

长盛纯债债券型证券投资基金 基金合同

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一八年三月

目录

目录.....	1
一、前言.....	2
二、释义.....	4
三、基金的基本情况.....	8
四、基金份额的发售与认购.....	9
五、基金的备案.....	10
六、基金份额的申购、赎回与转换.....	11
七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押、定期定额投资计划.....	18
八、基金合同当事人及其权利义务.....	19
九、基金份额持有人大会.....	25
十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	31
十一、基金的托管.....	33
十二、基金的销售.....	34
十三、基金份额的注册登记.....	34
十四、基金的投资.....	35
十五、基金的融资、融券.....	41
十六、基金的财产.....	41
十七、基金资产的估值.....	42
十八、基金费用与税收.....	46
十九、基金收益与分配.....	48
二十、基金的会计与审计.....	50
二十一、基金的信息披露.....	50
二十二、基金的业务规则.....	54
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	54
二十四、违约责任.....	57
二十五、争议的处理.....	57
二十六、基金合同的效力.....	58
二十七、基金合同内容摘要.....	58

一、前言

(一) 订立《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范长盛纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的运作,保护基金份额持有人的合法权益。

2、订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性规定》”)及其他法律法规的有关规定。

3、订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

(二) 本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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,但由于证券投资具有一定的风险,因此不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

(三) 本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依本基金合同取得本基金基金份额,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本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

(四) 本基金合同应当适用《基金法》及相应法律法规之规定,若因法律法规的修改或

更新导致本基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定有冲突,应当以届时有效的法律法规的规定为准,及时作出相应的变更和调整,同时就该等变更或调整进行公告。

二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指长盛纯债债券型证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的有效修订和补充；
招募说明书：	指《长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
基金份额发售公告：	指《长盛纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告》；
托管协议：	指《长盛纯债债券型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《销售办法》：	指 2011 年 6 月 9 日由中国证监会公布并于 2011 年 10 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布并于 2004 年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
《流动性规定》：	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指长盛基金管理有限公司；

基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
基金份额持有人：	根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等；
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为长盛基金管理有限公司或接受长盛基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合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；
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；
基金合同生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；

工作日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;
认购:	指在基金募集期内,投资者按照本基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为;
发售:	在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为;
申购:	指在本基金合同生效后的存续期间,投资者按照基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为;
赎回:	指在本基金合同生效后的存续期间,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为;
基金转换:	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件,申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为;
转托管:	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为;
销售服务费:	指从基金资产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用;
基金份额类别:	指根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别代码不同,基金份额净值和基金份额累计净值或有不同;
A 类基金份额:	指在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额;
C 类基金份额:	指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额;
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、申购金额及扣款方式,由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式;

指令:	指基金管理人在运用基金财产进行投资时,向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令;
代销机构:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托,代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构;
销售机构:	指基金管理人及本基金代销机构;
基金销售网点:	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点;
指定媒体:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体;
基金账户:	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户;
交易账户:	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户;
开放日:	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日;
T 日:	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日;
T+n 日:	指 T 日后(不包括 T 日)第 n 个工作日, n 指自然数;
基金收益:	指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入;
基金资产总值:	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和;
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值;
基金份额净值:	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值;
基金资产估值:	指计算、评估基金财产和负债的价值,以确定基金资产净值

和基金份额净值的过程；

流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；

法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；

不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的客观事件。

三、基金的基本情况

（一）基金名称

长盛纯债债券型证券投资基金

（二）基金的类别

债券型

（三）基金的运作方式

契约型、开放式

（四）基金投资目标

在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

（五）基金份额初始面值

本基金的初始面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售。

（六）基金最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币。

（七）基金存续期限

不定期

（八）基金份额类别设置

本基金根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算日某类别基金份额净值=该计算日该类别基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

基金管理人可以与基金托管人协商一致并在履行相关程序后，调整认（申）购各类基金份额的最低金额限制及规则，基金管理人必须在开始调整之日前依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

