

# 长城久盈纯债分级债券型证券投资基金 基金合同

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一八年三月

## 目 录

第一部分	前言.....	1
第二部分	释义.....	3
第三部分	基金的基本情况.....	9
第四部分	基金份额的分级.....	10
第五部分	基金份额折算.....	15
第六部分	基金份额的发售.....	17
第七部分	基金备案.....	19
第八部分	基金份额的申购与赎回.....	20
第九部分	基金的过渡期.....	28
第十部分	基金合同当事人及权利义务.....	32
第十一部分	基金份额持有人大会.....	39
第十二部分	基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	47
第十三部分	基金的托管.....	50
第十四部分	基金份额的登记.....	51
第十五部分	基金的投资.....	53
第十六部分	基金的财产.....	59
第十七部分	基金资产估值.....	60
第十八部分	基金费用与税收.....	65
第十九部分	基金的收益与分配.....	68
第二十部分	基金的会计与审计.....	69
第二十一部分	基金的信息披露.....	70
第二十二部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	76
第二十三部分	违约责任.....	78
第二十四部分	争议的处理和适用的法律.....	79
第二十五部分	基金合同的效力.....	80
第二十六部分	其他事项.....	81
第二十七部分	基金合同内容摘要.....	82

## 第一部分 前言

### 一、订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。

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

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《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。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

三、证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。

中国证监会对本基金募集的注册，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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息，其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的，如与基金合同有冲突，以基金合同为准。

五、本基金按照中国法律法规成立并运作，若基金合同的内容与届时有效的

法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

## 第二部分 释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指长城久盈纯债分级债券型证券投资基金
- 2、基金管理人：指长城基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《长城久盈纯债分级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：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长城久盈纯债分级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《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《长城久盈纯债分级债券型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 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，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 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》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《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

- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 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：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 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
- 20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
- 21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
- 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。
- 23、销售机构：指长城基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
- 24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
- 25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为长城基金管理有限公司或接受长城基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构
- 26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
- 27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机

构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日，在分级运作期内，本基金的开放日包括赎回开放日和申购开放日

36、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

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

38、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

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

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

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

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

43、巨额赎回：指在基金合同生效后每个分级运作期内，在久盈 A 的单个开放期，久盈 A 份额的净赎回申请（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）超过上一日久盈 A 的基金总份额的 10% 时的情形

44、元：指人民币元

45、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

46、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

47、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

48、基金份额参考净值：在基金合同生效后每个分级运作期内，如果估值日（T 日）为非久盈 A 的开放日且非基金合同生效后分级运作期届满日，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则，即假定该日为本基金在久盈 B 封闭期内的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值

49、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

50、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

51、基金份额分级：在基金合同生效后每个分级运作期内，本基金的基金份额分为久盈 A、久盈 B 两级份额，两者的份额配比原则上不超过 7:3

52、基金分级运作期：指基金采取分级运作的期间，本基金的第一个分级运作期为自基金合同生效之日起至 2 年后对应日止，如该对应日为非工作日，则分级运作期到期日为该日前的最后一个工作日。本基金第一个分级运作期后的各分级运作期自本基金公告的分级运作期起始日起至 2 年后对应日止，如该对应日为非工作日，则分级运作期到期日为该日前的最后一个工作日。本基金每个分级运作期结束后转入下一分级运作期，下一分级运作期的起讫日期以本基金管理人届时公告为准



53、久盈 A：长城久盈纯债分级债券型证券投资基金之久盈 A 份额。在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 A 根据基金合同的规定获得预期收益，并在基金合同生效后每个分级运作期内每满 6 个月开放一次，接受申购与赎回，但第 4 个开放期开放一天，只接受赎回，不接受申购，赎回开放日为分级运作期届满日前一个工作日

54、久盈 B：长城久盈纯债分级债券型证券投资基金之久盈 B 份额。在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 B 封闭运作，封闭期为 2 年，不上市交易。本基金在扣除久盈 A 的本金与应计收益后的全部剩余资产归久盈 B 享有，亏损以久盈 B 的资产净值为限由久盈 B 承担

55、久盈 A 的开放期：指自每个分级运作期起始日起每满 6 个月的对应日（如该对应日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）及其前一个工作日，其中第一个工作日为赎回开放日，第二个工作日为申购开放日，但第 4 个开放期开放一天，只接受赎回，不接受申购，赎回开放日为分级运作期届满日前一个工作日

56、久盈 B 的封闭期：指自每个分级运作期起始日起至 2 年后的对应日止（如 2013 年 6 月 24 日的 2 年后的对应日应为 2015 年的 6 月 24 日）。若该对应日为非工作日，则封闭期届满日为该日之前的最后一个工作日

