基金资产承担的与基金有关的诉讼、追索费用；
- 13、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

##### (二) 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1.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金的管理费

E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

## 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0.3%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.3\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、上述“一、基金费用的种类”中第3—13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。

### （三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，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。

### （四）基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和标普100等权重指数（本基金的标的指数）收益率之间的日均跟踪误差控制在0.50%以内（相应的年化跟踪误差控制在7.94%以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。

## （二）基准货币

人民币

## （三）投资范围

本基金主要投资于标普100等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为股票指数增强型基金，对标普100等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的80%-95%；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

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

## （四）投资理念

本基金将采用“指数化投资为主、主动性投资为辅”的投资理念，在最小化和控制跟踪误差的基础上通过有效的资产及行业组合和基本面研究力求投资收益能够有效跟踪并适度超越标的指数。

## （五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

标准普尔100等权重指数总收益率

本基金为增强型股票指数基金，不低于基金资产净值80%的部分将投资于标准普尔100等权重指数成份股，不高于基金资产净值15%的增强型部分将主要投资于在美国公开上市的权益类证券。因此，本基金设置标准普尔100等权重指数总收益率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、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业绩基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以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

本基金是股票指数增强型基金,本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关,为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

### (七) 投资限制

1、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) 向他人贷款或提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 购买不动产;
- (5) 购买房地产抵押按揭;
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证;
- (7) 购买实物商品;
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金;
- (9) 利用融资购买证券,但投资金融衍生品除外;
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易;
- (11) 直接投资与实物商品相关的衍生品;
- (12) 向基金管理人、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债券;
- (13) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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;
- (14) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
- (15) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述限制,在可适用于本基金的情况下,则本基

金投资不再受相关限制。

2、投资组合限制：

- (1) 对标普100等权重指数的成份股的投资不低于基金资产净值的80%。
- (2) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。
- (3) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。
- (4) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。
- (5) 单只基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。
- (6) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。
- (7) 基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。
- (8) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。
- (9) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的10%，持有货币市场基金可以不受该等限制。
- (10) 本合同、中国法律法规及中国证监会规定的其他限制。

若基金超过上述（2）、（4）、（5）、（9）项规定的投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制的要求。

3、本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

- (1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2)应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。

(3)借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4)除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

1) 现金；

2) 存款证明；

3) 商业票据；

4) 政府债券；

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

(5)本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6)基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

4、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

(1)所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2)参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

(3)买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4)参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

(5)基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何



损失负相应责任。

5、基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

6、若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

#### 7、投资组合比例调整

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约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在30个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

### 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

#### （一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

#### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

#### （三）估值方法

本基金的估值对象为本基金所拥有的证券和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

本基金的估值方式如下：

##### 1、上市流通股票：

如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。

如估值日无市价，且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了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值

的影响在 0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

## 2、未上市股票：

送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次公开发行且未上市的股票，按成本价估值。

首次发行且有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同时股票的市价估值。

## 3、金融衍生品：

(1) 上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

(3) 衍生品的估值，可以参照国际会计准则进行。

4、基金持有的债券、交易型开放式指数基金（ETF）等其他有价证券，上市交易的有价证券按估值日的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

5、开放式基金以估值时点能够取得的最新基金份额净值进行估值。

## 6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法：

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可以根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

## 7、估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及美元、港币对人民币汇率的，采用当日中国人民银行或其授

权机构公布的人民币汇率中间价。

8、在任何情况下，基金管理人如采用本项第1-7小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第1-7小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

#### **（四）基金资产净值、基金份额净值公告**

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。如本基金投资衍生品，应当在每个工作日计算并披露基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或赎回之后，基金管理人应当在T+2日（T日为开放日）通过网站、基金份额发售网点以及其他指定媒体，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日后2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媒体和网站上。

### **七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式**

#### **（一）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第九部分第（二）点规定的对基金合同当事人权利义务产生重大影响的事项应经基金份额持有人大会决议通过。

2、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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

#### **（二）基金合同的终止**

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

### **(三) 基金财产的清算**

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金财产进行清算。

#### **2、基金财产清算组**

(1) 自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(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。

#### **3、清算程序**

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 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；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

#### **4、清算费用**

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金剩余财产的分配

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）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

### 八、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议应首先通过友好协商解决。但若自一方书面要求协商解决争议发生之日起60日内未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复印件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十三章 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：长信基金管理有限责任公司

