



# 长信利丰债券型证券投资基金 招募说明书

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行



# 长信利丰债券型证券投资基金招募说明书

## 重要提示

本基金经 2008 年 10 月 31 日中国证券监督管理委员会证监许可【2008】1252 号文核准募集。

基金管理人保证本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。

投资有风险，基金投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资者，应全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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。

基金管理人保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。



## 目 录

一、绪言 .....	2
二、释义 .....	3
三、基金管理人 .....	7
四、基金托管人 .....	15
五、相关服务机构 .....	18
六、基金的募集 .....	28
七、基金合同的生效 .....	31
八、基金份额的申购与赎回 .....	32
九、基金的投资 .....	41
十、基金的财产 .....	49
十一、基金资产的估值 .....	50
十二、基金收益与分配 .....	57
十三、基金费用与税收 .....	59
十四、基金的会计与审计 .....	61
十五、基金的信息披露 .....	62
十六、风险揭示 .....	67
十七、基金合同的变更、终止和基金财产的清算 .....	70
十八、基金合同的内容摘要 .....	73
十九、基金托管协议的内容摘要 .....	88
二十、其他应披露事项 .....	101
二十一、基金份额持有人的服务 .....	102
二十二、招募说明书存放及查阅方式 .....	104
二十三、备查文件 .....	错误!未定义书签。



## 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》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规的规定,以及《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“合同”或“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了长信利丰债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与基金投资者投资决策有关的全部必要事项,基金投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本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。本招募说明书由长信基金管理有限责任公司解释。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,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务关系的法律文件。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基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。



## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

- 1、基金或本基金：指长信利丰债券型证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指长信基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行
- 4、基金合同或本基金合同：指《长信利丰债券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、托管协议或本托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长信利丰债券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《长信利丰债券型证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每 6 个月更新 1 次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日
- 7、基金份额发售公告：指《长信利丰债券型证券投资基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订。
- 9、《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，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》及颁布机关对其不时作出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 25 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订
- 13、中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区
- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会或其地方派出机构



- 15、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会
- 16、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
- 17、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
- 18、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构
- 19、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》及其他相关法律法规的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者
- 20、基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称
- 21、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者
- 22、基金销售业务：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
- 23、销售机构：指直销机构和代销机构
- 24、直销机构：指长信基金管理有限责任公司
- 25、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
- 26、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
- 27、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、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等
- 28、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司或接受长信基金管理有限责任公司委托代为办理注册登记业务的机构
- 29、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、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 30、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构买卖基金份额的变动及结余情况的账户
- 31、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期
- 32、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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期



- 33、基金募集期限：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3个月
- 34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 36、日：指公历日
- 37、月：指公历月
- 38、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日
- 39、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）
- 40、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期
- 41、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 42、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为
- 43、申购：指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为
- 44、赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件要求卖出基金份额的行为
- 45、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
- 46、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的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为
- 47、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变更所持基金份额销售机构的操作
- 48、巨额赎回：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）超过上一日基金总份额的10%时
- 49、元：指人民币元
- 50、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
- 51、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
- 52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值
- 53、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的数值



54、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

55、指定媒体：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体

56、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易





## 三、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：长信基金管理有限责任公司

住所：上海市黄浦区汉口路 130 号 3、4 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼

成立日期：2003 年 4 月 28 日

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

法定代表人：田丹

电话：021-61009999

传真：021-61009800

联系人：尹克文

股权结构：长江证券股份有限公司出资 7350 万元人民币，占注册资本的 49%；上海海欣集团股份有限公司出资 5149.5 万元人民币，占注册资本的 34.33%；武汉钢铁股份有限公司出资 2500.5 万元人民币，占注册资本的 16.67%；

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。根据公司发展战略和组织管理原则，结合基金管理的业务特点，在经营管理层下设内部控制委员会、投资决策委员会和产品发展委员会三个非常设委员会，以及投资管理部、研究发展部、交易管理部、固定收益部、金融工程部、基金事务部、市场开发部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部 10 个部门，并设立了北京分公司。

截至 2008 年 10 月，公司现有正式员工 91 人，其中：博士学历 5 人，占 5%；硕士学历 42 人，占 46%；本科学历 36 人，占 40%；专科学历 6 人，占 7%；其它 2 人，占 2%。具有海外留学或工作经历的 12 人，占 13%。

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

董事长田丹先生，中共党员，硕士，经济师。曾任湖北省军区参谋、秘书，中国人民银行湖北省分行金融调研处科长，湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理，三峡证券公司副总经理，湖北证券有限责任公司董事、副总裁，长江证券股份有



限公司董事、副总裁、财务负责人，长江证券股份有限公司董事、总裁。现任本公司董事长。

董事胡运钊先生，中共党员，研究生学历，高级经济师。历任湖北省经委工业处处长、黄石市人民政府副市长、市委常委、常务副市长、湖北省人民政府副秘书长（正厅）、办公厅主任、办公厅党组副书记。现任长江证券股份有限公司党委书记、董事长。

董事王岭先生，中共党员，硕士，高级经济师。历任武汉钢铁（集团）公司热轧厂技术员、科长、车间副主任、厂长助理、副厂长、厂长，武汉钢铁（集团）公司总经理助理兼武汉钢铁有限责任公司副总经理，武汉钢铁（集团）公司副总经理兼钢铁公司党委书记、副总经理，现任武汉钢铁股份有限公司董事、总经理。

董事李国洪先生，硕士，曾在武汉市人民政府工作，历任长江证券有限责任公司投资银行总部副总经理、资产保全事业部总经理、办公室总经理，现任长江证券股份有限公司副总裁。

董事徐文彬先生，中共党员。历任中国人民解放军 273 团政委，上海市松江区建设委员会党委书记，上海市松江区小昆山镇党委书记，上海市松江区洞泾镇党委书记，现任上海海欣集团股份有限公司党委书记、总裁。

董事陈谋亮先生，中共党员，硕士，高级经济师。历任湖北经济学院讲师，扬子石化公司法律顾问，上海交大南洋股份有限公司部门经理兼证券事务代表，上海海欣集团股份有限公司董事会秘书兼战略投资管理部常务副总监、总裁助理。现任上海海欣集团股份有限公司副总裁兼董事会秘书。

独立董事朱恒先生，中共党员，大学本科，高级经济师。历任中国农业银行上海市分行副行长，上海浦东发展银行副行长，万国证券公司、申银万国证券公司董事长，上海浦东发展银行党委副书记、副行长，上海轻工控股（集团）公司监事会主席。

独立董事余秉立先生，中共党员，大学本科，注册会计师。历任武汉市财政局副科长、武汉市政府财贸办公室副科长、武汉市财政局副科长至副局长、武汉市审计局局长、党组书记、湖北省财政金融贸易办公室副主任、副书记、审计署驻武汉特派办特派员、书记、审计署驻武汉特派办正局级审计员。