57、分级运作期起始日：第一个分级运作期起始日为基金合同生效日，其后分级运作期起始日以基金管理人公告为准

58、分级运作期届满日：指自每个分级运作期起始日起 2 年后的对应日（如 2013 年 6 月 24 日的 2 年后的对应日应为 2015 年的 6 月 24 日）。如该对应日为非工作日，则该分级运作期届满日为该日之前的最后一个工作日。基金合同生效后每个分级运作期届满日与久盈 B 的封闭期届满日相同

59、久盈 A 的基金份额折算：指自每个分级运作期起始日起每满 6 个月的最后一个工作日，将久盈 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，其基金份额数按折算比例相应增加或减少的行为。久盈 A 的前 3 个基金份额折算日与申购开放日为同个工作日，久盈 A 的第 4 个基金份额折算日为分级运作期届满日

60、久盈 B 的基金份额折算：指每个分级运作期届满日，将久盈 B 的基金份额净值调整为 1.000 元，其基金份额数按折算比例相应增加或减少的行为

61、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）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、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

62、摆动定价机制：指当久盈 A/久盈 B 遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

63、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

64、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 第三部分 基金的基本情况

#### 一、基金名称

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金。

#### 二、基金的类别

债券型证券投资基金。

#### 三、基金的运作方式

契约型。

本基金的分级运作期为 2 年，按运作期滚动的方式运作。

在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 A 每满 6 个月开放一次，接受申购与赎回（第 4 个开放期只接受赎回，不接受申购），久盈 B 封闭运作，不上市交易，久盈 A 和久盈 B 的基金资产合并运作。

每个分级运作期届满后，本基金将安排不超过 10 个工作日的过渡期，基金管理人在过渡期内办理份额折算确认、久盈 B 的申购、赎回以及久盈 A 的申购等事宜。在每个分级运作期届满 10 个工作日前，基金管理人将公告本基金当前运作期结束后的过渡期安排及相关事宜。

#### 四、基金份额分级

在基金合同生效后每个分级运作期内，本基金通过基金收益分配的安排，将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别，即久盈 A 份额和久盈 B 份额，两级份额的配比原则上不超过 7:3。

有关本基金基金份额分级的规定详见本基金合同第四部分。

#### 五、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 六、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

#### 七、基金份额面值 and 认购费用

本基金基金份额（包括久盈 A、久盈 B）发售面值为人民币 1.000 元。

本基金认购费率最高不超过 5%，具体费率按招募说明书的规定执行。

#### 八、基金存续期限

不定期

## 第四部分 基金份额的分级

### 一、基金份额的分级

本基金的每个分级运作期为 2 年。在基金合同生效后每个分级运作期内，根据运作方式和风险收益特征的不同，本基金的基金份额分为久盈 A、久盈 B 两级份额，久盈 A 和久盈 B 的基金资产合并运作；在本基金合同生效之日，久盈 A、久盈 B 的份额配比原则上不超过 7:3。

在久盈 A 的单个开放期，如果久盈 A 没有赎回或者净赎回份额极小，久盈 A、久盈 B 在该次开放期后的份额配比可能会出现大于 7:3 的情形；如果久盈 A 的净赎回份额较多，久盈 A、久盈 B 在该次开放期后的份额配比可能会出现小于 7:3 的情形。

### 二、基金份额的运作

#### 1、久盈 A、久盈 B 运作方式

在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 A 在每个分级运作期起始日起每满 6 个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。开放期为每个分级运作期起始日起每满 6 个月的对应日（如该对应日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）及其前一个工作日，其中第一个工作日为赎回开放日，第二个工作日为申购开放日，但第 4 个开放期开放一天，只接受赎回，不接受申购，赎回开放日为分级运作期届满日前一个工作日。在久盈 A 的折算基准日，基金管理人将对久盈 A 份额进行基金份额折算，久盈 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的久盈 A 份额数按折算比例相应增减。久盈 B 封闭运作，不上市交易。久盈 B 的封闭期为每个分级运作期起始日起至 2 年后对应日止，若该对应日为非工作日，则封闭期届满日为该日之前的最后一个工作日。

本基金每个分级运作期结束后转入下一分级运作期，下一分级运作期的起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

#### 2、基金份额配比与规模控制

基金合同生效后每个分级运作期，久盈 A、久盈 B 的份额分开募集、资产合并运作，本基金合同生效之日，久盈 A、久盈 B 的份额配比原则上不超过 7:3。具体规模控制及其控制措施见招募说明书、发售公告以及基金管理人在指定媒体