住所：上海市银城中路68号9楼

法定代表人：田丹

成立日期：2003年5月9日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字【2003】63号

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（涉及许可经营的凭许可证经营）

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发

行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。

基金托管人根据下述投资范围对基金的投资进行监督：

本基金主要投资于标普 100 等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

2、依照《基金合同》约定的投资限制比例对基金投融资比例进行监督：

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金为股票指数增强型基金，对标普 100 等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的 80%-95%；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的 5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的 0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适

当程序后，可以将其纳入投资范围。

(2) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1) 对标普100等权重指数的成份股的投资不低于基金资产净值的80%。

2) 基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

3) 为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。

4) 基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

5) 单只基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。

6) 基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。

7) 基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。

8) 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：1) 所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；2) 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；3) 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。

9) 本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的10%，持有货币市场基金可以不受该等限制。

10) 本合同、中国法律法规及中国证监会规定的其他限制。

若基金超过上述2)、4)、5)、9)项规定的投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制的要求。

11) 本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

A、所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。



B、应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

C、借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

D、除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：

a、现金；

b、存款证明；

c、商业票据；

d、政府债券；

e、中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

E、本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

F、基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

12) 基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

A、所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

B、参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

C、买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

D、参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

E、基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

13) 基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的 50%。

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。除投资资产配置外，基金托管人对基金的投资的监督和检查自本基金合同生效之日起开始。

3、对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互并在有变化的情况下及时提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列投资或活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 购买不动产；
- (5) 购买房地产抵押按揭；
- (6) 购买贵金属或代表贵金属的凭证；
- (7) 购买实物商品；
- (8) 除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
- (9) 利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
- (10) 参与未持有基础资产的卖空交易；
- (11) 直接投资与实物商品相关的衍生品；
- (12) 向基金管理人、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债券；
- (13) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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；
- (14) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (15) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其

他行为。

如法律法规或监管部门取消上述限制，在可适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

4、基金管理人向基金托管人提供其回购交易及监督所需的其他投资品种的交易对手库，交易对手库由信用等级符合《通知》要求的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人进行金融衍生品、证券借贷、回购交易时，交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

6、对法律法规规定及《基金合同》中基金投资的其他方面进行监督。

(二) 基金托管人应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业务复核。

(三) 基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时通知基金管理人，由基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(四) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，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规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(五) 基金托管人对基金管理人基金财产的投资运作于估值日结束且相关数据齐备后，进行交易后的投资监控和报告。

(六) 基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性受限于基金管理人或其他中介机构提供的数据和信息，基金托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损

失不负任何责任。

(七) 基金托管人对基金管理人的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)及其投资回报不承担任何责任。

### 三、基金管理人<sup>对</sup>基金托管人的业务核查

(一) 在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于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。

(二) 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、无正当理由未执行或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法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时,应及时以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对基金管理人发出回函。在限期内,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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。

(三) 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。基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督,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

#### (一) 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,未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的所有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、基金托管人可将基金财产安全保管和办理与基金财产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。

6、现金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有。

7、托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例，支付现金、办理证券登记等托管业务。

8、除依据有关法律法规规定和本协议约定外，基金托管人及其境外托管人不得利用基金财产为自己或第三方谋取利益，违反此义务所得利益归于基金财产，由此造成的直接损失由基金托管人承担，该等责任包括但不限于恢复基金财产的原状、承担因此所引起的直接损失的赔偿责任；

9、基金托管人自身并确保境外托管人不得自行运用、处分、分配托管证券；

10、除非根据基金管理人书面同意，基金托管人自身并确保境外托管人不得在任何基金资产上设立任何担保权利，包括但不限于抵押、质押等，但根据有关适用法律的规定而产生的担保权利除外；

11、对于因为基金管理人进行本协议项下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。如因基金持有的资产所产生的应收资产，并由基金托管人作为资产持有人，基金托管人应负责与有关当事人确定到账日期并通知基金管理人。到账日没有到达托管账户的，基金托管人应及时通知并配合基金管理人采取措施进行催收。

## **(二) 基金募集期间及募集资金的验资**

1、基金募集期间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以基金管理人的名义开立并管理。

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《基金合同》及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，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。验资完成后，基金管理人应督促本基金的基金注册登记机构将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立并指定的基金托管银行账户中，并确保划入的资金与

验资确认金额相一致。

3、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》及其他有关规定的生效条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### **(三) 基金银行账户的开立和管理**

