

**长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金
招募说明书更新
(首次更新)**

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一八年一月

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金经2015年9月1日中国证券监督管理委员会证监许可[2015] 2048号文注册募集。基金合同于2017年6月1日生效。

重要提示

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

(二) 投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

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

(四) 本招募说明书所载内容截止日为2017年11月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年9月30日(财务数据未经审计)。

(五) 本基金托管人中国工商银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

目 录

一、绪言.....	3
二、释义.....	4
三、基金管理人.....	7
四、基金托管人.....	18
五、相关服务机构.....	23
六、基金的募集与基金合同的生效.....	44
七、基金份额的申购与赎回.....	45
八、基金的投资管理.....	54
九、基金的业绩.....	64
十、基金的财产.....	65
十一、基金资产的估值.....	66
十二、基金的收益分配.....	70
十三、基金的费用与税收.....	71
十四、基金的会计与审计.....	76
十五、基金的信息披露.....	77
十六、风险揭示.....	82
十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	84
十八、基金合同的内容摘要.....	86
十九、基金托管协议的内容摘要.....	98
二十、对基金份额持有人的服务.....	114
二十一、其他应披露事项.....	115
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....	118
二十三、备查文件.....	119

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集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》”)等有关法律法规及《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指长城基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 17、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 19、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证

监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

22、销售机构：指长城基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

23、直销机构：指长城基金管理有限公司

24、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点 26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为长城基金管理有限公司或接受长城基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过三个月

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

36、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

37、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指长城基金管理有限公司开放式基金业务规则，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

40、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

41、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

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

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

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

45、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、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人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

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

47、元：指人民币元

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

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

50、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

51、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

52、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

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

54、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

一、基金管理人情况

1. 名称：长城基金管理有限公司
2. 住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
3. 办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40-41 层
4. 法定代表人：何伟
5. 组织形式：有限责任公司
6. 设立日期：2001 年 12 月 27 日
7. 电话：0755-23982338 传真：0755-23982328
8. 联系人：袁江天
9. 管理基金情况：目前管理长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金等四十三只基金。

10. 客户服务电话：400-8868-666

11. 注册资本：壹亿伍仟万元

12. 股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券股份有限公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

二、基金管理人主要人员情况

1. 董事、监事及高管人员介绍

(1) 董事

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

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

范小新先生，董事，博士，高级经济师。现任长城证券股份有限公司党委委员，宝城期货有限责任公司董事长。曾任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理，长城证券股份有限公司纪委书记、副总经理。

杨玉成先生，董事，硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，东方金融控股（香港）有限公司董事长，上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师，君安证券有限公司证券投资部总经理助理，上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，

东方证券股份有限公司财务总监、副总经理，申能集团财务有限公司董事、总经理。

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

金树良先生，董事，硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

王连洲先生，独立董事，现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行总行印制管理局工作，1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。

万建华先生，独立董事，硕士。现任上海市互联网金融行业协会会长，通联支付网络股份有限公司董事。曾任中国人民银行资金管理司处长，招商银行总行常务副行长兼上海分行行长(期间兼任长城证券股份有限公司董事长、国通证券有限责任公司(现招商证券股份有限公司)董事长)，中国银联股份有限公司党委书记、总裁，上海国际集团党委副书记、副董事长、总经理，国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长，证通股份有限公司董事长。

徐英女士，独立董事，学士。现已退休。曾任北京财贸学院金融系助教、讲师，海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理，长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记，景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事，新华资产管理股份有限公司副董事长。

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

(2) 监事

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

曾广炜先生，监事，高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制部总经理。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司，2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。

杨斌先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司首席风险官、合规总监。曾就职于中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处，自1998年7月至2015年5月先后于上海证监局稽查处、案件审理处、案件调查一处、机构监管一处、期货监管处、法制工作处等部门任职，历任科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长。

黄魁粉女士，监事，硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002年7月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

袁江天先生，监事，博士。现任长城基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书、综合管理部总经理。曾任职于广西国际信托投资公司投资管理部、国海（广西）证券有限责任公司投资银行部、证券营业部、总裁办、北方国际信托投资股份有限公司博士后工作站。

王燕女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理、综合管理部副总经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作，2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

（3）高级管理人员

何伟先生，董事长，简历同上。

熊科金先生，董事、总经理，简历同上。

彭洪波先生，副总经理，硕士。曾就职于长城证券股份有限公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理。

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

杨建华先生，副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、研究部总经理、投资决策委员会委员、基金经理，硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司工作，历

任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理、“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理、“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理，期间曾任公司总经理助理。

卢盛春先生，副总经理、机构理财部总经理，硕士。曾就职于中国人民银行江西省分行、交通银行海南分行、海通证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、西北证券有限责任公司、华商基金管理有限公司（筹备组）。2003年进入长城基金管理有限公司，历任上海分公司总经理、北京分公司总经理、公司总经理助理。

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

2. 本基金基金经理简历

赵波先生，伦敦大学皇家霍洛威学院学士、伦敦城市大学卡斯商学院硕士。曾就职于中银国际证券有限责任公司。2011年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理助理，自2014年4月26日至今任“长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金”、自2016年1月21日至今任“长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金”基金经理、自2017年4月26日至今任“长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2017年6月1日至今任“长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2017年8月18日至今任“长城双动力混合型证券投资基金”基金经理。

郑帮强先生，华中科技大学工业工程学士、华中科技大学管理科学与工程硕士。曾就职于长江证券股份有限公司。2013年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理助理。自2015年7月8日起担任“长城优化升级混合型证券投资基金”基金经理，自2016年1月21日起担任“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理，自2017年3月16日起担任“长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2017年6月8日担任“长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。

3. 本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。

杨建华先生，投资决策委员会委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、研究部总经理、基金经理。

4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人应履行以下职责：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 10、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
- 17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理