四、基金份额的发售与认购

（一）发售时间

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。

（二）发售方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点（包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点）向投资者公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的增减销售机构的相关公告。

（三）发售对象

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者（有关法律法规规定禁止购买者除外）和合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

（四）基金认购费用

本基金基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。A 类基金份额在认购时收取认购费，C 类基金份额在认购时不收取认购费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金 A 类基金份额以认购金额为基数采用比例费率计算认购费用（适用于固定认购费用的情形除外），认购费不得超过认购金额的 5%。

本基金的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

（五）认购份额的计算方法

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（六）募集期间认购资金利息的处理方式

本基金的有效认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后将折算为基金份额，归基金份额持有人所有。利息转份额，以注册登记机构的记录为准。

（七）基金认购的具体规定

投资者认购原则、认购限额、认购份额的计算公式、认购时间安排、投资者认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在招募说明书和基金份额发售公告中披露。

认购申请一经受理不得撤销。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

（八）基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集结束前任何人不得动用。

五、基金的备案

（一）基金备案的条件

本基金募集期限届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定停止基金发售，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

（二）基金的备案

基金募集结束，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

（三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效；
- 2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。
- 3、基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（四）基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案的条件的，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

六、基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由

基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以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的申购与赎回。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为本基金合同生效后基金管理人公告开始办理申购或赎回之日，具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

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并公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，视为下一个开放日的申请，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

5、基金管理人在法律法规或中国证监会允许的、不损害基金份额持有人权益的情况下

可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应自身或要求注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

基金销售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申购、赎回申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到该申购、赎回申请。申购、赎回的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

3、申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。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，则赎回款项划付时间相应顺延。

（五）申购与赎回的数额限制

1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。

2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

3、基金管理人可在法律法规或中国证监会允许的情况下，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上

公告。

（六）申购份额与赎回金额的计算方式

本基金将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额两种，A 类基金份额收取申购费，并对持有期限少于两年的本类别基金份额的赎回收取赎回费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取申购费用，并对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。

1、 申购份额的计算方式：

申购份额的计算方式详见招募说明书。各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2、 基金赎回金额的计算方式：

赎回金额的计算方式详见招募说明书。各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

3、 本基金基金份额净值的计算

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

（七）申购和赎回的费用及其用途

本基金 A 类基金份额收取申购费，C 类基金份额不收取申购费，即本节中申购费用仅适用于 A 类基金份额。

1、 本基金申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。

2、 除适用固定金额申购费的申购外，本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。实际执行的申购费率在招募说明书中载明。投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

3、 本基金的赎回费率按照持有时间划分，A 类基金份额对持有期限少于两年的基金份额的赎回收取赎回费，对于持有期限大于两年（含两年）的基金份额的赎回不收取赎回费；C 类基金份额对持有期限少于 30 日的基金份额的赎回收取赎回费，对于持有期限大于 30 日（含 30 日）的基金份额的赎回不收取赎回费。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。

4、 本基金 A 类基金份额的申购费用由申购 A 类基金份额的投资人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

5、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，基金管理人应在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资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必要手续后，基金管理人可以适当调低申购费率和赎回费率。

（八）申购与赎回的注册登记

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

2、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接

受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。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) 若本基金发生巨额赎回的，且存在单个基金份额持有人单日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分进行自动延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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，并与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权且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；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作延期赎回处理。

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

(5) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上公告。

(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(4) 基金财产规模过大，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的利益的情形；

(5) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时；

- (6) 基金管理人、基金托管人、销售机构或注册登记机构的技术故障等异常情况导致

基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；

(7) 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；

(8) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；

(9) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)、(2)、(3)、(4)、(6)、(8)、(9)项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将在七日内退还给投资人。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

(2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 基金连续 2 个或 2 个以上开放日发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(5) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金赎回申请的措施；