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。

3、本基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。

### **(四) 基金证券账户的开立和管理**

1、基金托管人在基金所投资市场的交易所或登记结算机构或境外托管人处，按照该交易所或登记结算机构的业务规则为基金开立证券账户。

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以及各自委托代理人均不得出借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相关证明文件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、除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为，基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金财产中的证券的所有权、合法性或真实性（包括是否以良好形式转让）。基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

### **(五) 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，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和《基金合同》的规定，由基金托管人或境外托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、投资市场所在国家或地区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。

#### **(六) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管**

基金财产投资的有价凭证等的保管按照实物证券相关规定办理。

基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### **(七) 与基金财产有关的重大合同的保管**

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应及时将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少20年。

#### **(八) 证券登记**

1、境外证券的注册登记方式应符合投资当地市场的有关法律、法规和市场惯例。

2、基金托管人应确保基金管理人所管理的基金始终是以所有证券的实际受益人的方式持有基金财产中的所有证券。

3、基金托管人应该：(a)在其账目和记录中单独列记属于本基金的证券，并且(b)要求其境外托管人在其账目和记录中单独清楚列记证券不属于境外托管人，不论证券以何人的名义登记。而且，若证券由基金托管人、境外托管人以无记名方式实际持有，要求其境外托管人将这些证券和基金托管人、其境外托管人自有资产、任何其他人的资产分别独立存放，并且确保基金有实际的所有权，但须遵守管辖该系统运营的规则、条例和条件。

#### **(九) 基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管**

基金托管人对基金财产投资的有关实物证券应妥善保管。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

基金资产的净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行，基金管理人可以

委托第三方机构完成。

## 五、基金资产净值计算与复核

### (一) 基金资产净值的计算和复核

#### 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后的价值。

#### 2、净值计算

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每个工作日将计算的前一工作日的基金份额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。

基金份额净值的计算精确到0.001人民币，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### 3、复核程序

基金管理人（或其委托的第三方机构）每个估值日对基金进行估值，估值原则应符合《基金合同》、《企业会计准则》及其他法律法规的规定。每个估值日后一工作日12:30之前，基金管理人将前一估值日的基金估值结果以书面形式报送基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在当日18:00之前盖章或签字后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人定期对外公布。基金月末、季末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

4、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

6、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；基金份额净值计算差错小于基金



份额净值 0.5%时，基金管理人与基金托管人应在发现日对账务进行更正调整，不做追溯处理；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

7、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在偏差并且偏差在合理的范围内，基金份额净值以基金管理人的计算结果为准，基金管理费和基金托管费也应以基金管理人的净值计算结果计提。

8、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，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。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

9、由于证券交易所及其登记结算公司及其他中介机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

10、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## **(二) 估值方法**

本基金的估值对象为本基金所拥有的证券和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

本基金的估值方式如下：

### **1、上市流通股票：**

如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。

如估值日无市价，且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了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

## 2、未上市股票：

送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次公开发行且未上市的股票，按成本价估值。

首次发行且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估值。

## 3、金融衍生品：

(1) 上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

(3) 衍生品的估值，可以参照国际会计准则进行。

4、基金持有的债券、交易型开放式指数基金（ETF）等其他有价证券，上市交易的有价证券按估值日的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

5、开放式基金以估值时点能够取得的最新基金份额净值进行估值。

6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法：

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可以根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及美元、港币对人民币汇率的，采用当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。

8、在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1-7 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1-7 小项规定的方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

### **(三) 基金会计核算**

#### **1、基金账册的建立**

基金管理人或其委托的第三方机构和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

#### **2、会计数据和财务指标的核对**

基金管理人或其委托的第三方机构和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

#### **3、基金财务报表和定期报告的编制和复核**

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 45 日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 70 日内，

基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度终了后 90 日内予以公告。《基金合同》生效不足两个月的，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。

基金管理人或其委托的第三方机构在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人或其委托的第三方机构在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人或其委托的第三方机构在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人或其委托的第三方机构在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人或其委托的第三方机构和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人或其委托的第三方机构提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人或其委托的第三方机构与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于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包括以下几类：

- 1、《基金合同》生效日的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；

- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

## **(二) 基金份额持有人名册的提供**

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于《基金合同》生效日的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

## **(三) 基金份额持有人名册的保管**

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、《基金合同》和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行《基金合同》和本协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。