独立董事黄宪先生，中共党员，博士，博士生导师，曾任武汉大学教师、商学院副院长，美国新泽西西东大学访问学者，武汉大学珞珈城市信用社副董事长，中港合资武新公司财务总经理。

独立董事宋晓燕女士，中共党员，法学博士，律师。曾任武汉大学管理学院国际金



融系教师，现任上海财经大学法学院教师。

## 2、监事会成员

监事郭自祥先生，中共党员，硕士，政工师。历任江汉油田新村农场干部，武钢二炼钢厂宣传部副部长、部长、连铸车间主任，武钢工会副书记、副主席，武汉钢铁（集团）公司钢铁公司办公室主任，现任武汉钢铁集团公司企业管理部部长。

监事柳杨先生，硕士，审计师。历任长江证券有限责任公司财务总部会计员、核算部经理、总经理助理，现任长江证券股份有限公司财务负责人、财务总部总经理。

监事王罗洁女士，大学本科，高级会计师，历任核工业部国营 792 矿统计员、计划科长，上海海欣股份有限公司财务副经理、经理、财务副总监等职，现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。

监事覃波先生，中共党员，本科。历任长江证券有限责任公司债券基金事业部市场部主管、长信基金管理有限责任公司市场开发部区域经理、营销策划部副总监，现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼市场开发部总监。

监事刘耘女士，中共党员，硕士。历任湖北经贸实业公司暨大通（中国）国际运输有限责任公司湖北分公司会计主管、深圳蓝天基金管理公司暨武汉蓝天房地产发展有限公司财务部经理、武汉国有资产经营公司资产财务部副经理、长信基金管理有限责任公司基金事务部总监、市场开发部副总监，现任长信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。

## 3、经理层成员

蒋学杰先生，经济学硕士，澳大利亚墨尔本大学商学院 MBA。曾任中南财经大学财政金融学院财政系教师、武汉科技信托投资公司武昌证券营业部总经理，并兼公司总助，副总等职、Loftus Capital Partners Limited, Australia 旗下基金亚洲市场投资组合及私人股权投资的亚洲区域负责人、KVB Kunlun Pty Ltd, Australia 金融衍生产品持牌交易投资顾问。曾任长信基金管理有限责任公司副总经理，现任总经理。

## 4、督察长

周永刚先生，硕士，经济师。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券股份有限公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券股份有限公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。现任长信基金管理有限责任公司督察长。

## 5、基金经理



李小羽先生，管理学硕士，获加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任长城证券公司证券分析师，加拿大Investors Group Financial Services Co., Ltd 投资经理和投资顾问。2002年10月加入本公司，先后任长信利息收益基金基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监，拟任本基金基金经理。

## 6、投资决策委员会成员

蒋学杰先生，长信基金管理有限责任公司总经理。

叶琦先生，长信基金管理有限责任公司总经理助理兼金融工程部总监。

曾芒先生，长信基金管理有限责任公司投资管理部总监。

李小羽先生，长信基金管理有限责任公司固定收益部总监。

骆泽斌先生，长信基金管理有限责任公司研究发展部总监。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

## （三）基金管理人的职责

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、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财产分别管理，分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制基金季度、半年度和年度报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、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；

9、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；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

## （四）基金管理人的承诺



1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规的行为发生；

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生：

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律法规有关规定，由中国证监会禁止的其他行为。

3、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、受雇人或任何第三者谋取利益；

(3) 不泄露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) 不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### **(五) 基金管理人的风险管理和内部控制制度**

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

1、内部风险管理体系

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

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

投资风险管理的；

交易风险管理的；

巨额赎回风险管理的；

基金注册登记风险管理的；

基金核算风险管理的；

市场开发风险管理的；

信息披露风险管理的；



不可抗力风险管理。

## 2、内部控制制度的建立情况

建立健全基金管理公司的规章制度是基金管理公司的基础性工作，也是保护基金份额持有人的重要措施。除《公司章程》外，基金管理人还制定了以下制度：

### （1）内部控制制度遵循的原则

**合法合规性原则：**公司内部控制制度应当符合国家法律法规和各项规定。

**全面性原则：**内部控制制度应当覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工。

**有效性原则：**通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行，内部控制制度应当具有高度的权威性，任何员工不得拥有超越制度约束的权利。

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

**相互制约原则：**公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

**防火墙原则：**公司基金投资、交易、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应当制定严格的审批程序和监管措施。

**审慎性原则：**制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

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

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

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

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

### （2）内部控制制度的内容

基金管理人的内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度





的纲要和总揽，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源制度、业绩评估考核制度和危机处理制度。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明。

### （3）内部风险控制体系结构

公司董事会、经营管理层、内部控制委员会、督察长、监察稽核部及公司其他部门、各岗位在各自职责范围内承担风险控制责任。

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

b、经营管理层：负责日常经营管理中的风险控制工作，对内部控制制度的有效执行承担责任；

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

d、督察长：负责对公司内部管理、资产运作以及经营管理层、内部各部门、各岗位执行制度及遵纪守法情况进行监督和检查，并对公司内部风险控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价；

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

f、业务部门：根据公司各项基本管理制度，结合部门具体情况制定本部门的管理办法和实施细则，加强对各项业务和各业务环节的风险控制；

g、公司各岗位：根据岗位职责和业务操作流程，按业务授权规范操作，严格控制操作风险。

### （4）风险管理和内部控制的措施

a、建立内控结构，完善内控制度：建立、健全了行之有效的内控制度，确保各项



业务活动都有适当的授权和明确的分工，确保监察稽核活动的独立性、权威性；

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

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

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

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

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

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

### 3、基金管理人关于内部合规控制声明书

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。





## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

#### 1、基金托管人概况

名称：中国农业银行

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立时间：1979 年 2 月 23 日

注册资金：361 亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。在国内,中国农业银行网点遍布城乡,资金实力雄厚,服务功能齐全,不仅为广大客户所信赖,而且与他们一道取得了长足的共同进步,已成为中国最大的银行之一。在海外,农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,被《财富》评为世界 500 强企业之一。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。中国农业银行自 1979 年恢复成立以来,在社会各界的大力支持下,全行员工开拓创新,奋力拼搏,在建设现代商业银行的征途上,积极探索,勇于实践,资金实力显著增强,业务领域不断拓宽,经营结构逐年优化,财务收益大幅跃升,管理水平不断提高,在支持国民经济发展、为客户提供优质服务的同时,自身不断成长壮大。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批



准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 87 名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师 10 余名，服务团队成员都具有高素质高学历的托管业务能力，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称。

## 3、基金托管业务经营情况

截止 2008 年 6 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 56 只，包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景福、基金天华、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金，国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金。