上发布的其他相关公告。

### 三、久盈 A、久盈 B 基金份额收益划分规则

在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 A 根据基金合同的规定获取约定收益，其收益率将在每个申购开放日设定一次并公告。计算公式为：

久盈 A 的年收益率（单利）=1 年期银行定期存款利率（税后）+利差。久盈 A 的年收益率采用四舍五入法保留到以百分比表示的小数点后第 2 位。

1 年期银行定期存款利率（税后）是指在基金合同生效日当日，中国人民银行公布并执行的、该日适用的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率；在久盈 A 的每个申购开放日，基金管理人将根据中国人民银行公布并执行的、该日适用的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定下 6 个月内适用的久盈 A 的年化约定收益率，并于次日执行新的约定收益率。视国内利率市场变化，基金管理人在基金合同生效日前或久盈 A 的申购开放日前公告下 6 个月久盈 A 适用的约定收益的利差值。利差的取值范围从 0%（含）到 3%（含）。

在基金合同生效后每个分级运作期内，本基金的净资产将优先支付久盈 A 的本金及应计收益，在扣除久盈 A 的本金和应计收益后的全部剩余资产归久盈 B 享有；如果本基金的净资产等于或低于久盈 A 的本金及其约定应得收益的总额，则本基金净资产全部分配予久盈 A 后，仍存在额外未弥补的久盈 A 本金及约定收益总和的差额，则不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证久盈 B 的封闭期满时久盈 A 份额持有人的约定应得收益，即如果在久盈 B 的封闭期末本基金资产出现极端损失的情况下，久盈 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金损失的风险。

### 四、基金份额发售

在基金募集期内，久盈 A、久盈 B 将分别通过各自销售机构的销售网点独立进行公开发售。

### 五、本基金的基金份额净值计算

本基金的基金份额净值计算公式如下：

$T$  日基金份额净值= $T$  日闭市后的基金资产净值/ $T$  日基金份额的余额数量

在基金合同生效后每个分级运作期内， $T$  日基金份额的余额数量为久盈 A 和久盈 B 的份额总额。

本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

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。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 六、在每个分级运作期内，久盈 A 和久盈 B 基金份额净值的计算

按照前述本基金资产及收益划分规则，在久盈 A 的申购开放日计算久盈 A 的基金份额净值；在分级运作期届满日，对久盈 A 与久盈 B 单独进行基金份额净值计算。

假设  $NV$  为申购开放日或分级运作期届满日（即 T 日，以下简称该日）本基金资产净值， $E_a$  为该日久盈 A 的份额余额， $NAV_a$  为该日折算前久盈 A 的基金份额净值， $E_b$  为该日久盈 B 的份额余额， $NAV_b$  为该日折算前久盈 B 的基金份额净值， $NAV_{a\text{设定}}$  为该日久盈 A 的基金份额在上一个申购开放日份额净值（折算为 1.000 元）的基础上按照年化单利  $r_i$  增长计算而得的设定净值， $T_i$  为自第 i 个申购开放日以来的天数（不包括第 i 个申购开放日）， $r_i$  为第 i 个申购开放日设定并于次日执行的、下一个半年内适用的、久盈 A 的年化约定收益率，则：

$$NAV_{a\text{设定}} = 1.000 \times \left( 1 + \frac{T_i}{\text{运作当年实际天数}} \times r_i \right)$$

申购开放日或分级运作期届满日，折算前久盈 A 和久盈 B 基金份额净值的计算公式如下：

1、若  $NV \leq E_a \times NAV_{a\text{设定}}$ ，则该日折算前久盈 A 和久盈 B 的基金份额净值为：

$$NAV_a = NV / E_a ;$$

$$NAV_b = 0 ;$$

2、若  $NV > E_a \times NAV_{a\text{设定}}$ ，则该日折算前久盈 A 和久盈 B 的基金份额净值为：

$$NAV_a = NAV_{a\text{设定}} ;$$

$$NAV_b = (NV - NAV_a \times E_a) / E_b ;$$

久盈 A、久盈 B 的基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后

第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

七、在每个分级运作期内，久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值的计算

在每个分级运作期内，如果估值日（T 日）为非久盈 A 的申购开放日且非分级运作期届满日，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则，即假定该日为本基金在久盈 B 封闭期内的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

久盈 A 和久盈 B 基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内与本基金基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