## **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解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现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。

争议处理期间，双方当事人应各自继续履行《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。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## **八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算**

### **(一) 托管协议的修改程序**

本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。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

中国证监会核准后生效。

## （二）基金托管协议终止出现的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## （三）基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 第二十四章 基金份额持有人服务

长信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”，或“基金管理人”，或“公司”）将为基金份额持有人提供一系列的服务，并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。基金份额持有人可以通过销售网点、客户服务中心、网站等渠道享受全方位、全过程的服务。以下是主要的服务方式和内容：

基金份额持有人服务内容			
序号	类型	明细	内容详述
(一)	账户服务	对账单寄送服务	每次交易结束后，投资者可在 T+3 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单； 每月结束后的 5 个工作日内，基金管理人根据投资者的对账单定制需求以书面或电子形式寄送交易对账单。
		其他资料	基金管理人将按基金份额持有人的需求不定期向其邮寄相关公司介绍和产品介绍的资料。
(二)	查询服务	网络在线查询	客户通过基金账户号码或开户证件号码登录基金管理人网站“查询/交易登录”栏目，可享有账户查询、短信/邮件信息定制、资料修改、在线咨询等多项在线服务。
		交易信息查询	在一笔交易结束后，投资者可在 T+3 个工作日开始通过销售机构的网点或登录基金管理人网站“查询/交易登录”栏目查询交易情况，包括客户购买总金额、基金购买份额、基金分红份额、历史交易信息等等。
		客户账户信息的修改	基金份额持有人可以直接登录基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话、电子邮箱等等。也可以亲自到直销网点或致电客户服务专线，由人工坐席提供相关服务。 为了维护投资者的利益，投资者重要信息的更改手续办理如下： 1、代销客户由代销渠道提交办理（具体提供材料请咨询代销机构）。以配号方式开立的开放式基金账户资料中的投资者名称、证件类型、证件号码的变更业务，在一个工作日内，对单个开放式基金账户只能修改其中一项关键信息。 2、直销客户：非正常变更需要提供本人身份证复印件、公安机关证明原件、开放式基金账户业务申请表以及开放式基金账户资料变更申请表；正常变更需要提供身份证复印件、开放式基金账户业务申请表开放式基金账户资料变更申请表以及银行柜台的新旧卡转换证明原件，邮寄到本公司。
(三)	基金投资的服务	网上交易	投资者除可通过销售机构和基金管理人的直销网点办理申购、赎回及信息查询外，还可通过基金管理人的网站（www.cxfund.com.cn）享受网上交易服务。具体业务规则详见本公司网站说明。
		定期定额	通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定

		投资计划	额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则和开放时间另行公告。
		定期不定额投资计划	通过定期不定额投资计划，投资者可以通过本公司“长金通”网上直销平台提交交易申请，约定“基金品种”、“每月扣款日期”、“基准金额”、“标的指数”、“均线种类”、“级差”等参数，用指定的计算方法计算出投资金额，委托本公司完成交易的一种基金投资方式。
		定期不定额转换	通过定期不定额转换投资计划，投资者可以通过本公司“长金通”网上直销平台提交交易申请，约定“基金品种”、“每月转换日期”、“基准份额”、“标的指数”、“均线种类”、“级差”等参数，用指定的计算方法计算出投资份额，委托本公司完成交易的一种基金投资方式。
		红利再投资	本基金收益分配时，经投资者选择，基金管理人将为持有人提供红利再投资服务，其分红资金按除息日的基金份额净值自动转成相应的基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时（权益登记日申请设置的分红方式对当次分红无效）选择更改基金分红方式。
(四)	客户服务中心电话服务		客户服务中心自动语音系统提供7×24小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。 客户服务中心人工坐席提供每周5天的坐席服务，投资者可以通过该专线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。
(五)	客户投诉受理服务	客户投诉处理流程	本公司客户投诉受理由客户服务中心统一管理，指定专人负责，设定专门的投诉管理工作流程，并由监察稽核部负责督促投诉的处理情况。
		客户投诉方式	投资者可通过本公司的客户服务专线（400-700-5566）、代销机构、公司网站（www.cxfund.com.cn）、电子邮件（service@cxfund.com.cn）、信件、传真（021-61009865）、各销售机构网点柜台等多种形式对本公司所提供的服务以及公司的政策规定进行投诉。客户投诉都将被定期汇总登记并存档，通过拨打客户服务专线进行的投诉将被电话录音存档，本公司将采取适当措施，及时妥善处理客户投诉，总结相关问题，完善内控制度。
(六)	增值服务	信息定制服务	基金份额持有人可以在基金管理人网站或致电客户服务专线定制自己所需要的信息，包括产品净值、交易确认、公司新闻、基金信息等方面的内容。基金管理人按照要求，将以手机短信或者电子邮件的方式定期向投资者发送信息。
		个性化理财服务	随着公司的发展，本公司将酌情为基金份额持有人提供个性化理财服务，如配备理财顾问为基金份额持有人提供理财建议以及相关的理财计划等形式。
		组织投资者交流会	本公司将不定期地举行投资者交流会，为基金份额持有人提供基金、投资、理财等方面的讲座，使得本公司基金份额持有人能得到更多的理财信息和其他增值服务。另外，本公司基金经