成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

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

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人承诺

1. 基金管理人承诺

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

2. 基金管理人的禁止性行为

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

五、基金经理承诺

1. 依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2. 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3. 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4. 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

六、基金管理人的内部控制制度

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

1. 风险控制的目标

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

(1) 确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行;

(2) 建立符合现代企业制度要求的法人治理结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制;

(3) 不断提高基金管理的效率和效益,在有效控制风险的前提下,努力实现基金份额持有人利益最大化;

(4) 努力将各种风险控制在规定的范围内,保障公司发展战略和经营目标的全面实施,维护公司股东的合法权益;

(5) 建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

2. 建立风险控制制度的原则

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

(1) 全面性原则:风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

(2) 审慎性原则:内部风险控制的核心是有效防范各种风险,公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;

(3) 独立性原则:公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行

部门；风险控制委员会、合规审查委员会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查；

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

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

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

3. 风险控制的主要内容

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

4. 风险控制体系

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

(1) 一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

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

- ①协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。

②审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。

③检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况，并出具评估意见或改正方案。

④定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报。

⑤检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见。

⑥评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险，检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性，并提出改进意见。

⑦检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序，与外部审计机构进行交流。

⑧对公司内部控制和风险管理工作进行考核。

⑨董事会安排的其他事项。

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

(2) 二级风险防范

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

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

①研究并确立公司的基金投资理念和投资方向；

②决定基金资产在现金、债券和股票中的分配比例；

③审核基金经理提出的投资组合方案，对其运作过程中的风险进行评估和控制；

④批准基金经理拟订的投资原则，对基金经理做出投资授权；

⑤对超出投资决策委员会执行委员及基金经理权限的投资项目作出决定。

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

①根据各项风险的产生环节，和相关的业务部门一起，共同制定对风险的事前防范和事后审查方案；

②就各部门内部风险控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告及建议职能；

③调查公司内部的违规案件，协助监管机构处理相关事宜；

④对基金运作和公司内部管理进行日常监督与稽核，并向总经理汇报。

(3) 三级风险防范

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

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

①一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；

②相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各部门和岗位分别在自己的授权范围内承担各自的职责，将风险控制的最小范围内。

四、基金托管人

一、基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

2、主要人员情况

截至 2017 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 218 人，平均年龄 30 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 745 只。自 2003 年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 54 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

二、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年、2016 年中国工商银行资产托管部均通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅，迄今已第十次获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1. 直销机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40-41 层

法定代表人：何伟

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

2. 代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

联系人：李鸿岩

电话：010-66107913

网址：www.icbc.com.cn

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

联系人：刘文霞

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客服电话：95566

网址: www.boc.cn

(3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

联系人: 张静

电话: 010-66275654

客户服务电话: 95533

网站: www.ccb.com

(4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址: 北京市海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人: 周慕冰

联系人: 邱泽滨

电话: 010-85107926

传真: 010-85109230

客户服务电话: 95599

网站: www.abchina.com

(5) 交通银行股份有限公司

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

电话: 021-58781234

传真: 021-58408842

联系人: 张宏革

客户服务电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(6) 招商银行股份有限公司

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

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(7) 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

传真：021-63604199

网址：www.spdb.com.cn

客户服务电话：95528

(8) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

联系人：丰靖

电话：010-65550827

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

网站：bank.ecitic.com

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：孔超

电话：010-66223588

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站: www.bankofbeijing.com.cn

(10) 宁波银行股份有限公司

注册地址: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人: 陆华裕

联系人: 邱艇

电话: 0574-87050397

客服电话: 95574

公司网站: www.nbcb.cn

(11) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址: 东莞市南城路 2 号

办公地址: 东莞市南城路 2 号

法定代表人: 何沛良

联系人: 杨亢

电话: 0769-22866270

传真: 0769-22320896

客服电话: 0769-961122

网址: www.drcbank.com

(12) 泉州银行股份有限公司

注册地址: 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人: 傅子能

联系电话: 0595-22551071

联系人: 董培姗

客服电话: 400-8896-312

公司网站: www.qzccb.com

(13) 武汉农村商业银行股份有限公司

住所: 武汉市江岸区建设大道 618 号

法定代表人: 徐小建

电话: 027-85497270

联系人: 邹君

客服电话: 96555

公司网站: www.whrcbank.com

(14) 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: 钟伟镇

电话: 021-38676798

传真: 021-38670798

客户服务电话: 95521/4008886666

网站: www.gtja.com

(15) 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人: 王常青

电话: 010-85130577

联系人: 权唐

客户服务电话: 400888108

网站: www.csc108.com

(16) 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16-26层

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法人代表人: 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.cn

(17) 招商证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人: 宫少林

电话：0755-82960223

传真：0755-82960141

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

(18) 中信证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

电话：010-60833889

客户服务电话：95548

网站：www.cs.ecitic.com

(19) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-23219991

联系人：程丽辉

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

(20) 申万宏源证券股份有限公司

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45层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33388215

传真：021-33388224

客服电话：95523/4008895523/4008000562

网址：www.swhysc.com

(21) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-38565785

联系人：谢高得

客户服务热线：95562

网站：www.xyzq.com.cn

(22) 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：4008-888-999 或 95579

网址：www.95579.com

(23) 西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

公司网站：www.swsc.com.cn

(24) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区滨水西道8号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

网站：www.ewww.com.cn

(25) 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

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

法定代表人: 杨宝林

联系电话: 0532-85022326

传真: 0532-85022605

联系人: 吴忠超

客户服务电话: 95548

公司网址: www.citicssd.com

(26) 东兴证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人: 徐勇力

联系人: 汤漫川

电话: 010-66555316

传真: 010-66555246

客服电话: 400-8888-993

公司网站: www.dxzq.net.cn

(27) 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: 北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人: 张志刚