## （二）基金托管人的内部控制制度



## 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

## 2、内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

## 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

### (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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户,基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。



## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

1、直销机构：长信基金管理有限责任公司

住所：上海市黄浦区汉口路 130 号 3-4 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼

法定代表人：田丹

联系人：孙赵辉

电话：021-61009916

传真：021-61009800

客户服务统一咨询电话：4007005566

公司网站：www.cxfund.com.cn

2、代销机构：

（1）中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

电话：010- 68297268

传真：010-68297268

联系人：蒋浩

客服电话：95599

网址：<http://www.abchina.com/>

（2）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号

办公地址：武汉市新华路特 8 号

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：021-63296362

传真：021-33130730



客户服务电话：400-8888-999

网址：www.cjsc.com

(3) 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：张佑君

联系人：权唐

电话：(010) 65186758;

传真：(010) 65182261

客户服务电话：400-8888-108（免长途费）；(010) 65186758

网址：www.csc108.com

(4) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法人代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-62583439

客户服务热线：400-8888-666 021-962588（上海地区）

网址：www.gtja.com

(5) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-68419974

传真：0591-7541476

客户服务电话：400-8888-123

网址：www.xyzq.com

(6) 齐鲁证券有限公司



注册地址：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

联系人：傅咏梅

电话：0531-81283731

传真：0531-81283735

客户客服电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(7) 湘财证券有限责任公司

注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海银城中路 188 号交银金融大厦

法定代表人：陈学荣

联系人：杜颖灏

电话：021-68634518

传真：021-68865938

客户服务电话：400-888-1551

网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

(8) 中国银河证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：肖时庆

联系人：李洋

电话：010-66568888

传真：010-66568532

客户服务电话：4008-888-888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(9) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国



联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客户服务电话：400-8888-001

网址：www.htsec.com

(10) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

电话：020-87555888 转各营业网点

传真：020-87557985

客户服务电话：95575

网址：<http://www.gf.com.cn>

(11) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：吴中文

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559

网址：[www.95559.com.cn](http://www.95559.com.cn)

(12) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：邓寒冰

电话：021-54033888

传真：021-54035333



客户服务电话：021-962505

网址：www.sywg.com.cn

(13) 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：秦晓

联系人：王楠

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(14) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

联系人：黎珊

电话：010-65557018

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com/>

(15) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路 4 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：李群

电话：010-58560666

传真：010-83914283

客户服务电话：95568

网址：<http://www.cmbc.com.cn/>

(16) 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：上海市浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 14-16 楼

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：021-50818887

传真：021-68817271

客户服务电话：4008-888-788

网址：www.ebscn.com

(17) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：广东省福田区江苏大厦

法定代表人：宫少林

联系人：黄新波

电话：0755-82969223

传真：0755-82943121

客户服务电话：95555

网址：www.newone.com.cn

(18) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座

法定代表人：汤世生

联系人：李茂俊

电话：010-62267799

传真：010-62296854

客户服务电话：0991-96562      010-62294600

网址：www.ehongyuan.com

(19) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：方加春

联系人：罗芳



电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com

(20) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

法定代表人：王益明

联系人：吴宇

电话：021-58550028 总机：021-63325888

传真：021-50366868 传真：021-63327888

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

(21) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

电话：0755-83516089

传真：0755-83998537

客户服务电话：400-6666-888

网址：www.cc168.com.cn

(22) 东莞证券股份有限公司

注册地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

联系人：罗绍辉

电话：0769-22119351 总机：0769-22119341

传真：0769-22116999

客户服务电话：961130



网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

(23) 中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务庭院楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务庭院楼 A 座

法定代表人：刘军

联系人：徐蕾

电话：0571-86811952

传真：0571-85783731

客户服务电话：96598

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

(24) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(25) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：陶礼明

联系人：陈春林

电话：010-66415205

传真：010-66419824

客户服务电话：11185

网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

(26) 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：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533



网址：www.ccb.com

(27) 西藏证券经纪有限责任公司

注册地址：拉萨市罗布林卡路6号

办公地址：上海市辉河路118号

法定代表人：贾绍君

联系人：刘宇

电话：021-65526481

传真：021-65526481

客户服务电话：400-8811-177

网址：www.xzsec.com

(28) 场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格, 并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员（以下简称“有资格的上交所会员”），名单详见上海证券交易所网站：

[http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg\\_szjzt.jsp](http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjzt.jsp)

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

## (二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：陈耀先

电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

## (三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室



负责人：廖海

联系电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：廖海

经办律师：廖海、吴军娥

#### **（四）审计基金财产的会计师事务所**

名称：毕马威华振会计师事务所

住所：北京东长安街1号东方广场东2座8层

办公地址：上海市静安区南京西路1266号49-51楼

法定代表人：萧伟强

联系人：彭成初

经办注册会计师：王国蓓、许卓炎

电话：021-22122888

传真：021-62881889



## 六、基金的募集

基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关规定及基金合同，并经中国证监会 2008 年 10 月 31 日证监许可【2008】1252 号文核准募集。

### （一）基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

#### 1、发售时间

自基金份额发售之日起，最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

#### 2、发售方式

本基金通过场内销售和场外销售两种方式公开发售。场外销售渠道为基金管理人的直销网点和不通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理相关业务的场外代销机构的代销网点（具体名单见基金份额发售公告）；场内销售渠道为通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理相关业务的上海证券交易所会员单位（具体名单见基金份额发售公告）。场内认购须遵守上海证券交易所相关规则。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

#### 3、发售对象

中国境内的个人投资者和机构投资者（法律法规禁止投资证券投资基金的除外）、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。

### （二）认购的时间安排

具体时间由基金管理人根据有关法律法规和基金合同确定（见基金份额发售公告及代销机构相关公告）。

### （三）募集规模

本基金不设定募集目标规模

### （四）基金类型

债券型

### （五）基金运作方式

契约型、开放式



## （六）基金存续期间

不定期

## （七）基金份额的初始面值

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元。

## （八）基金份额的场外认购

本基金采取金额认购、全额缴款的认购方式。基金投资者在募集期内可以多次认购基金份额，认购一经受理不得撤销。认购期间单个基金投资者的累积认购规模没有限制。

### 1、认购费率

本基金不收取认购费。

### 2、认购金额的限定

通过代销网点每次认购的单笔最低金额为 1000 元。若代销机构有关于交易级差规定的，以代销机构的规定为准。

通过直销中心首次认购的最低金额为 10 万元，追加认购最低金额为 1000 元。在本公司网上直销系统可接受个人投资者单笔认购金额在 1,000 元人民币以上(含 1,000 元)的认购申请。具体单笔认购限额以投资者指定结算机构的规定为准。