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。除非发生巨额赎回，已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。如暂时不能足额支付，应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，并在后续开放日予以支付。若出现上述第(3)项所述情形，按基金合同的相关条款处理。

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依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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

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

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

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

(十一) 基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押、定期定额投资计划

(一) 基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”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”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性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、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

(二) 符合条件的非交易过户申请自申请按注册登记机构的规定办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(三) 基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续，基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

(四) 基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

(五) 如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金注册登记机构将制定和实施相应的业务规则。

(六) 基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

八、基金合同当事人及其权利义务

(一) 基金管理人

1、基金管理人基本情况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

法定代表人：凤良志

成立日期：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】6 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币壹亿伍仟万元整

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

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) 依法募集基金；
- (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) 召集基金份额持有人大会；

(6) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，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注册登记机构办理基金注册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的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，在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高管理费、托管费和销售服务费之外的基金费率结构和收费方式；
- (17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

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、赎回和注册登记手续；
- (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。

(二) 基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

成立日期：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

2、基金托管人的权利

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) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，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；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；

- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定,召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- (16) 按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作;
- (17) 参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;
- (19) 因违反基金合同导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿;
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、基金份额持有人的权利

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；
- (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) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务

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议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

九、基金份额持有人大会

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，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。

(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、本基金与其他基金合并；
- 9、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

10、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；

11、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

12、法律法规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。

(三) 有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用；
- 2、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、调低赎回费率或变更收费方式，调整基金份额类别的设置；
- 3、在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；
- 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、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 6、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；

7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四) 召集方式:

1、除法律法规或基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集。

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

3、代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额 10%以上(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。

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, 而基金管理人、基金托管人都不召集的, 代表基金份额 10%以上(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。

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

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(五) 通知

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

1、会议召开的时间、地点、方式;

2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式;

3、代理投票授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份, 代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

4、会务常设联系人姓名及联系电话;

5、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；

6、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会等方式。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按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代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

（4）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前已报中国证监会备案。

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。

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后

2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

(八) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 特别决议

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

(2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

(九) 计票

1、现场开会

(1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对所投票数进行重新清点；如

果大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

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

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式可采取如下方式:

由大会召集人授权的两名监票员在监督员派出的授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证;如监督员经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权3名监票员进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

(十) 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

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

4、如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(十一) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

(一) 基金管理人和基金托管人的更换条件

1、有下列情形之一的,基金管理人职责终止,须更换基金管理人:

- (1) 基金管理人被依法取消基金管理资格;
- (2) 基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产;

(3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任;

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

(1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；

(2) 基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；

(3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过。

(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上公告。

(4) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人或临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值。

(5) 审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(6) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

2、基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会需在六个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后 6 个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过。

(3) 核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上公告。

(4) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值。

(5) 审计并公告：基金托管人职责终止的，基金管理人应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

3、基金管理人与基金托管人同时更换

(1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

(2) 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；

(3) 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后 2 日内在指定媒体上联合公告。

4、新基金管理人接受基金管理或新基金托管人接受基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或基金托管人应依据法律法规和基金合同的规定继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。

十一、基金的托管

本基金财产由基金托管人依法保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《长盛纯债债券型证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十二、基金的销售

(一) 本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资计划和客户服务等业务。

(二) 本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。

十三、基金份额的注册登记

(一) 本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户等。

(二) 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

(三) 注册登记机构履行如下职责：

- 1、建立和保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 2、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 4、接受基金管理人的监督；
- 5、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 6、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但按照法律法规的规定进行披露的情形除外；

7、按本基金合同及招募说明书的规定，为投资者办理非交易过户、转托管等业务、提供基金收益分配等其他必要的服务；

8、在法律、法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上公告；

9、法律法规规定的其他职责。

十四、基金的投资

（一）投资目标

在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

（二）投资范围

本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、次级债、中期票据（MTN）、短期融资券（CP）、超短期融资券（SCP）、资产支持证券（ABS）、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