联系人: 唐静

联系电话: 010-83252182

传真: 010-63080978

客服电话: 95321

公司网址: www.cindasc.com

(28) 长城证券股份有限公司

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

法定代表人: 黄耀华

联系人: 金夏

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：www.cgws.com

(29) 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

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(30) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

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

法定代表人：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

网站：www.gzs.com.cn

(31) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号世贸中心 A 座 13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务热线：400-7121-212

网址：www.dtsbc.com.cn

(32) 平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-33830395

客户服务电话：4008816168

网站：www.pingan.com

(33) 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

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(34) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

法定代表人：徐丽锋

联系电话：0791-86281305

联系人：周欣玲

客户服务电话：4008222111

网站：www.gszq.com

(35) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼（深圳总部）

法定代表人：张慎修

联系人：张曼

电话：010-52723273

客户服务电话：4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

(36) 申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：李季

联系人：李巍

传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

(37) 中泰证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(38) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：www.cscoco.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

法定代表人：王宜四

联系人：戴蕾

电话：0791-86868681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网站：www.avicsec.com

(40) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

电话：029-87406168

客服热线：95582

网址：www.westsecu.com.cn

(41) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李学东

电话：010-85679888

传真：010-85679535

联系人：秦朗

客服电话：400-910-1166

网站：www.cicc.com.cn

(42) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

客户服务电话：95310

网址: www.gjzq.com.cn

(43) 民族证券有限责任公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人: 赵大建

联系人: 赵明

客户服务热线: 40088-95618

网址: www.e5618.com

(44) 华融证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

法定代表人: 祝献忠

联系人: 李慧灵

联系电话: 010-58315221

传真: 010-58568062

客服电话: 010-58568118

公司网站: www.hrsec.com.cn

(45) 中信期货有限公司

注册地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张磊

联系人: 洪成

电话: 0755-23953913

传真: 0755-83217421

客服电话: 400-990-8826

公司网站: www.citicsf.com

(46) 安信证券股份有限公司

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

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

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人: 牛冠兴

联系人：郑向溢

电话：0755-82558038

传真：0755-82558355

公司网址：www.essence.com.cn

客服热线：4008001001

(47) 华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

传真：021-54967032

联系人：丁晨

客服电话：95323

公司网站：www.cfsc.com.cn

(48) 南京证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

客服电话：95386

公司网站：www.njzq.com.cn

(49) 和讯信息科技有限公司

住所：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：吴阿婷

联系电话：0755-82721106

客服电话：400-9200-022

公司网站：licaike.hexun.com

(50) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

联系人：徐诚

联系电话：021-38509636

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

(51) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(52) 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：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

联系电话：021-54509998

客服电话：400-1818-188

公司网站：www.1234567.com.cn

(53) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

联系人：胡轶隼

联系电话：021-20613635

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(54) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

联系电话：010-62020088

客服电话：400-888-6661

公司网站：www.myfund.com

(55) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：李兴春

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533-3011

客服电话：400-921-7755

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(56) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-876-9988

公司网站：www.zscffund.com

(57) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

联系人：凌秋艳

联系电话：021-52822063-8105

客服电话：4000-466-788

公司网站：www.66zichan.com

(58) 上海中正达广投资管理有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 3 楼

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

联系电话：021-33768132

客服电话：4006767523

网址：www.zzwealth.cn

(59) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

联系人：凌秋艳

联系电话：021-52822063-8105

客服电话：4000-466-788

公司网站：www.66zichan.com

(60) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：13818306630

客服电话：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

(61) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：张彦

联系人：文雯

电话：010-83363101

客服电话：400-166-1188

公司网站：8.jrj.com.cn

(62) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号

法定代表人：肖雯

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

(63) 深圳金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

电话：0755-66892301

传真：0755-66892399

客服电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

(64) 上海陆金所资产管理有限公司

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

客户服务热线：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

(65) 上海挖财金融信息服务有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

电话：15002933896

客服电话：021-50810687

网址：www.wacaijijin.com

(66) 江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：江苏省南京市中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座

法定代表人：吴言林

联系人：李跃

电话：176 1215 4686

传真：021-53086809

客服电话：025-56663409

网址： www.huilinbd.com

(67) 上海云湾投资管理有限公司

住所：上海市浦东新区锦康路 308 号世纪金融广场 6 号楼 6 楼

法定代表人：戴新装

联系人：范泽杰

客服电话：400-820-1515

公司网站：www.zhengtongfunds.com

(68) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层

法定代表人：张冠宇

联系人：刘美薇

电话：010-85870662

传真：4008875666-129666

客服电话：400-819-9868

网址：www.tdyhfund.com

(69) 一路财富（北京）信息科技股份有限公司

住所：北京西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

客服电话：400-001-1566

公司网站：www.yilucaifu.com

(70) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

(71) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人：陈刚

联系人：张岩

电话：0571-86655920

传真：0571-85269200

客服电话：0571-86915761

网址：www.cd121.com

(72) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：400-6802-123

网址：www.zhixin-inv.com

(73) 上海有鱼基金销售有限公司

注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室

办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 A 座五层

法定代表人：林琼

联系人：徐海峥

电话：021-64389188

传真：021-64389188-102

客服电话：4007676298

网址：www.youyufund.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）基金注册登记机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：何伟

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍

客户服务电话：400-8868-666

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京市中伦律师事务所

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 36-37 层

负责人：张学兵

电话：0755-33256666

传真：0755-33206888

联系人：李雅婷

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所（办公地址）：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁

电话：0755-25028023

传真：0755-25026023

联系人：昌华

六、基金的募集与基金合同的生效

(一) 基金的募集

本基金经中国证券监督管理委员会 2015 年 9 月 1 日证监许可[2015]2048 号文核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律、法规及基金合同募集，募集期自 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 5 月 25 日，共募集 398,108,405.90 份基金份额，募集户数为 1,997 户。