基金募集期间不设置基金投资者单个账户最高认购金额限制。

### 3、场外认购的程序

- (1) 申请方式：书面申请或基金管理人公告的其他方式。
- (2) 认购款项支付：基金投资者认购时，采用全额缴款方式。

### 4、认购的确认

当日（T 日）在规定时间内提交的申请，基金投资者通常可在 T+2 日到网点查询交易情况，在基金合同生效后可以到网点打印交易确认书。

### 5、认购期利息的处理方式

有效认购款项在基金募集期间形成的利息，在基金合同生效后，折算成基金份额计入基金投资者的账户，具体份额以注册登记机构的记录为准。

## （九）基金份额的场内认购

本基金采取金额认购、全额缴款的认购方式。基金投资者在募集期内可以多次认购基金份额，认购一经受理不得撤销。

### 1、认购费率



本基金不收取认购费。

## 2、认购金额的限定

通过场内代销机构认购本基金时，每笔最低认购金额为 1,000 元人民币且必须是 100 元的整数倍，单笔认购最高不超过 99,999,900 元人民币。

## 3、场内认购的程序

基金投资者按上海证券交易所会员单位的规定办理认购手续。

## 4、认购的确认

当日（T 日）在规定时间内提交的申请，基金投资者通常可在 T+2 日到网点查询交易情况，在基金合同生效后可以到网点打印交易确认书。

## 5、认购期利息的处理方式

有效认购款项在基金募集期间形成的利息在基金合同生效后，折算成基金份额计入基金投资者的账户，具体份额以注册登记机构的记录为准。





## 七、基金合同的生效

### （一）基金备案和基金合同生效

1、基金募集期限届满，在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，并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并自募集结束之日起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，向中国证监会办理基金备案手续。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、基金合同生效前，基金投资者的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。认购资金在基金募集期形成的利息在基金合同生效后，折成基金投资者认购的基金份额归基金投资者所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （二）基金募集失败

1、基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后30日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

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5,000万元人民币的，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续20个工作日达不到200人，或连续20个工作日基金资产净值低于5,000万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告说明出现上述情况的原因并提出解决方案。法律法规另有规定的，按其规定办理。



## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回的场所

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以及通过上海证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的会员单位。

基金投资者应当在销售机构办理基金申购、赎回业务或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。销售机构可以酌情增加或减少其销售网点、变更营业场所。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

基金投资者在开放日申请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。场内申购、赎回业务的开放时间为9:30-11:30和13:00-15:00，场外申购、赎回业务的开放时间由基金管理人与销售机构约定，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并公告。

#### 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3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3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，由基金管理人最迟于开始日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人的公司网站上公告。

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。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回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。



### （三）申购和赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即基金份额的申购与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、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、赎回遵循“先进先出”原则，即按照基金投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
- 4、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；
- 5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体及基金管理人网站上予以公告。

### （四）申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

基金投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

#### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当日作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。

T日提交的有效申请，基金投资者可在T+2日后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、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金投资者赎回申请成功后，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。

### （五）申购和赎回的金额

#### 1、申购金额的限制



场外申购时，代销网点每个账户单笔申购本基金的最低金额为 1,000 元，若代销机构有关于交易级差规定的，以代销机构的规定为准。直销网点每个账户首次申购本基金的最低金额为 10 万元，追加申购的最低金额为 1,000 元。已在直销网点有本基金认购记录的基金投资者不受首次申购最低金额的限制，但受追加申购最低金额的限制。在本公司网上交易系统可接受个人投资者单笔申购金额在 1,000 元人民币以上(含 1,000 元)的申购申请。具体申购限额以投资者指定结算机构的规定为准。代销网点的基金投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

场内申购时，每笔申购金额最低为 1,000 元（含申购费），同时每笔申购必须是 100 元的整数倍，并且单笔申购最高不超过 99,999,900 元（含申购费）。

## 2、赎回份额的限制

场外赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 1.00 份基金份额。场内赎回时，赎回的最低份额为 1.00 份；

基金份额持有人赎回时或赎回后，导致每个交易帐户的基金份额余额不足 1.00 份时，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，对以上限制进行调整，最迟在调整前 2 日在指定媒体及基金管理人网站上公告。

4、申购份额及余额的处理方式：申购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位；申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，场外申购时，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有；场内申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，保留到整数位，剩余部分折回金额返回投资者。

5、赎回金额的处理方式：赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；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，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入。由此产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

6、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



误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## （六）申购费用和赎回费用

### 1、申购费用

本基金不收取申购费用。

### 2、赎回费用

本基金的赎回费用在基金投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率为 0.1%。

3、基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人的公司网站上公告。

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）等进行基金交易的基金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，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后对基金投资者适当调整基金基金赎回费率和基金转换费率。

5、本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

## （七）申购份额和赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算公式

本基金申购份数的计算方法如下：

申购份额=申购金额/申购当日基金份额净值

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。

例：假定 T 日的基金份额净值为 1.1 元，申购金额为 1 万元，则得到的基金份额为：

申购份额=10000/1.1=9090.90 份，截位保留整位数为 9090 份

即：基金投资者投资 1 万元在场外申购本基金，可得到 9090.90 份基金份额；如在场内申购本基金，则可得到 9090 份。

### 2、赎回金额的计算

基金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。

基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，其中：



赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

以上计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

例：某基金投资者赎回 1 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.1=11000 元

赎回费用=11000×0.1%=11 元

赎回金额=11000-11=10989 元

即：基金投资者赎回本基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.1 元，则其可得到的赎回金额为 10989 元。

### 3、基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值=基金资产净值总额÷基金份额总数。

T 日的基金份额净值精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，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。

本基金 T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## （八）申购和赎回的注册登记

1、基金投资者申购基金份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为基金投资者登记权益并办理注册登记手续，基金投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

2、基金投资者赎回基金份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为基金投资者办理扣除权益的注册登记手续。

3、基金管理人可以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 2 日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体予以公告。

## （九）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

1、不可抗力的原因导致基金无法正常运转；





2、证券交易场所在交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日的基金资产净值；

3、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

4、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或基金管理人认为会损害已有基金份额持有人的利益的申购；

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给基金投资者。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。

### （十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者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、证券交易场所交易非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、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情况；

5、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向中国证监会报告，已接受的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，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3项所述情形，按基金合同的相关条款处理。投资者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。

### （十一）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本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

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

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为支付基金投资者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日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。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；未能赎回部分，基金投资者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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金投资者在提交赎回申请时未作明确选择，基金投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应当通过招募说明书规定的方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体及基金管理人网站上刊登公告，并向中国证监会备案。

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，并应当在指定媒体及基金管理人网站上公告。

## **(十二) 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，并在规定期限内依照有关规定在指定媒体及基金管理人网站刊登暂停公告。

2、如果发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒体及基金管理人网站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、如果发生暂停的时间超过一日但少于两周，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 个工作日在指定媒体及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少刊登暂停