（三）投资理念

本基金通过对宏观经济形势、货币政策意图、证券市场政策导向、投资人行为、公司基本面和偿债能力等因素进行深入研究和分析，执行自上而下的债券资产期限配置与自下而上不同市场、期限品种选择相结合的组合动态构建过程。在有效控制风险和保持资产流动性的前提下，力求获取较高的超额收益。

（四）投资策略

A. 大类资产配置策略

本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。

B. 债券组合管理策略

1、利率策略

利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略，例如：子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

2、类属配置策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

3、信用策略

信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上，结合信用品种的发行条款，建立信用债备选库，并以此为基础拟定信用品种的投资方法。

（1）宏观环境和行业分析

主要关注宏观经济状况和经济增长速度、宏观经济政策及法律制度对企业信用级别的影响；行业分析主要关注企业所处的行业类型（成长型、周期型、防御型）、产业链结构及行

业在产业链中的位置、行业的竞争程度和行业政策对企业信用级别的影响。

（2）发债主体基本面分析

主要包括定性分析和定量分析两个方面：

定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、企业财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位置、产品竞争力和核心优势的分析，以及企业的股东背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方的重要程度等企业的外部支持分析。

定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力分析以及偿债能力分析四部分，定量分析的重点是选取适当的财务指标并挖掘其中蕴含的深层含义及互动关系，定量地实现企业信用水平的区分和预测。

（3）内部信用评级定量分析体系。

经过广泛的调研，基于我国目前实际情况，考虑到国内外评级、以及专业的发行评级与投资评级的差异，从投资角度建立内部的公司债评级体系，其分析过程包括以下几个部分：

1) 行业内财务数据指标筛选。基于可比原则，采用因子分析对行业内各公司多个具有信息冗余的财务数据指标（相关性较高）进行筛选，选择能够反映公司总体财务信息的财务数据指标。

2) 行业内公司综合评价。基于可比原则，利用筛选指标对行业内公司进行整体的综合评级，得到反映公司行业内所处相对位置的信用分数。

3) 行业内信用等级的切分。根据信用分数的统计分布进行类别划分。

4) 系统校验与跟踪分析。根据财务数据指标等信息的变化适时对信用等级进行调整，并建立与信用利差相应的跟踪。

5) 信用利差分析与定价。基于实际研究，通过寻找信用利差异所带来的定价偏差，获取与承担风险相适宜的收益。

4、相对价值策略

本基金认为市场存在着失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在于这些不同因素之间的相对价值，也是本基金发现投资机会的重要方面。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动，通过深入分析市场参与者的立场和观点，充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者税收待遇等因素导致的市场失衡机会，形成相对价值投资策略，为本基金的投资带来增加

价值。

5、债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值,选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

6、资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。

(五) 投资决策依据

A. 决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的规定;
- (2) 国家宏观经济环境及其对债券市场的影响;
- (3) 国家货币政策、财政政策以及证券市场政策;
- (4) 债券发行人财务状况、行业处境、经济和市场需求状况;
- (5) 货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。

B. 决策程序

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制,建立了严谨、科学的投资管理流程,具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全过程。

1、投资研究及投资策略制定

本基金管理人实行投资策略研究专业化分工制度,由基金经理与研究员组成专业小组,进行宏观经济及政策、产业结构、金融市场、单个证券等领域的深入研究,并分别从利率、债券信用风险、相对价值等角度,提出独立的投资策略建议。经固定收益投资团队讨论,并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。

2、投资决策

基金经理在基金管理人固定收益证券总体投资策略的指导下,根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等规定,制定相应的投资计划,报投资决策委员会审批。

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构,决定基金总体投资策略及资产配置方案,审核基金经理提交的投资计划,提供指导性意见,并审核其他涉及基金投资管理的重大问题。

3、投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的决议,在权限范围内,评估债券的投资价值,选择证券构建基金投资组合,并根据市场变化调整基金投资组合,进行投资组合的日常管理。