(二) 基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2017 年 6 月 1 日正式生效。

(三) 基金的类型和运作方式

基金的类型：混合型

基金的运作方式：契约型开放式

(四) 基金存续期限

不定期

(五) 发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

七、基金份额的申购与赎回

(一) 申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

(二) 申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

(三) 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(四) 申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的成立和生效

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即成立。投资人递交赎回申请，赎回申请即成立。

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。基金登记机构确认基金份额时，申购申请即生效。基金登记机构确认赎回时，赎回申请即生效。T 日提交的申请，投资人可在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

3、赎回款项的支付

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往基金份额持有人银行账户。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

(五) 申购和赎回的数额限制

1、本基金管理人规定，本基金单笔最低申购金额为 10 元，投资人通过销售机构申购本基金时，当销售机构设定的最低申购金额高于该申购金额限制时，除需满足基金管理人规定的最低申购金额限制外，还应遵循销售机构的业务规定；

2、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制；

3、本基金单笔赎回份额不得低于 100 份，投资人全额赎回时不受该限制；

4、本基金不对投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额进行限制；

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(六) 申购和赎回的费用

1、本基金的申购费用

本基金在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金份额对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：

(1) 申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100 万元以下	1.5%
100 万元(含)－300 万元	1.0%
300 万元(含)－500 万元	0.5%
500 万元以上(含)	每笔 1000 元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

(2) 特定申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100 万元以下	0.3%
100 万元(含)－300 万元	0.2%
300 万元(含)－500 万元	0.1%
500 万元以上(含)	每笔 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金申购费由申购者承担，不列入基金财产。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、本基金的赎回费用

持续持有期(天)	赎回费率
1－6	1.5%
7－29	0.75%
30－184	0.5%
185－365	0.25%
366 及以上	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时

收取。对持续持有期少于 30 天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 天(含)但少于 92 天的基金份额所收取的赎回费的 75%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 92 天(含)但少于 185 天的基金份额所收取的赎回费的 50%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于 185 天(含)的份额所收取的赎回费的 25%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒介公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

（七）申购份额与赎回金额的计算

1、申购份额的计算

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

（注：对于 500 万元(含)以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额）

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

例：某投资者投资（非养老金客户）100,000 元申购本基金，对应的申购费率为 1.5%，若申购当日基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的基金份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.050 = 93,830.64 \text{ 份}$$

2、赎回金额的计算

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

$$\text{赎回手续费} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回手续费}$$

例：某投资者赎回其持有的本基金 50,000 份，持有期为 85 天，对应的赎回费率为 0.5%，若赎回当日基金份额净值为 1.150 元，则其得到的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总金额} = 50,000 \times 1.150 = 57,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回手续费} = 57,500 \times 0.5\% = 287.50 \text{ 元}$$

净赎回金额=57,500-287.50=57,212.50 元

3、申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、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并扣除相应的费用，赎回金额单位为元，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。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、7项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第5项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除

时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

(十) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的基金份额净值。

（十二）基金的转换

基金转换是指基金份额持有人可按规定申请将所持有的本基金份额转换为本基金管理人管理并在同一注册登记人登记的其它开放式基金份额。

基金管理人已开通本基金与长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金之间的基金转换业务。

（十三）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然

人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

（十四）基金的转托管

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

（十五）定期定额投资计划

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

本基金管理人已通过本基金直销机构以及中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、泉州银行股份有限公司、武汉农村商业银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、信达证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、中泰证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、中信期货有限公司、安信证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海中正达广投资管理有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海万得投资顾问有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、深圳金斧子投资咨询有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、上海挖财金融信息服务有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、上海云湾投资管理有限公司、北京唐鼎耀华投资咨询有限公司、一路财富（北京）信息科技股份有限公司、奕丰金融服务（深圳）有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海有鱼基金销售有限公司为投资者提供定期定额投资服务，详情请查阅相关公告。

(十六) 基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

八、基金的投资管理

(一) 投资目标

本基金重点投资于经济发展过程中具备持续增长潜力，能够代表经济发展方向的行业龙头公司，追求基金资产的长期稳健增值。

(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等）、权证、货币市场工具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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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

(三) 投资策略

1、大类资产配置策略

本基金为灵活配置混合型证券投资基金，将依据市场情况灵活进行基金的大类资产配置。

本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。

2、股票投资策略

(1) 创新动力主题的定义

目前，我国进入经济增长换档期，依靠要素成本优势、大量资源投入和消耗环境的经

济发展方式已经难以为继，只有不断进行创新，才能获得和保持竞争优势，从而实现经济持续稳定健康发展。创新驱动的发展战略将增强科技创新对经济增长的贡献度，创新将成为我国新的增长动力源泉。本基金创新动力主题主要包括新产业、新科技和新的商业模式三个维度。

1) 新产业：本基金的新产业主要是指战略新兴产业，其是代表未来科技和产业发展新方向，体现当今世界知识经济、循环经济、低碳经济发展潮流，对经济社会具有全局带动和重大引领作用的产业。根据《国务院关于加快培育和发展战略性新兴产业的决定》中的规定，当前战略新兴产业包括电子元器件、计算机、传媒、通信、节能环保、生物医药、生物育种、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车等。

2) 新科技：科学技术是第一生产力，本基金将选择深度受益于新科技成果的行业作为重点配置方向，主要包括现代农业、装备制造、生态环保、能源资源、信息网络、新型材料等。

3) 新的商业模式：指在业态发展进程中，以新的经营方式、新的经营技术、新的经营手段取代传统的经营方式和技术手段。新的商业模式的应用和推广，主要包括电子商务、现代物流、医疗卫生、信息服务业等。