公告一次。暂停结束基金重新开放申购和赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在指定媒体及基金管理人网站上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并公告最近一个开放日的基金份额净值。

### （十三）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，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，并及时告知基金托管人与相关机构。

### （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的标准收取转托管费。

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

### （十五）定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下，本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时公告为准。

### （十六）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其它情况而产生的非交易过户。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基金投资者。

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注册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在基金注册登记机构规定期限内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### （十七）其他情形

基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。



基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。



## 九、基金的投资

### （一）投资目标

通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。

### （二）投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的 20%；投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的 20%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

### （三）投资理念

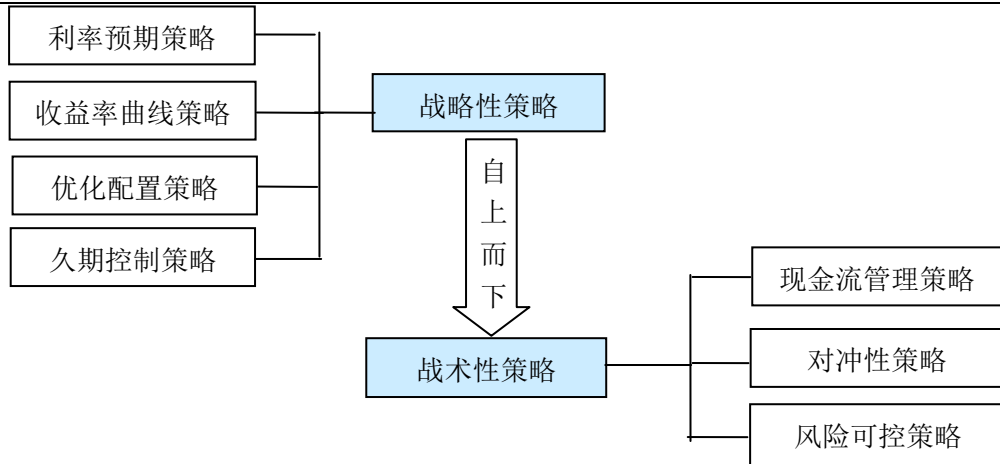
基于对经济和债券市场的展望采用自上而下的投资策略，通过积极主动的投资管理，运用各种价值增值策略提高潜在的总收益和控制基金风险，为投资者提供稳健持续增长的投资收益。

多种价值增值策略关注于分析宏观经济的长期变化趋势、利率及其波动性分析、固定收益类别资产的选择和债券的信用级别分析，注重基金持续稳健的投资业绩。

### （四）投资策略

本基金为债券型基金，基金资产主要投资于固定收益类品种，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的 20%，并通过投资国债、金融债和资产支持证券等，增加企业债投资组合的投资收益。

本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。



图：长信利丰债券基金投资策略体系

## 1、债券类资产投资策略

### A、利率预期策略

基于对宏观经济、货币政策、财政政策等利率影响因素的分析判断，合理确定投资组合的目标久期，提高投资组合的盈利潜力。如果预测利率趋于上升，则适当降低投资组合的修正久期；如果预测利率趋于下降，则适当增加投资组合的修正久期。

### B、收益率曲线策略

债券市场的收益率曲线随时间变化而变化，本基金将根据收益率曲线的变化，和对利率走势变化情况的判断，在长期、中期和短期债券间进行配置，并从相对变化中获利。适时采用哑铃型、梯型或子弹型投资策略，以最大限度地规避利率变动对投资组合的影响。

### C、优化配置策略

根据基金的投资目标和管理风格，分析符合投资标准的债券的各种量化指标，包括预期收益指标、预期风险指标、流动性指标等，利用量化模型确定投资组合配置比例，实现既定条件下投资收益的最优化。

### D、久期控制策略

久期作为衡量债券利率风险的指标，反映了债券价格对收益率变动的敏感度。本基金通过建立量化模型，把握久期与债券价格波动之间的关系，根据未来利率变化预期，以久期和收益率变化评估为核心，严格控制组合的目标久期。根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。通过久期控制，合理配置债券类别和品种。



#### E、风险可控策略

根据公司的投资管理流程和基金合同，结合对市场环境的判断，设定基金投资的各项比例控制，确保基金投资满足合规性要求；同时借助有效的数量分析工具，对基金投资进行风险预算，使基金投资更好地完成投资目标，规避潜在风险。

#### F、现金流管理策略

统计和预测市场交易数据和基金未来现金流，并在投资组合配置中考虑这些因素，使投资组合具有充分的流动性，满足未来基金运作的要求。本基金的流动性管理主要体现在申购赎回资金管理、交易金额控制和修正久期控制三个方面。

#### G、对冲性策略

利用金融市场的非有效性和趋势特征，采用息差交易、价差交易等方式，在不占用过多资金的情况下获得息差收益和价差收益，改善基金资产的风险收益属性，获取更高的潜在收益。息差交易通过判断不同期限债券间收益率差扩大或缩小的趋势，在未来某一时点将这两只债券进行置换，从而获取利息差额；买入较低价格的资产，卖出较高价格的资产，赚取中间的价差收益。

### 2、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

### 3、资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券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。本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于这类金融工具。在具体品种和分支的选择上，本基金主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券各个分支的风险与收益状况进行评估，根据基金投资组合管理的目标选择合适的分支进行投资。

### 4、新股申购投资策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差。在我国证券市场上，新股申购是一种风险较低的投资方式。本基金将研究股票首次发行（IPO）股票及增发新股的上市公司基本面因素，根据股票市场整



体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

## 5、股票投资策略

本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的个股选择策略。在“自上而下”的分析中，本基金将在经济运行周期的分析框架下，通过国家分析和行业分析进行深度的研究和预测，具体包括长期和短期的国家经济周期、行业特征、行业运行趋势、行业周期、产业政策等多因素的分析 and 预测，确定各经济变量和其他影响因素的变动对各行业的潜在影响，寻找出最具投资价值的行业。基于行业的分析选取，再对其中具有竞争力的上市公司进行投资。在“自下而上”的分析中，本基金将在相对投资价值和投资时机分析的基础上，挑选具有投资价值和潜力的上市公司。具体包括：长信品质分析模型、估值模型和风险收益分析三个方面。

(1) 长信基金的品质评估模型包括：财务品质评估、经营品质评估，从多个角度的对上市公司的情况进行分析和评估。在财务品质评估中，分析的因素包括：盈利能力、成长能力、股本扩张能力、现金流量、营运能力、财务预警；在经营品质评估中，分析的因素包括：经营环境、公司竞争力、管理能力、公司治理结构。

(2) 估值分析；个股的估值主要是利用绝对估值和相对估值的方法，寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里我们主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折现模型，Franchise P/E 模型等针对不同类型的产业和个股进行估值分析，另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响，排除通胀的影响因素。