4、交易执行

交易员负责在合法合规的前提下,执行基金经理的投资指令。

5、风险管理及绩效评估

风险分析专业人员对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估,报风险管理委员会,抄送投资决策委员会、投资总监及基金经理,并就基金的投资组合提出风险管理建议。

法律合规部对基金的投资行为进行合规性监控,并对投资过程中存在的风险隐患向基金经理、投资总监、投资决策委员会及风险管理委员会进行风险提示。

(六) 业绩比较基准

中债综合指数(全价)。

中债综合指数(全价)由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖了主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等)。中债综合指数能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时,基金管理人和基金托管人协商一致并报中国证监会备案后,可以变更本基金业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

(七) 风险收益特征

本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期

收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

- （1）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%；
- （2）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （3）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%；
- （4）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%；
- （5）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%；
- （6）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%；

(7) 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;

(8) 本基金投资固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%, 现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(10) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规及监管政策等对本基金的基金合同所约定的投资组合比例限制进行变更, 本基金在履行适当程序后, 可相应调整禁止行为和投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。

除上述第(7)、(8)、(9)、(10)项外, 因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

十五、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

十六、基金的财产

(一) 基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款

项和其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。
- 4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十七、基金资产的估值

（一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值原则

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定计量日的公允价值；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。

（五）估值方法

1、证券交易所上市交易的有价证券的估值

（1）交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种（另有规定的除外），采用估值技术确定公允价值；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的的资产支持证券，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；

（3）交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）首次公开发行未上市债券，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；

（2）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对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进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，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，则采用估值技术确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

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。

（六）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。各类基金份额的基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方约定的形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（七）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

（八）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

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

（九）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。

(十) 特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（五）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十八、基金费用与税收

(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、C 类基金份额的销售服务费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用；

- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.7% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费率年费率为 0.35%。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

C类基金份额销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

4、本条第（一）款第4至第9项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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、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等不列入基金费用。

（四）基金管理费、基金托管费、销售服务费的调整

在法律、法规和基金合同允许的条件下，基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况协商调整、调低基金管理费、基金托管费和销售服务费率。调低基金管理费、基金托管费和销售服务费率等相关费率或在不提高费率水平的情况下改变收费模式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十九、基金收益与分配

（一）收益的构成

基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（二）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

2、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分

配权；

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

5、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 20%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

7、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

8、当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益；

9、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）收益分配方案的确定与公告

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

（五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为同一类别的基金份额。

二十、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人和基金托管人应各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告；

- 3、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。

二十一、基金的信息披露

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

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。

（一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（四）基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额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各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（五）定期报告

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

1、基金年度报告：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报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起60日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基

金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在季度报告、半年度报告、年度报告等基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下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本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（六）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括：

- 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 50%；

- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值估值错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、调整基金份额类别的设置；
- 27、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 28、中国证监会规定的其他事项。

（七）公开澄清

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

（八）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，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

（九）中国证监会规定的其他信息

（十）信息披露文件的存放与查阅

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

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

二十二、基金的业务规则

基金份额持有人应遵守基金托管人、基金管理人及其代理销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则。

二十三、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基金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。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及本基金合同约定无需召开基金份额持有人大会的其他情形，

可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

（4）基金财产清算的期限为 6 个月。

3、清算程序

（1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

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

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十四、违约责任

(一) 因基金管理人或基金托管人违约给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任,因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。

(二) 基金合同当事人违反本基金合同,给基金财产或其他基金合同当事人造成损失的,应承担相应的赔偿责任。

(三) 发生下列情况时,当事人可以免责:

1、基金管理人和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规或规章的作为或不作为而造成的损失等;

2、基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失等;

3、不可抗力。基金管理人及基金托管人因不可抗力不能履行本基金合同的,可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任,但法律另有规定的除外。任何一方迟延履行后发生不可抗力的,不能免除责任。