(2) 个股投资策略

本基金将依据创新动力投资主题的定义确定备选股票池，并依据定性分析和定量分析相结合的方法，进行综合评估筛选，构建本基金的各级股票池。

1) 定性分析

本基金通过传统的定性分析手段，关注上市公司的主营业务可持续发展能力、竞争优势、管理能力三个方面：

主营业务可持续发展能力：主要考察上市公司在细分行业中所处的竞争地位、产品定价能力，是否具有相对成本优势、从事主营业务的历史，以及主营业务在市场不同经济周期中的发展状况。

竞争优势：主要考察上市公司在商业模式、科技创新能力、品牌、经营效率等方面是否具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的相对优势。

管理能力：主要考察上市公司经营独立性、管理层对股东的责任感、管理层长效约束与激励机制的建立、管理层长远眼光和战略能力，以及能够对外部环境变化迅速作出反应。

2) 定量分析

在定量分析中，本基金将结合 PE、PB、PS、PEG 等相对估值指标以及自由现金流贴现

等绝对估值方法来考察企业的估值水平，以判断当前股价高估或低估。创新动力投资主题的股票因其高成长性一般估值较高，因此，本基金在关注估值指标的同时，还会关注营业收入增长率、盈利增长率、现金流量增长率、及净资产收益率等指标，来评估企业的成长性。在考察其科技创新能力可持续性方面，将重点关注研发费用与营业收入的占比，及获得财政补贴的情况。而在业务结构分布上，通过其收入的地区占比及业务占比，并结合对于不同地区不同业务的发展空间研判，来综合评估。

本基金将通过对行业估值指标的横向、纵向分析，并结合成长性的行业比较，并结合其他量化指标，综合选择估值与成长位于合理区间的创新动力投资主题的企业进行投资，动态构建资产组合。

同时，本基金在进行股票资产配置时，将考察企业的流动性和换手率指标，参考基金的流动性需求，以降低股票资产的流动性风险。

3、债券投资策略

当股票市场投资风险和不确定性增大时，本基金将择机把部分资产转换为债券资产，或通过参与一级债券市场交易获取低风险收益，以此降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础，在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整，并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。

4、中小企业私募债券投资策略

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金投资于单只中小企业私募债的比例不得超过本基金资产净值的 10%。未来法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。

在中小企业私募债选择时，本基金将采用公司内部债券信用评级系统对信用评级进行持续跟踪，防范信用风险。在此基础上，本基金重点关注中小企业私募债的发行要素、担保机构等发行信息对债项进行增信。

本基金将根据相关法律法规要求披露中小企业私募债的投资情况。

5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资

组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

6、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、标的资产的构成、质量及提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

(四) 投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

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

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

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

(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(15) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；

(16) 法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

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

资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

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

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

(五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

本基金是灵活配置混合型基金,主要投资于创新动力主题相关上市公司。中证 800 指数收益率对创新动力主题相关上市公司具有较强的代表性,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。本基金固定收益部分的业绩比较基准采用了中债综合财富指数。该指数由中央国债登记结算有限责任公司编制和维护,综合反映了债券市场整体价格和回报情况,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。

本基金是灵活配置混合型证券投资基金,股票投资范围为 0-95%。本基金对中证 800 指数收益率和中债综合财富指数分别赋予 50%和 50%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时, 经与基金托管人协商一致, 本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。本基金由于上述原因变更业绩比较基准, 不需召开基金持有人大会通过。

(六) 风险收益特征

本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金, 高于债券型基金、货币市场基金, 属于中等风险、中等收益的基金产品。

(七) 投资决策依据及程序

1、决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的规定;
- (2) 《长城基金管理有限公司章程》的有关规定;
- (3) 《长城基金管理有限公司投资管理制度》的有关规定;
- (4) 宏观经济环境、国家政策和市场周期分析;
- (5) 上市公司财务品质和管理能力, 以及对公司盈利增长能力的预测。

2、投资决策程序

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

(2) 研究部负责建立和维护公司各级股票库, 并提供重点股票的投资价值分析报告; 在公司各级股票库的基础上, 基金经理负责建立符合本基金合同规定和投资需求的股票投资备选库;

(3) 固定收益部负责建立和维护公司固定收益投资对象库, 提供各券种的基本面情况及投资要点分析;

(4) 在对经济形势和市场运作态势进行讨论分析后, 基金经理拟定下一阶段股票、债券及短期金融工具的投资比例, 做出资产配置提案和重点证券投资方案, 报投资决策委员会讨论;

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

(6) 根据投资决策委员会确定的资产配置决议和重点证券投资决定, 基金经理负责在股票投资备选库和固定收益投资对象库中选择拟投资的个券制定投资组合方案;

(7) 在基金经理权限内的投资, 由基金经理自主实施; 超过基金经理权限的, 须经投资决策委员会执行委员或投资决策委员会批准后方可实施;

(8) 金融工程小组负责开发基金投资组合的分析评价体系及其他辅助分析统计工具, 对本基金投资组合进行定期跟踪分析, 为基金经理和投资决策委员会提供决策支持。

(八) 基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

- 1、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。
- 2、有利于基金资产的安全与增值。
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

(九) 基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十) 投资组合报告

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

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年12月22日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2017年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	56,053,330.83	84.61
	其中：股票	56,053,330.83	84.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,181,027.44	15.37
8	其他资产	13,043.41	0.02
9	合计	66,247,401.68	100.00

2、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,372,416.59	58.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,141,651.24	7.85
F	批发和零售业	5,189,210.00	7.92
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,383,560.00	3.64
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,966,493.00	7.58
S	综合	-	-
	合计	56,053,330.83	85.55

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002640	跨境通	223,000	5,189,210.00	7.92
2	002310	东方园林	244,724	5,141,651.24	7.85
3	600703	三安光电	219,291	5,074,393.74	7.74
4	000858	五粮液	87,749	5,026,262.72	7.67
5	600519	贵州茅台	9,600	4,969,344.00	7.58
6	002343	慈文传媒	128,300	4,966,493.00	7.58
7	000568	泸州老窖	88,432	4,961,035.20	7.57
8	002217	合力泰	387,699	4,361,613.75	6.66
9	603589	口子窖	53,400	2,610,192.00	3.98
10	002712	思美传媒	108,000	2,383,560.00	3.64