(3) 风险因素分析；风险因素分析主要是对个股的风险暴露程度进行多因素分析，该分析主要从两个角度进行，一个是利用个股本身特有的信息进行分析。另一个是利用对风险的影响因素，利用线性回归模型对风险因素进行敏感性分析。

## 6、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资；首先综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，对权证的合理价值做出判断；其次基于权证的价值分析以及对权证标的股票未来走势的预期，对权证进行单向投资；最后基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资。

## (五) 业绩比较基准





本基金为债券型投资基金，债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，同时由于基金可能因申购新股、可转债转股以及二级市场购股等可能持少量股票，故此本基金的比较基准为：

$$\text{中证全债指数} * 90\% + \text{中证 800 指数} \times 10\%$$

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势；中证 800 指数能综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况和股票市场走势；二者综合构成的复合业绩比较基准能够客观的反映基金投资组合的状况。如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

## （六）风险收益特征

本基金为债券型基金，其风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

## （七）投资决策依据

- 1、国家有关法律法规和本《基金合同》的有关规定；
- 2、宏观经济形势及前景、有关政策趋向对证券市场的影响等；
- 3、国家财政政策、货币政策、产业政策，以及利率走势、通货膨胀预期等；
- 4、股票、债券、衍生产品等类别资产的预期收益率及风险水平。

## （八）投资决策流程

- 1、研究发展部向投资决策委员会和基金管理小组提交有关宏观经济分析、投资策略、债券分析等各类研究报告和投资建议，为投资运作提供决策支持；
- 2、投资决策委员会对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等因素进行综合分析，制定本基金投资组合的资产配置比例等重大决策；
- 3、基金管理小组根据研究团队的报告和对市场的判断，在遵守投资决策委员会制定的投资原则的前提下，向投资决策委员会提交基金的投资策略和资产配置建议；
- 4、投资决策委员会在认真分析研究团队所提供的研究报告和基金管理小组的投资策略草案后，确定公司所管理的基金资产的投资战略、投资方向，形成决策，并以投资决议形式下达给基金管理小组执行；





5、基金管理小组根据投资决策委员会的投资决策，结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分析判断以及每日基金申购和赎回的净现金流量和市场整体情况、投资组合和个股的流动性变化，在授权范围内制订具体的投资组合及操作方案，交由交易管理部执行；

6、交易管理部主要是根据基金经理的投资指令，进行基金资产的日常交易活动，对交易情况及时反馈，并对投资指令进行监督，遇有异常情况要及时向投资总监反映；同时对投资指令合规性检查；

7、金融工程部的风险与业绩评估人员定期对基金投资组合进行业绩和风险评估，提供基金业绩评估报告，提出风险控制意见，作为投资决策委员会调整风险控制策略和评估投资业绩的参考；

8、监察稽核部负责监督整个投资交易全过程是否有违反国家相关法律、法规和公司章程制度的规定，检查有无涉嫌内幕交易、侵犯基金份额持有人权益的行为，并考察所有参与基金投资全过程管理及业务人员的职业操守；

9、基金管理小组对整体投资组合及资金运用进行日常跟踪、分析，并根据市场变化、实际交易情况及研究发展部的追踪研究，在其权限范围内及时调整投资组合；

10、基金管理小组在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

### （九）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- （2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
- （3）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
- （4）本基金参与股票发行申购，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；
- （5）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；
- （6）本基金投资股权分置改革中产生的权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于



其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

(7) 本基金投资资产支持证券的，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%；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，不得超过该基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

(8) 本基金投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的20%；

(9) 本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%；

(10) 本基金投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的20%；

(11) 本基金投资于同一公司发行的企业债券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(12) 本基金投资于可转换债券的比例不高于基金资产总值的20%；

(13) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

(14) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述（1）-（3）项以及（5）-（12）项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

如法律法规或监管机构取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## （十）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 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、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

### **（十一）基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法**

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利和债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

### **（十二）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、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### （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

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

### （四）基金财产的保管和处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。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入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

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消；不同基金财产的债权债务，不得相互抵消。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。



## 十一、基金资产的估值

### （一）估值目的

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

### （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、其它投资等资产和负债。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法

（1）上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

（2）未上市股票的估值：

①首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，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送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

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，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

④非公开发行有明确锁定期的股票，锁定期内按下列方式估值：

估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交



易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，按照下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(DI-Dr)/DI$$

其中；FV 为估值日该非公开发行股票的价值；

C 为该股票的初始取得成本；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

DI 为该股票锁定期所含的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(5) 在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。

(6) 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。

(7) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值办法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，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) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

## (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面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签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。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。

## （六）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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，差错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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，则差错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差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；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、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：



① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，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，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

### **（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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### **（八）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工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。



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）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项、权证估值方法的第（4）项、股票指数期货合约估值方法的第（2）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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。



## 十二、基金收益与分配

### （一）收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金投资者自行承担；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当期收益应先弥补上期累计亏损后，才可进行收益分配；
- 6、在符合基金分红条件的前提下，本基金每年收益至少分配 1 次，最多分配 12 次，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的 50%；
- 7、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

### （四）收益分配方案



基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### **（五）收益分配的时间和程序**

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

2、在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

### **（六）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基金份额。



## 十三、基金费用与税收

### (一) 与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用包括：

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 销售服务费；
- (4) 基金合同生效后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (9) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年管理费率为 } 0.7\%$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### (2) 基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{ 本基金年托管费率为 } 0.2\%$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值





基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### （3）销售服务费

本基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，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。

销售服务费按前一日基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为基金份额每日应计提的销售服务费

E 为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。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

4、上述（一）中 4 到 9 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### 5、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

6、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

#### 7、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。



## 十四、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别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书面确认。

### （二）基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应当在更换会计师事务所后的2日内公告。



## 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全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证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份额销售机构；
- 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、招募说明书、基金合同、托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在网站上。



(1) 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。本基金合同生效后，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体和基金管理人网站上；基金管理人在公告的 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。

(2) 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事项的法律文件。

(3) 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。

## 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体和基金管理人网站上。

## 3、基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载基金合同生效公告。

## 4、基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定媒体及基金管理人网站上公告。

## 5、基金资产净值、基金份额净值公告

本基金合同生效后，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、申购赎回代理机构以及其他媒介，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体和基金管理人网站上。

## 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体和基金管理人网站上。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体和基金管理人网站上。

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体和基金管理人网站上。

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。

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和书面报告两种方式。

#### 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 50%；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；



- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 基金变更、增加或减少销售代理机构；
- (20) 基金更换登记结算机构；
- (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) 本基金暂停接受申购、赎回申请；
- (24) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请；
- (25) 基金推出新业务或服务；
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

## 8、澄清公告

在本基金合同存续期限内，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。

## 9、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。

## 10、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报刊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体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### **（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、基金托管人和基金份额发售机构的住所，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。