			理也将通过多种方式不定期地与基金份额持有人交流,让基金份额持有人了解更多基金运作情况。
(七)	投资者教育服务		为了进一步做好投资者服务,让投资者了解证券市场和各类证券投资品种的特点和风险,熟悉证券市场的法律法规,树立正确的投资理念,增强风险防范意识,依法维护自身合法权益,本公司将开展普及证券知识、宣传政策法规、揭示市场风险、引导依法维权等投资者教育活动。
(八)	公开信息披露服务	披露公司信息	为方便社会公众了解公司的信息,包括本公司的发展概况、组织结构、公司文化、经营理念、经营管理层、经营情况等公开信息,本公司开通了全国统一的客户服务专线 400-700-5566(免长话费)和公司网站(www.cxfund.com.cn),以方便投资者查询。
		披露基金信息	本公司将按规定在中国证监会指定的信息披露媒体上披露法定的文件、公告信息。 本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构及相关基金宣传资料来披露本基金相关信息,包括本基金的概况、投资理念、投资对象、风险收益特征、净值及其变化情况、基金经理介绍等多方面的信息。
		其他信息的披露	本公司客户服务中心和网站除为投资者提供上述信息咨询外,还提供其他信息咨询,包括托管人的情况、基金知识、市场新闻和行情、产品信息等多方面内容。
(九)	客户服务联络方式	客户服务专线	4007005566(免长话费)、工作时间(8:30-12:00,13:00-17:00)内可转人工坐席。
		传真	021-61009865
		公司网址	http://www.cxfund.com.cn
		电子信箱	service@cxfund.com.cn

## 第二十五章 其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安证券有限责任公司申购费率优惠的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2015-10-16
2	长信基金管理有限责任公司关于“长金通”网上直销平台申购（含定期定额申购）费率优惠的公告	上证报、中证报 证券时报	2015-10-21
3	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中证报、证券时报、上证报	2015-10-26
4	长信基金管理有限责任公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2015-10-29
5	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金更新的招募说明书(2015 年第【2】号)及摘要	上证报、中证报、 证券时报	2015-11-13
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-11-16
7	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-11-24
8	长信基金管理有限责任公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2015-11-26
9	长信基金管理有限责任公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2015-12-1
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安证券有限责任公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2015-12-18
11	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-12-23

12	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2016 年开放日的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-12-30
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司基金组合申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-12-30
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-12-30
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报	2015-12-30
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金调整开放时间的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日报	2015-12-31
17	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016-1-14
18	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上证报、中证报、 证券时报、公司网站	2016-1-20
19	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016-2-4
20	长信基金管理有限责任公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券日报	2016-3-1
21	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管等业务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016-3-23
22	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2015 年年度报告及摘要	上证报、中证报、 证券时报	2016-3-26
<b>本信息披露事项截止时间为 2016 年 3 月 30 日</b>			

## 第二十六章 招募说明书存放及其查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记机构、基金销售机构处，投资者可在营业时间免费查阅。基金投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站(<http://www.cxfund.com.cn>)查阅和下载招募说明书

## 第二十七章 备查文件

### 一、本基金备查文件包括下列文件：

1、中国证监会核准长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金募集的文件；

2、《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金基金合同》；

3、《长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金托管协议》；

4、关于申请募集长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金之法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