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资，期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1

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

11.2

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	10,993.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,049.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,043.41

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

(截至2017年9月30日)

时间段	净值增长率①	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
基金合同生效日 (2017年6月1日)至 2017年9月30日	7.70%	0.37%	6.38%	0.31%	1.32%	0.06%

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

十、基金的财产

(一) 基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(三) 基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四) 基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十一、基金资产的估值

(一) 估值日

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

(二) 估值对象

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

(三) 估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的权益类品种(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

(2) 交易所上市的固定收益类品种,可以采用由第三方估值机构提供的价格数据进行估值,第三方估值机构根据以下原则确定公允价值:对于存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则应采用估值技术确定其公允价值。

(3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5、中小企业私募债采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的

情况下，按成本估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

（五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

(1)估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未

及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人

负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和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，由基金管理人对外公布。

(八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，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减轻或消除由此造成的影响。

十二、基金的收益分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、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6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式为现金分红；基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

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

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

十三、基金的费用与税收

一、与基金运作有关的费用

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(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的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财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0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

上述“一、基金费用的种类中第3-9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。

二、与基金销售有关的费用

(一) 申购费用

本基金在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：

1、申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)－300万元	1.0%
300万元(含)－500万元	0.5%
500万元以上(含)	每笔1000元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

2、特定申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100 万元以下	0.3%
100 万元(含)－300 万元	0.2%
300 万元(含)－500 万元	0.1%
500 万元以上(含)	每笔 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。

如未来出现经养老金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)，对于500万元（含）以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份数 = 净申购金额 / T日基金份额净值

例：某投资者投资100,000元申购本基金，对应的申购费率为1.5%，若申购当日基金份额净值为1.050元，则其可得到的基金份额计算如下：

净申购金额 = 100,000 / (1 + 1.5%) = 98,522.17元

申购费用 = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83元

申购份额 = 98,522.17 / 1.050 = 93,830.64份

(二) 赎回费用

本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减，费率如下：

持续持有期（天）	赎回费率
1—6	1.5%
7—29	0.75%
30—184	0.5%
185—365	0.25%
366 及以上	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30天(含)但少于92天的基金份额所收取的赎回费的75%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于92天(含)但少于185天的基金份额所收取的赎回费的50%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于185天(含)的份额所收取的赎回费的25%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回手续费。其中，

赎回总金额=赎回份数×赎回当日基金份额净值

赎回手续费=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额－赎回手续费

例：某投资者赎回其持有的本基金 50,000 份，持有期为 85 天，对应的赎回费率为 0.5%，若赎回当日基金份额净值为 1.150 元，则其得到的赎回金额计算如下：

赎回总金额=50,000×1.150=57,500 元

赎回手续费=57,500×0.5%=287.50 元

净赎回金额=57,500－287.50=57,212.50元

（三）转换费用

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

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

（1）如转入基金的申购费率>转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额=转出金额－转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率－转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差

转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差

例：某投资者持有长城货币市场证券投资基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为本基金，假设转换当日转入基金（本基金）份额净值是1.250元，转出基金（长城货币市场证券投资基金）对应赎回费率为0，申购补差费率为1.5%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1=100,000 元

转出基金赎回费=0

转入总金额=100,000-0=100,000元

转入基金申购费补差=100,000-100,000/(1+1.5%)=1,477.83元

转入净金额=100,000-1,477.83=98,522.17元

转入份额=98,522.17/1.25=78,817.73份

基金转换费=0+1,477.83=1,477.83元

(2) 如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

基金转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

例：某投资者持有本基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为长城货币市场证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金）份额净值是1.250元，转出基金对应赎回费率为0.5%，申购补差费率为0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.25=125,000元

转出基金赎回费=125,000×0.5%=625元

转入总金额=125,000-625=124,375元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=124,375-0=124,375元

转入份额=124,375/1=124,375份

基金转换费=125,000×0.5%=625元

2、对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金)，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为0。

3、转出基金赎回费的25%计入转出基金资产(基金合同或招募说明书另有规定的除外)。

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

(四) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日在至少一种指定媒体公告。

(五) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、基金的会计与审计

(一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月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) 基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、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。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

十五、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

(二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人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中国证监会指定的媒介披露，并保证基金投资者能够按照《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。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

(五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

(1) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每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媒介上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；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网站上。

2、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媒介上。

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、基金资产净值、基金份额净值

《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。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度

报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒介上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒介上。

《基金合同》生效不足 2 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。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，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。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险。

7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的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) 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百分之五十；
- (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百分之三十；
- (11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (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百分之零点五;
- (18)基金改聘会计师事务所;
- (19)变更基金销售机构;
- (20)更换基金登记机构;
- (21)本基金开始办理申购、赎回;
- (22)本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- (23)本基金发生巨额赎回并延期支付;
- (24)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- (25)本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- (26)中国证监会规定的其他事项。

8、中小企业私募债投资

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险,说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内,基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息,并在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

9、资产支持证券投资

基金管理人应在基金年报及半年报中披露基金所持有的资产支证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露基金所持有的资产支证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序前10名资产支持证券明细。

10、澄清公告

在《基金合同》存续期限内,任何公共媒介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。

11、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报国务院证券监督管理机构备案,并予以公告。

12、中国证监会规定的其他信息。

(六)信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 15 年。

（七）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、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