投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。





## 十六、风险揭示

### （一）投资于长信利丰债券型证券投资基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

##### （5）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金财产损失。

#### 3、债券收益率曲线变动风险。

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

#### 4、再投资风险



再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

### 5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的基金投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

### 6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

### 7、操作或技术风险

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

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

### 8、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

### 9、本基金的特定风险

本基金为债券型基金，面临的主要风险为利率风险、流动性风险、信用风险。基金管理小组着重加强对上述三大风险的管理。对于利率风险，主要在研究国家的宏观经济、市场资金需求状况的基础上加强对利率走势的预测，根据利率的走势，分析所持券种的久期、凸性，从而调整控制组合的利率风险；对于流动性风险，根据所持债券资产的流动性和资金流动性的需求，分析基金持有人的特点和市场券种的类别，灵活配置所持债券，使券种的收益与基金所需的资金流动性相匹配，在控制风险的前提下，增加收益；对信用风险，基金管理小组利用外部信用评级的基础上，控制信用等级、投资比例限制，并加强对特定交易对手的信用分析，从而避免因信用风险给基金带来的损失。



## 10、人才流失风险

公司主要业务人员的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响。

## 11、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## （二）声明

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。



## 十七、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意：

- （1）终止基金合同；
- （2）转换基金运作方式；
- （3）变更基金类别；
- （4）变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- （5）变更基金份额持有人大会议事程序；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准、提高销售服务费用标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- （8）本基金与其他基金的合并；
- （9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- （10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费、销售服务费、其他应由基金承担的费用；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；
- （3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案，并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体和基金管理人网站公告。



## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的；
- 4、基金合并；
- 5、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、基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2、基金财产清算程序

- （1）基金合同终止时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估价和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将基金清算结果报告中国证监会；
- （8）公布基金清算报告；
- （9）对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

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



4、基金财产按照下列顺序清偿：

- (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）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

6、基金财产的清算期限

基金财产的清算期限为6个月。

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。



## 十八、基金合同的内容摘要

### (一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利与义务

##### (1) 基金管理人的权利

1) 自本基金合同生效之日起, 依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;

2) 获得基金管理人报酬;

3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

4) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下, 制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则, 决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式;

5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人, 对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构, 并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益;

6) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;

7) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构, 并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

8) 选择、更换代销机构, 并依据销售代理协议和有关法律法规, 对其行为进行必要的监督和检查;

9) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

10) 依法召集基金份额持有人大会;

11) 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;

12) 根据国家有关规定, 在法律法规允许的前提下, 以基金的名义依法为基金融资、融券;

13) 法律法规规定的其他权利。

##### (2) 基金管理人的义务





- 1) 依法募集基金，办理或者委托经由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、勤勉尽责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财产分别管理，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) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- 13) 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；
- 14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- 15) 按照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收益；
- 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) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 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) 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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- 23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 24) 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；
- 25) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 26) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；
- 27) 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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 28) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

## 2、基金托管人的权利与义务

### (1) 基金托管人的权利

- 1) 获得基金托管费；
- 2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金财产；
- 4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- 5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；
- 6) 依法召集基金份额持有人大会；
- 7) 按规定取得基金份额持有人名册；
- 8) 法律法规规定的其他权利。

### (2) 基金托管人的义务

- 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，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; 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 独立核算, 分账管理, 保证不同基金之间在名册登记、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;

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应予保密, 不得向他人泄露;

8) 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;

9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年;

10) 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;

11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;

13) 按照规定监督基金管理人的投资运作;

14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

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

18) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务, 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;

19) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册;

20) 参加基金财产清算组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;



- 21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；
- 22) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 23) 法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利和义务

基金投资者购买或通过其他合法方式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、招募说明书取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (1) 基金份额持有人的权利

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- 3) 依法转让或者申请、赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### (2) 基金份额持有人的义务

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；



7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 2、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) 终止基金合同；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- 5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准、提高销售服务费用标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，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、销售服务费、其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式；
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(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（以上含本数，下同）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，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(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。

#### 4、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（以下简称“召集人”），召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒体和基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 6) 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；





- 7) 表决方式;
- 8) 会务常设联系人姓名、电话;
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。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，不影响计票和表决结果。

## 5、基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

- 1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。
- 3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①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，全部有效凭证所对应的基金份额已占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

②亲自出席会议者持有基金份额持有人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及授权委托书等文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

#### 2) 通讯开会方式





在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后，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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，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；

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

## 6、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容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。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

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

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。

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

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表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。

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）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

## (3) 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。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序



(1) 基金份额持有人所持每一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) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上(含 50%) 通过方为有效，除下 2) 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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议方式通过，基金合同另有规定的除外。

(3) 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。

(4) 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，否则表面符合法律法规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。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

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



3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对投票数进行重新清点;如会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## **(2) 通讯方式开会**

在通讯方式开会的情况下,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(如果基金托管人为召集人,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不派代表监督计票的,不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人,由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

## **9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式**

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,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,并在生效后方可执行。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

(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。

## **(三) 基金合同的变更与终止**

### **1、基金合同的变更**

(1) 下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意:

- 1) 终止基金合同;
- 2) 转换基金运作方式;
- 3) 变更基金类别;
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;



- 5) 变更基金份额持有人大会议事程序;
- 6) 更换基金管理人、基金托管人;
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准、提高销售服务费用标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
- 8) 本基金与其他基金的合并;
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响, 需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时, 可不经基金份额持有人大会决议, 由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同, 并报中国证监会备案:

- 1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费、其他应由基金承担的费用;
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、赎回费率或变更收费方式;
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- 4) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- 6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案, 并经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

## 2、基金合同的终止

有下列情形之一的, 本基金合同经中国证监会核准后将终止:

- (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) 基金合并;
- (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) 基金合同终止, 应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。



## (2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

## (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行评估和变现；
- 4) 基金清算组作出清算报告；
- 5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 8) 公布基金清算公告；
- 9) 对基金剩余财产进行分配。

## (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

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 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) - 3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## (6) 基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算





小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告

#### **(7) 基金财产的清算期限**

基金财产的清算期限为 6 个月。

#### **(8) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。**

### **(四) 争议的解决**

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

3、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。

### **(五) 基金合同存放地和基金投资者取得基金合同的方式**

基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。





## 十九、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议的当事人

#### 1、基金管理人

名称：长信基金管理有限责任公司

住所：上海市黄浦区汉口路 130 号 3-4 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼

邮政编码：200120

法定代表人：田丹

成立时间：2003 年 4 月 28 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【2003】63 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：中国农业银行

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

邮政编码：100036

法定代表人：项俊波

成立时间：1979 年 2 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：国发（1979）056 号