当估值日（即 T 日，以下简称该日）为非久盈 A 申购开放日，也非分级运作期届满日， $NV_t$  为该日基金资产净值， $NAV_{a,t}$  为该日久盈 A 的基金份额参考净值， $E_a$  为该日久盈 A 的份额余额， $NAV_{b,t}$  为该日久盈 B 的基金份额参考净值， $E_b$  为该日久盈 B 的份额余额， $NAV_{a\text{设定}}$  为该日久盈 A 的基金份额在上一个申购开放日份额净值（折算为 1.000 元）的基础上按照设定的年化单利  $r_i$  增长计算而得的设定净值； $T_i$  为自第 i 个申购开放日以来的天数（不包括第 i 个申购开放日），运作当年实际天数是指久盈 A 上一次申购开放日（如 T 日之前久盈 A 尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数， $r_i$  为第 i 个申购开放日设定并于次日执行的、下一个半年内适用的、久盈 A 的年化约定收益率， $NAV_{a,i}$  为第 i 个申购开放日久盈 A 的基金份额参考净值，则：

$$NAV_{a\text{设定}} = 1.000 \times \left( 1 + \frac{T_i}{\text{运作当年实际天数}} \times r_i \right)$$

基金份额参考净值日（即 T 日），久盈 A 和久盈 B 基金份额参考净值的计算公式如下：

1、若  $NV_t \leq NAV_{a\text{设定}} \times E_a$ ，则 T 日折算前久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值为：

$$NAV_{a,t} = NV_t / E_a ;$$

$$NAV_{b,t} = 0 ;$$

2、若  $NV_t > NAV_{a\text{设定}} \times E_a$ ，则 T 日久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值为：

$$NAV_{a,t} = NAV_{a\text{设定}} ;$$

$$NAV_{b,t} = (NV_t - NAV_a \times E_a) / E_b ;$$

久盈 A、久盈 B 的基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。



## 第五部分 基金份额折算

在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 A、久盈 B 将按以下规则进行基金份额折算。

### 一、久盈 A 的基金份额折算

#### 1、折算日

在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 A 的折算基准日为分级运作期起始日起每满 6 个月的最后一个工作日。久盈 A 的前 3 个基金份额折算日与申购开放日为同一天工作日，久盈 A 的第 4 个基金份额折算日为分级运作期届满日。

#### 2、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的久盈 A 所有份额。

#### 3、折算频率

在每个分级运作期内每满 6 个月折算一次。

#### 4、折算方式

折算日日终，久盈 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的久盈 A 的份额数按照折算比例相应增减。

久盈 A 的基金份额折算公式如下：

久盈 A 的折算比例 = 折算日折算前久盈 A 的基金份额净值 / 1.000

久盈 A 经折算后的份额数 = 折算前久盈 A 的份额数 × 久盈 A 的折算比例  
久盈 A 经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后 2 位，小数点第 3 位及第 3 位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前久盈 A 的基金份额净值、久盈 A 的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

### 二、久盈 B 的基金份额折算

#### 1、折算日

在基金合同生效后每个分级运作期内，久盈 B 的基金份额折算日为分级运作期届满日。

#### 2、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的久盈 B 所有份额。

### 3、折算频率

在每个分级运作期内，久盈 B 在分级运作期届满日折算一次。

### 4、折算方式

折算日日终，久盈 B 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的久盈 B 的份额数按照折算比例相应增减。

久盈 B 的基金份额折算公式如下：

久盈 B 的折算比例 = 折算日折算前久盈 B 的基金份额净值 / 1.000

久盈 B 经折算后的份额数 = 折算前久盈 B 的份额数 × 久盈 B 的折算比例

久盈 B 份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后 2 位，小数点第 3 位及第 3 位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前久盈 B 的基金份额净值、久盈 B 的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

### 三、基金份额折算的公告

1、基金管理人须最迟于基金份额折算方案实施日前 2 日，在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告，并报中国证监会备案。

2、基金管理人应在基金份额折算结束后 2 日内，在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告，并报中国证监会备案。

## 第六部分 基金份额的发售

### 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

久盈 A、久盈 B 将分别通过各自销售机构的销售网点独立进行公开发售。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加销售机构的相关公告。

#### 3、发售对象

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

### 二、基金份额的认购

#### 1、认购费用

久盈 A 不收取认购费。久盈 B 的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。久盈 B 认购费用不列入基金财产。

#### 2、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

#### 3、基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

#### 4、认购份额余额的处理方式

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。

#### 5、认购申请的确认

基金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或基金管理人的确认结果为

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。

### 三、基金份额认购金额的限制

1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书。

3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书。

## 第七部分 基金备案

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于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,并在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。