(四) 在发生一方或多方当事人违约的情况下,基金合同能够继续履行的应当继续履行。

(五) 本基金合同当事人一方违约后,其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

二十五、争议的处理

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

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

二十六、基金合同的效力

(一) 本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件, 应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立, 自基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

(二) 本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三) 本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(四) 本基金合同正本一式六份, 除上报有关监管机构二份外, 基金管理人、基金托管人各持有二份, 每份具有同等的法律效力。

(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所或办公地址, 投资者在支付工本费后, 可在合理时间内取得上述文件复印件, 基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

二十七、基金合同内容摘要

(一) 基金合同当事人及其权利义务

1、基金管理人

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司。

(1) 基金管理人的权利

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:

- a. 依法募集基金;
- b. 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;
- c. 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;
- d. 销售基金份额;
- e. 召集基金份额持有人大会;
- f. 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定, 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;
- g. 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

- h. 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；
- i. 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用；
- j. 依据基金合同及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- k. 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；
- l. 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；
- m. 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；
- n. 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；
- o. 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；
- p. 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，在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高管理费、托管费和销售服务费之外的基金费率结构和收费方式；
- q. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2) 基金管理人的义务

根据《基金法》、《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：

- a. 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、赎回和注册登记手续；
- b. 办理基金备案手续；
- c. 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；
- d. 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；
- e. 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；
- f. 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；
- g. 依法接受基金托管人的监督；
- h. 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；

- i. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- j. 编制季度、半年度和年度基金报告；
- k. 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；
- l. 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；
- m. 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；
- n. 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- o. 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；
- p. 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；
- q. 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；
- r. 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；
- s. 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；
- t. 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；
- u. 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；
- v. 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；
- w. 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；
- x. 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；
- y. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- z. 建立并保存基金份额持有人名册；

aa.法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

2、基金托管人

本基金的基金托管人为中国银行股份有限公司。

(1) 基金托管人的权利

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：

- a. 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；
- b. 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；
- c. 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；
- d. 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。
- e. 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- f. 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- g. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2) 基金托管人的义务

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：

- a. 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- b. 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；
- c. 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；
- d. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- e. 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；
- f. 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；
- g. 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；
- h. 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- i. 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- j. 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；

- k. 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；
- l. 建立并保存基金份额持有人名册；
- m. 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- n. 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；
- o. 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- p. 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；
- q. 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；
- r. 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；
- s. 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；
- t. 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；
- u. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- v. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

3、基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

(1) 基金份额持有人的权利

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：

- a. 分享基金财产收益；
- b. 参与分配清算后的剩余基金财产；
- c. 依法申请赎回其持有的基金份额；
- d. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- e. 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；

- f. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- g. 监督基金管理人的投资运作；
- h. 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；
- i. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2) 基金份额持有人的义务

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：

- a. 认真阅读并遵守基金合同；
- b. 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；
- c. 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- d. 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；
- e. 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；
- f. 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；
- g. 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- h. 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；
- i. 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

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成，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。

2、有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 变更基金类别；
- (6) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (7) 变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- (8) 本基金与其他基金合并；
- (9) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(10) 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；

(11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

(12) 法律法规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。

3、有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费率、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用；

(2) 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、调低赎回费率或变更收费方式，调整基金份额类别的设置；

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；

(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) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(6) 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；

(7) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式：

(1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（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。

(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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（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。

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

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

5、通知

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

- (1) 会议召开的时间、地点、方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- (3) 代理投票授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (4) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (5) 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；
- (6) 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会等方式。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

- (1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；
- (2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- a. 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- b. 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；
- c. 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；
- d. 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，

同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

e. 会议通知公布前已报中国证监会备案。

(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。

7、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

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

b. 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

c. 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a) 关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

d. 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

a. 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的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。

b. 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

8、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

a. 特别决议

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

b. 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

9、计票

（1）现场开会

a. 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

b. 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。

c. 如果大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

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

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监票员在监督员派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督员经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票员进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人