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，以供公众查阅、复制。

十六、风险揭示

本基金为灵活配置混合型证券投资基金，其面临的投资风险主要包括以下几个：

（一）市场风险

广义的市场风险指与利率、股票价格、商品价格等相关的风险，主要与不同市场的供需情况紧密联系。狭义的市场风险主要指股票价格波动风险。

（二）信用风险

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

- 1、债券发行人出现违约，无法支付到期本息引起的损失；
- 2、交易对手出现违约或违规投资操作而引起的损失。

（三）流动性风险

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

1、大额赎回：本基金属于开放式混合型基金，在交易过程中，有发生集中大额赎回的可能性。集中大额赎回可能导致基金资产变现难度加剧，从而产生流动性风险；甚至可能由于大额出售个券引致个券价格出现大幅波动，从而对基金资产净值产生影响。

2、特殊的市场情形：在特殊市场情形下，如市场资金紧张时，市场整体流动性降低，将可能导致个券的变现能力减弱，从而产生流动性风险。

（四）操作风险

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

（五）模型风险

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

（六）法律/合同风险

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

(七) 通货膨胀风险

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

(八) 不可抗力风险

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

十七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续后生效，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

(二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

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

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估值和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6)将清算报告报中国证监会备案并公告。
- (7)对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

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

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

十八、基金合同的内容摘要

(一) 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

- (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产或利用职务之便为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 不得侵占、挪用基金财产；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (10) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (11) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (12) 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；
- (13) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，不得利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (14) 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；
- (15) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (16) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
- (18) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

- (19) 组织并参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
 - (20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;
 - (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合法权益时, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
 - (22) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务, 基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
 - (23) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时, 应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
 - (24) 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;
 - (25) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件, 《基金合同》不能生效, 基金管理人承担全部募集费用, 将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
 - (26) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
 - (27) 建立并保存基金份额持有人名册;
 - (28) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
- 3、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的权利包括但不限于:
- (1) 自《基金合同》生效之日起, 依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
 - (2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
 - (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为, 对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;
 - (4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。
 - (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;
 - (6) 在基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;
 - (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 4、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的义务包括但不限于:
- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
 - (2) 设立专门的基金托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;
 - (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 确保基金财

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

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产或者利用职务之便为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;

(5) 不得侵占、挪用基金财产;

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(7) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户, 按照《基金合同》的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;

(8) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前予以保密, 不得向他人泄露, 不得利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;

(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、季度、半年度和年度基金报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行; 如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

(12) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

(13) 建立并保存基金份额持有人名册;

(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) 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份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(17) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(18) 参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会和银行监管机构, 并通知基金管理人;

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

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

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(23) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

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

于:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法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或者召集基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》;
- (2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;
- (3) 关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
- (5) 在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成,基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

1、召开事由

- (1) 当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:
 - 1) 决定修改基金合同的重要内容或者提前终止《基金合同》,但《基金合同》另有约定的除外;
 - 2) 更换基金管理人;
 - 3) 更换基金托管人;

- 4) 转换基金运作方式;
- 5) 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标准或费率的除外;
- 6) 变更基金类别;
- 7) 本基金与其他基金的合并;
- 8) 变更基金投资目标、范围或策略(法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外);
- 9) 变更基金份额持有人大会程序;
- 10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- 11) 单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算, 下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- 12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- 1) 调低基金管理费、基金托管费;
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率;
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
- 6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集;

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时, 由基金托管人召集;

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

(4) 代表基金份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起

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

（5）代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

基金转换运作方式或者与其他基金合并的，基金管理人应于会议召开前30日发布提示性通知，除载明前述内容外，还应明确有关实施安排，说明对现有基金份额持有人的影响以及基金份额持有人享有的选择权，并在实施前预留至少20个开放日或者交易日供基金份额持有人做出选择。

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

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

意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的1/2（含1/2）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表1/3以上（含1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的1/2（含1/2）；

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表1/3以上（含1/3）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

4) 上述第3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的

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

5)会议通知公布前报中国证监会备案。

(3)在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(2) 议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第7条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后5个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决,在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1)一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%

以上(含50%)通过方为有效;除下列第(2)项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(2) 特别决议,特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上(含2/3)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并,以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

(1) 现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力。

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

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

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

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

8、生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决定的事项应当自表决通过之日起5日内报中国证监会备案，并予以公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(三) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

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

(2) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决定的事项应依法报中国证监会备案并在指定媒介公告。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- (3) 《基金合同》约定的其他情形；
- (4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

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

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；

- 4) 制作清算报告;
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- 7) 对基金财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

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

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(四) 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意, 因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会按其届时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力, 仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间, 基金合同当事人应恪守各自的职责, 继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务, 维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

十九、基金托管协议的内容摘要

(一) 托管协议当事人

1. 基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：何伟

成立时间：2001 年 12 月 27 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

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

存续期间：持续经营

2. 基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：易会满

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银

证转账); 保险代理业务; 代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务; 保管箱服务; 发行金融债券; 买卖政府债券、金融债券; 证券投资基金、企业年金托管业务; 企业年金受托管理服务; 年金账户管理服务; 开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务; 资信调查、咨询、见证业务; 贷款承诺; 企业、个人财务顾问服务; 组织或参加银团贷款; 外汇存款; 外汇贷款; 外币兑换; 出口托收及进口代收; 外汇票据承兑和贴现; 外汇借款; 外汇担保; 发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券; 自营、代客外汇买卖; 外汇金融衍生业务; 银行卡业务; 电话银行、网上银行、手机银行业务; 办理结汇、售汇业务; 经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

(二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

(1) 基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定, 对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等)、权证、货币市场工具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(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

(2) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述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: 本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%, 其中, 投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%; 本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的, 基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合, 以符合上述比例限定。法律法规另有规定时, 从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围, 并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

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

a、本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%, 其中, 投资于创新动力主

题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;

b、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

c、本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;

d、本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;

e、本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

f、本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

g、本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

h、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;

i、本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

j、本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

k、本基金管理人管理且由基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

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

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

n、本基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

o、本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过该基金资产净值的 10%;

《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) 法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例,不在限制之内,但基金管理人应在 10 个工作日内进行调整,以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下,至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施,便于托管人实施交易监督。