### 二、备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 第二十八章 其他需投资者获悉的内容

### 一、标准普尔 100 等权重指数的基本情况

本基金的标的指数为标准普尔100等权重指数(彭博代码：SPOEXEUT、SPOEXEUP)，英文名称为S&P 100 Equal Weight Index。标准普尔100等权重指数是代表美国超大市值蓝筹股票的一个著名指数，由标准普尔公司于2009年底推出。长信基金选取标准普尔100等权重指数作为其第一支QDII增强型基金的指数基于以下考虑：

首先，标准普尔 100 等权重指数在过去九年的回报高于标准普尔 100 指数（2000/12/29-2009/12/29 期间，标准普尔 100 等权重指数相对于标准普尔 100 指数总的超额收益达 13.06%）。

其次，相对于标准普尔 100 指数，标准普尔 100 等权重指数更注重对美国蓝筹股中的中小市值股票的投资，长期来看有更好的成长性。

### 二、标准普尔 100 等权重指数成分股的构成

标准普尔 100 等权重指数成分股覆盖了 GICS 分类的十个一级行业，其行业权重较为分散。截至 2009 年 12 月 31 日，十个一级行业中有五大行业市值权重超过 10%，权重最大的信息科技行业仅占 18%。

从行业集中度看，成分股集中在信息科技、能源，医疗保健、日常消费品和金融五大行业，其权重为 75%，其中权重超过 10%的行业分别为：信息科技占比为 18%、能源占比为 16%，医疗保健占比为 15%、日常消费品占比为 15%，金融占比为 11%。

### 三、标准普尔 100 等权重指数成分股的编制

标准普尔 100 等权重指数由 100 个在各行业具有领导地位的、成熟的公司股票组成，其市值代表整个美国股市市值的 45%。标准普尔 100 等权重指数是一种资本等权重的指数，其所有成员股在季度末调整之后在指数中占有相同的资本比重（1%），不随成员股市值的不同或变化而改变。

标准普尔 100 等权重指数的选择标准和标准普尔 100 指数相同：

1、必须是标准普尔 500 指数（S&P 500 Index）的成员并且是标准普尔 500 指数中大市值和高稳定性的公司；

- 2、公司必须保持期权在交易所公开交易；
- 3、必须是美国公司，并满足公司所在地、公司架构、会计标准和上市交易所等一系列的要求；
- 4、市值必须大于标准普尔 500 指数所规定的最小市值；
- 5、流通股必须占总股本的 50%以上；
- 6、有连续四个季度的盈利记录，其中盈利是指公认会计准则所定义的不包括终止经营业务及非经常项目的净利润；
- 7、有充足的流动性，并且股票价格合理。每年的美元交易量和市值的比率应为 0.30 或更高；
- 8、在所属行业具有代表性，并且行业配置和标普 500 指数相似。

#### 四、调整方法

- 1、每年定期四次审核样本股，并根据审核结果调整指数成分股及其权重；
- 2、样本股调整实施时间为每个季度最后一个月的第三个星期五股市闭市之后；
- 3、调整的目标是在尽量减少换手率的前提下，保持 100 个成份股的权重相同，即每个成份股在调整之后权重为 1%；
- 4、指数成份股的增删与标准普尔 100 指数相同；
- 5、如果在季度中发生成份股加入的情况，其权重占比将和标准普尔 100 等权重指数中被替代的成分股相同。当被替代的成份股价格为零时，则以前一个其股价不为零的工作日的权重为加入成份股的权重；
- 6、成份股因成员变化、并购、特殊分红等公司行为而需进行成份股及权重调整时，指数样本进行不定期调整，具体调整方法如下表所示：

公司行为	本基金调整
资产剥离 (Spin-off)	卖出子公司证券，买入母公司股票
配股权发售 (Rights Offering)	卖出权益，买入母公司股票
特别股息 (Special Dividends)	买入特别股息金额的指数组合
现金股利 (Cash Dividends)	无需调整
股票分割 (Stock Split)	无需调整
增发或回购 (Share Issuance or Share Repurchase)	无需调整

#### 五、发布和查询渠道

标准普尔 100 等权重指数（彭博代码：SPOEXEUT、SPOEXEUP）的详细信息通

过两种方式发布:

1、彭博资讯(<http://www.bloomberg.com/>)实时公布指数的基本信息, 点位, 成份股权重, 以及其它相关信息;

2、标准普尔公司每天在指定服务器上([edx.standardandpoors.com](http://edx.standardandpoors.com))公布指数点位, 成份股权重, 以及成份股调整等信息。

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年五月十三日