应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

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

(4) 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(三) 基金收益与分配

1、收益的构成

基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2、收益分配原则

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

(2) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

(5) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 20%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(7) 投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；

(8) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益；

(9) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

3、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

4、收益分配方案的确定与公告

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

5、收益分配中发生的费用

(1) 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

(2) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为同一类别的基金份额。

(四) 基金费用与税收

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) C 类基金份额的销售服务费；
- (4) 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- (5) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (8) 基金资产的资金汇划费用；
- (9) 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.7% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

(3) C 类基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费率按年费率 0.35%。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，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 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

C 类基金份额销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

(4) 本条第 1 款第 4 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第 1 款约定以外的其他费用，以及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、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等不列入基金费用。

4、基金管理费、基金托管费、销售服务费的调整

在法律、法规和基金合同允许的条件下，基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况协商调整、调低基金管理费、基金托管费和销售服务费率。调低基金管理费、基金托管费和销售服务费率等相关费率或在不提高费率水平的情况下改变收费模式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定

在指定媒体上公告。

5、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

（五）基金的投资

1、投资目标

在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

2、投资范围

本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、次级债、中期票据（MTN）、短期融资券（CP）、超短期融资券（SCP）、资产支持证券（ABS）、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

3、投资理念

本基金通过对宏观经济形势、货币政策意图、证券市场政策导向、投资人行为、公司基本面和偿债能力等因素进行深入研究和分析，执行自上而下的债券资产期限配置与自下而上不同市场、期限品种选择相结合的组合动态构建过程。在有效控制风险和保持资产流动性的前提下，力求获取较高的超额收益。

4、投资策略

A. 大类资产配置策略

本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。

B. 债券组合管理策略

（1）利率策略

利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策

略。通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略，例如：子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

（2）类属配置策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

（3）信用策略

信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上，结合信用品种的发行条款，建立信用债备选库，并以此为基础拟定信用品种的投资方法。

a. 宏观环境和行业分析

主要关注宏观经济状况和经济增长速度、宏观经济政策及法律制度对企业信用级别的影响；行业分析主要关注企业所处的行业类型（成长型、周期型、防御型）、产业链结构及行业在产业链中的位置、行业的竞争程度和行业政策对企业信用级别的影响。

b. 发债主体基本面分析

主要包括定性分析和定量分析两个方面：

定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、企业财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位置、产品竞争力和核心优势的分析，以及企业的股东背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方的重要程度等企业的外部支持分析。

定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力分析以及偿债能力分析四部分，定量分析的重点是选取适当的财务指标并挖掘其中蕴含的深层含义及互动关系，定量地实现企业信用水平的区分和预测。

c. 内部信用评级定量分析体系。

经过广泛的调研，基于我国目前实际情况，考虑到国内外评级、以及专业的发行评级与投资评级的差异，从投资角度建立内部的公司债评级体系，其分析过程包括如下几个部分：

1) 行业内财务数据指标筛选。基于可比原则，采用因子分析对行业内各公司多个具有信息冗余的财务数据指标（相关性较高）进行筛选，选择能够反映公司总体财务信息的财务数据指标。

2) 行业内公司综合评价。基于可比原则, 利用筛选指标对行业内公司进行整体的综合评级, 得到反映公司行业内所处相对位置的信用分数。

3) 行业内信用等级的切分。根据信用分数的统计分布进行类别划分。

4) 系统校验与跟踪分析。根据财务数据指标等信息的变化适时对信用等级进行调整, 并建立与信用利差相应的跟踪。

5) 信用利差分析与定价。基于实际研究, 通过寻找信用利差异动所带来的定价偏差, 获取与承担风险相适宜的收益。

d. 相对价值策略

本基金认为市场存在着失效的现象, 短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多, 投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同, 发掘存在于这些不同因素之间的相对价值, 也是本基金发现投资机会的重要方面。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动, 通过深入分析市场参与者的立场和观点, 充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者税收待遇等因素导致的市场失衡机会, 形成相对价值投资策略, 为本基金的投资带来增加价值。

e. 债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度, 结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素, 确定其投资价值, 选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

f. 资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券 (ABS)、住房抵押贷款支持证券 (MBS) 等在内的资产支持证券, 其定价受多种因素影响, 包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素, 并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型, 评估其内在价值。