组织形式：国有独资

注册资金：361 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价



证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；证券投资基金托管；社保基金托管；企业年金托管；委托资产托管；信托资产托管；基本养老保险个人账户基金托管；农村社会保障基金托管；投资连接保险产品的托管；收支账户的托管；合格境外机构投资者（QFII）境内证券投资托管。

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金的配置比例为投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的 20%；投资于股票等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%；现金或者到期日在一年以内的政府债券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它品种，或对金融工具可投资比例作出新的规定，基金管理人在征得有关监管机构许可后，可以将其纳入投资范围并及时公告，不需召开基金份额持有人大会。

（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，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

- 1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- 2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
- 3) 进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的



40%;

4) 本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;

5) 本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制, 若相关法律法规有所修改, 本基金权证投资比例限制自动按相关法律法规进行修订, 不受下述条款限制: (a) 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 5%; (b) 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%, (c) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;

6) 本基金投资资产支持证券目前遵循下述投资比例限制, 若相关法律法规有所修改, 本基金资产支持证券投资比例限制自动按相关法律法规进行修订, 不受下述条款限制: (a) 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%; (b) 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, 不得超过该基金资产净值的 10%; (c) 本基金管理人管理的全部证券投资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%; (d) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过该基金资产净值的 20%;

7) 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, 以备支付基金份额持有人的赎回款项;

8) 本基金投资于股票等权益类品种的比例不高于基金资产的 20%;

9) 本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%;

10) 本基金投资于公司债、企业债、短期融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的 20%;

11) 本基金投资于同一公司发行的企业债券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;

12) 本基金投资于可转换债券的比例不高于基金资产总值的 20%;

13) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

14) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的, 从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、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 1-3 项以及 5-12 项规定的投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的, 从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合



同的有关约定。

上述投资组合限制条款中，若属法律法规的强制性规定，则当法律法规或监管部门取消上述限制，本基金自上述限制被取消之日起，不再受上述限制约束。

(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，对本协议第十五条第九项基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

(4) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应向基金托管人说明理由，在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人负责对交易对手的资信控制和交易方式进行控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。因交易对手不履行合同造成的基金财产的损失，基金托管人不承担责任并向中国证监会报告。

(5) 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。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

(6) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。



(7) 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事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(8) 基金托管人发现基金管理人存在重大违法、违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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。

## 2、基金管理人对基金托管人的业务监督和核查

(1) 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(2) 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、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、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人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。

(3) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，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。

## (三) 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。如果基金财产（包括实物证券）在基金托管人保管期间的损坏、灭失的，应由该基金托管人承担赔偿责任。

(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，确保基金财产的完整与独立。

(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照法律法规、基金合同和本协议的约定保管基金财产。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

(7) 除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## 2、基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 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等事宜，基金托管人应提供充分协助。

## 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

(2) 基金资金账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办



理基金资产的支付。

#### 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 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或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。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(5) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有。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。托管人对托管人以外机构实际有效控制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

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。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由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外，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。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### （四）基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值的计算

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计算日基金总份额后的价值。基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

每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、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，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。

本基金按以下方法估值：

##### （1）股票估值方法：

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 未上市股票的估值。

①首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发等方式发行的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

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，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

④非公开发行有明确锁定期的股票，锁定期内按下列方式估值：



估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，按照下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(DI-Dr)/DI$$

其中；FV 为估值日该非公开发行股票的价值；

C 为该股票的初始取得成本；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

DI 为该股票锁定期所含的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1)－2) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1)－2) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## (2) 债券估值办法：

1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。



4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

5) 在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。

6) 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。

7) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) — 6) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1) — 6) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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。

8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### **(3) 权证估值方法：**

1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 首次发行未上市的权证，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) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### **(4) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。**

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。



### 3、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按股票估值方法的第 3) 项、债券估值方法的第 7) 项、权证估值方法的第 4) 项、股票指数期货合约估值方法的第 2) 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

### 2、净值差错处理

(1) 当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.50% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，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，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%。

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），基金托管人在采取必要的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 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。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

### 3、基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### (五) 基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的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、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

注册登记机构应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 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。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，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。

#### (六) 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。

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。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## **（七）基金托管协议的变更与终止**

### **1、基金托管协议的变更**

本协议相关各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核准后生效。

### **2、基金托管协议的终止**

- （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财产；
- （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。





## 二十、其他应披露事项

暂无。





## 二十一、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）持有人交易资料的寄送服务

每次交易结束后，基金投资者应该在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；每半年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向本半年度末所有持有本基金基金份额的基金投资者，或在本半年度有交易、半年度末基金份额余额为零的基金投资者寄送交易对账单。

### （二）红利再投资

本基金收益分配时，经基金投资者选择，基金管理人将为基金投资者提供红利再投资服务，其分红资金按除息日的基金份额净值自动转成相应的基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时选择更改基金分红方式。

### （三）网上交易服务

基金投资者除可通过销售机构和基金管理人的直销网点办理申购、赎回及信息查询外，还可通过基金管理人的网站（www.cxfund.com.cn）享受网上交易服务。具体业务规则详见基金管理人的网站说明。

### （四）定期定额投资计划

通过定期定额投资计划，基金投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则和开放时间另行公告。

### （五）信息定制服务

基金投资者可以通过基金管理人的网站、客户服务中心提交信息定制申请。可定制的信息包括：每日基金份额净值、每笔交易确认、最近季度的基金投资组合、公司最新公告、新产品信息等。基金管理公司通过 E-MAIL、手机短信、传真等定期为客户发送所定制的信息。业务开通的时间由基金管理人另行公告。

### （六）网络在线服务

客户通过基金账户号和查询密码登录基金管理人的网站“客户服务”栏目，可享有



账户查询、信息定制、资料修改、投资刊物查阅、在线咨询等多项在线服务。

### **（七）客户服务中心电话服务**

客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

客户服务中心人工座席提供每周 5 天的座席服务,基金投资者可以通过该热线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

### **（八）客户投诉受理服务**

基金投资者可以通过各销售机构网点柜台,基金管理人的网站投诉栏目,自动语音留言栏目,客户服务中心人工热线、书信、电子邮件等 6 种不同的渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务以及基金管理人的政策规定进行投诉或建议。

### **（九）基金管理人客户服务联络方式**

客户服务热线: 4007005566

传真: 021-61009800

公司网址: <http://www.cxfund.com.cn>

电子信箱: [service@cxfund.com.cn](mailto:service@cxfund.com.cn)



## 二十二、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所，基金投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。



## 二十三、备查文件

本基金备查文件包括：

- （一）中国证监会批准长信利丰债券型证券投资基金募集的文件；
- （二）《长信利丰债券型证券投资基金基金合同》；
- （三）《长信利丰债券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）基金销售代理人业务资格批件和营业执照；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

长信基金管理有限责任公司

2008年11月29日