4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

(3) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

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行为:

- 1) 承销证券;
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- 3) 从事承担无限责任的投资;
- 4) 买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;
- 5) 向其基金管理人、基金托管人出资;

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1) 基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单,并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新,名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人,基金托管人于 2 个工作日内回函确认收到后,对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后,被确认调整的名单开始生效,新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,托管人有权报告中国证监会。

2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式,经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任。

3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,基金管理人在通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险,在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时,由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担,其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核交易对手是否在名单内列明。

(5) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行,本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时,先由基金管理人负责赔偿,之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后,可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单,审核核心存款银行是否在名单内列明。

(6) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

1) 基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料

应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

2、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监督和核查。

3、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反相关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须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。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管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托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

（三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，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。

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、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人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确认并以书面形式向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，并予协助配合。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。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基

金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，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，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

2、募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的 XX 基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

3、基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金

托管人的资产托管专户进行。

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

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

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

5、债券托管账户的开设和管理

(1)《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2)基金管理人、基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

7、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

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

（五）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

2、基金资产估值方法

（1）估值对象

基金所拥有的股票、股指期货、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等

资产及负债。

(2) 估值方法

1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的权益类品种(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

②交易所上市的固定收益类品种,可以采用由第三方估值机构提供的价格数据进行估值,第三方估值机构根据以下原则确定公允价值:对于存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则应采用估值技术确定其公允价值。

③交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

①送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

②首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

③首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4) 因持有股票而享有的配股权,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

6) 本基金投资股指期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,

且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7) 中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

8) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

3、估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，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。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失

由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

4、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。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。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

5、基金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。

在《基金合同》生效后每六个月结束之日起 45 日内，基金管理人对招募说明书更新一次并登载在网站上，并将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后 60 日内完成半年报告编制并公告；在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在 7 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 30 日内完成半年度报告，在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人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证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、半年报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第2个工作日，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。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

（七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用、律师费由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

（八）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

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

2、基金托管协议终止出现的情形

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

3、基金财产的清算

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

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

（4）基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算结果报中国证监会备案并公告；
- 7) 对基金财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限

管理人应尽快办理财产清算及支付,基金财产清算小组根据基金财产的情况确定清算期限;

合同终止后,资产管理计划仍持有可流通非现金资产的,在5个交易日内(含合同终止日当日)由资产管理人进行强制变现处理;资产管理计划持有的流通受限证券,如未到期回购、未上市新股等,自限制条件解除日起(含解除当日)3个交易日内完成变现。未变现资产于清算期间损益由全体资产委托人享有或承担。

(6) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(7) 基金财产清算剩余资产的分配:

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(8) 基金财产清算的公告

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

(9) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

二十、对基金份额持有人的服务

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

(一) 账单服务

1、基金份额持有人可登录本基金管理人网站账户查询系统查阅对账单。

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

(二) 客户服务中心(Call Center) 电话服务

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

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

公司网站: www.ccfund.com.cn

客服邮箱: support@ccfund.com.cn

客服电话: 400-8868-666

二十一、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报及本基金管理人网站	2017/06/02
2	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(新疆众和)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/06/02
3	增聘长城创新动力基金经理的公告(郑帮强)	中国证券报及本基金管理人网站	2017/06/09
4	长城基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告(含定投-放开折扣限制)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/06/16
5	长城创新动力灵活配置混合型基金开放日常申购、赎回、转换、定投业务的公告	中国证券报及本基金管理人网站	2017/06/28
6	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/03
7	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的网上银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/03
8	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(山鼎设计)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/06
9	长城基金关于增加上海挖财金融为旗下开放式基金代销机构并开通定投及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/20
10	关于增加华鑫证券为长城旗下开放式基金代销机构并开通转换、定投业务及同时实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/21
11	关于增加上海陆金所资管为长城创新动力、长城久嘉代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017/07/21
12	长城基金管理有限公司关于参加华西证券费率优惠活动的公告(含定投-放开折扣限制)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/21
13	长城基金关于增加江苏汇林保大为旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/25
14	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(招商轮船)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/07/25
15	长城基金管理有限公司关于参加华泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/08/01
16	关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/08/01
17	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(沙钢股份)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/08/04
18	长城基金关于江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下开放式基金开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/08/14

19	关于增加云湾投资为长城旗下开放式基金代销机构并开通转换、定投业务及实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/08/16
20	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(科恒股份、神雾环保)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/09/05
21	长城基金关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/09/15
22	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(中金环境)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/09/19
23	长城基金管理有限公司关于参加长江证券股份有限公司费率优惠活动的公告(不含认购、含定投-放开折扣限制)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/09/29
24	关于增加一路财富为长城旗下开放式基金代销机构并开通转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/10/16
25	长城基金关于参加一路财富(北京)信息科技股份有限公司费率优惠活动的公告(不含认购、含定投-放开折扣限制)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/10/16
26	长城基金关于增加奕丰金融服务(深圳)有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/10/17
27	关于增加南京证券为长城旗下开放式基金代销机构并开通转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/10/18
28	长城基金管理有限公司关于参加南京证券股份有限公司费率优惠活动的公告(不含认购、含定投-放开折扣限制)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/10/18
29	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(中环股份)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/11/07
30	长城基金关于增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/11/08
31	长城基金关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/11/10
32	长城基金管理有限公司关于参加广发银行费率优惠活动的公告(不含认购、含定投-放开折扣限制)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/11/15
33	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(中国铝业)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/11/18
34	长城基金关于增加上海有鱼基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/11/22
35	2017年11月23日长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017/11/23

	(万达电影)		
36	在本报告期内刊登的其他公告		

二十二、招募说明书的存放及查阅方式

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

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

二十三、备查文件

- (一) 中国证监会准予长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

长城基金管理有限公司

2018年1月13日