5、投资决策依据

A. 决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的规定;
- (2) 国家宏观经济环境及其对债券市场的影响;
- (3) 国家货币政策、财政政策以及证券市场政策;
- (4) 债券发行人财务状况、行业处境、经济和市场的需求状况;
- (5) 货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。

B. 决策程序

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制, 建立了严谨、科学的投资管理流程, 具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全过程。

（1）投资研究及投资策略制定

本基金管理人实行投资策略研究专业化分工制度，由基金经理与研究员组成专业小组，进行宏观经济及政策、产业结构、金融市场、单个证券等领域的深入研究，并分别从利率、债券信用风险、相对价值等角度，提出独立的投资策略建议。经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。

（2）投资决策

基金经理在基金管理人固定收益证券总体投资策略的指导下，根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等规定，制定相应的投资计划，报投资决策委员会审批。

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构，决定基金总体投资策略及资产配置方案，审核基金经理提交的投资计划，提供指导性意见，并审核其他涉及基金投资管理的重大问题。

（3）投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的决议，在权限范围内，评估债券的投资价值，选择证券构建基金投资组合，并根据市场变化调整基金投资组合，进行投资组合的日常管理。

（4）交易执行

交易员负责在合法合规的前提下，执行基金经理的投资指令。

（5）风险管理及绩效评估

风险分析专业人员对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估，报风险管理委员会，抄送投资决策委员会、投资总监及基金经理，并就基金的投资组合提出风险管理建议。

法律合规部对基金的投资行为进行合规性监控，并对投资过程中存在的风险隐患向基金经理、投资总监、投资决策委员会及风险管理委员会进行风险提示。

6、业绩比较基准

中债综合指数（全价）。

中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。中债综合指数能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时，基金管理人和基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，可以变更本基金业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

7、风险收益特征

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

8、投资禁止行为与限制

(1) 禁止用本基金财产从事以下行为

- a. 承销证券；
- b. 向他人贷款或者提供担保；
- c. 从事承担无限责任的投资；
- d. 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- e. 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- f. 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- g. 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；
- h. 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

(2) 基金投资组合比例限制

- a. 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%；
- b. 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- c. 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%；
- d. 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%；
- e. 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%；
- f. 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%；
- g. 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；
- h. 本基金投资固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- i. 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- j. 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交

易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

k. 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规及监管政策等对本基金的基金合同所约定的投资组合比例限制进行变更，本基金在履行适当程序后，可相应调整禁止行为和投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金在履行适当程序后投资不再受相关限制。

除上述第 g、h、i、j 项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

2、基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额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各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

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基金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。

（2）变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

（3）但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及本基金合同约定无需召开基金份额持有人大会的其他情形，

可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止；

(2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

(3) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

3、基金财产的清算

(1) 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

(2) 基金财产清算组

a. 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

c. 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

d. 基金财产清算的期限为 6 个月。

(3) 清算程序

a. 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

b. 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

c. 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

d. 对基金财产进行评估和变现；

e. 制作清算报告；

f. 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；

g. 将清算报告报中国证监会备案并公告；

h. 对基金财产进行分配。

(4) 清算费用

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

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- a. 支付清算费用；
- b. 交纳所欠税款；
- c. 清偿基金债务；
- d. 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 a、b、c 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

(6) 基金财产清算的公告

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

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

(九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所或办公地址，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

(以下无正文)

（本页为《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》签署页，无正文）

基金管理人：长盛基金管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权签字人：

签订日：

签订地：

基金托管人：中国银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权签字人：

签订日：

签订地：