基金募集达到基金备案条件的,自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起,《基金合同》生效;否则《基金合同》不生效。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。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。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满,未满足募集生效条件,基金管理人应当承担下列责任:

- 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。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于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并报送解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、分级运作期内久盈 A 的申购和赎回

#### 1、申购和赎回场所

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

#### 2、申购和赎回的开放期及时间

久盈 A 的开放期为自每个分级运作期起始日起每满 6 个月的对应日（如该对应日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）及其前一个工作日，其中第一个工作日为赎回开放日，第二个工作日为申购开放日，但第 4 个开放期开放一天，只接受赎回，不接受申购，赎回开放日为分级运作期届满日前一个工作日。

因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放久盈 A 的申购与赎回业务的，其开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日起继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。

久盈 A 的开放期以及开放办理申购与赎回业务的具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准。

投资人在久盈 A 的开放期办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放期的具体业务办理时间在招募说明书中载明。

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期及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 3、申购与赎回的原则

(1) 赎回按照“未知价”原则，即久盈 A 份额的赎回价格以久盈 A 的赎回开放日的基金份额净值为基准进行计算；申购按照“确认价”原则，即久盈 A 份额的申购价格以申购开放日折算后的基金份额净值 1.000 元为基准进行计算；

(2) “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

#### 4、申购与赎回的程序

##### (1) 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放期的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资人在提交久盈 A 申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交久盈 A 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。

##### (2) 申购和赎回的成立和生效

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

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

##### (3) 赎回款项的支付

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

##### (4) 申购和赎回申请的成交确认原则

对于久盈 A 份额的申购申请，如果对久盈 A 份额的全部有效申购申请进行

确认后，久盈 A 的份额余额小于或等于 7/3 倍久盈 B 的份额余额，则所有经确认有效的久盈 A 份额的申购申请全部予以成交确认；如果对久盈 A 份额的全部有效申购申请进行确认后，久盈 A 的份额余额大于 7/3 倍久盈 B 的份额余额，则在经确认后的久盈 A 份额余额不超过 7/3 倍久盈 B 的份额余额范围内，对全部有效申购申请按比例进行成交确认。

基金销售机构对久盈 A 申购和赎回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久盈 A 申购和赎回申请。久盈 A 申购和赎回申请的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

#### 5、申购和赎回的数量限制

(1) 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

(2) 基金管理人可以规定投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。

(3) 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。

(4) 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久盈 A 单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停久盈 A 申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

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

#### 6、申购和赎回的价格、费用及其用途

(1) 本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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。

(2) 申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招



募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(3) 赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》，赎回金额单位为元。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(4) 久盈 A 不收取申购、赎回费用。

(5) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(6) 当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

## 7、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

(1) 因不可抗力导致基金无法正常运转。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。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接受基金申购申请。

(3) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(4) 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。

(5) 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，基金管

理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请。

(6) 基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

(7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)、(2)、(3)、(6)、(7)项暂停申购情形时, 基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝, 被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 8、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时, 基金管理人可暂停接受投资人久盈 A 的赎回申请或延缓支付赎回款项:

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

(2) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

(3) 证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(4) 久盈 A 在开放期发生巨额赎回, 导致本基金的现金支付出现困难。

(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, 基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

(6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时, 基金管理人应在当日报中国证监会备案, 已确认的赎回申请, 基金管理人应足额支付; 如暂时不能足额支付, 应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人, 未支付部分可延期支付。若出现上述第(4)项所述情形, 按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时, 基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### 9、巨额赎回的情形及处理方式

(1) 巨额赎回的认定

若久盈 A 单个开放期内，久盈 A 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)超过上一日久盈 A 的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### (2) 巨额赎回的处理方式

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

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

2) 延缓支付赎回款项：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日久盈 A 的总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。

3) 在开放期内，若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一日久盈 A 基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理，该单个基金份额持有人的剩余赎回申请与其他份额持有人的赎回申请参照前述条款处理。所有延期的赎回申请延期处理，以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，直到全部赎回为止。久盈 A 的赎回开放期相应延长，延长的开放期内不办理申购（原定的久盈 A 申购开放日除外），亦不接受新的赎回申请，即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额 20% 以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。具体见相关公告。

### (3) 巨额赎回的公告

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

## 10、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(1) 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监

会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

(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) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周（含 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 个工作日在至少一家指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

(4) 如果发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少重复刊登暂停公告 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 个工作日在至少一家指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个工作日的基金份额净值。

## 二、过渡期内基金份额的申购与赎回

每个分级运作期届满后，本基金将安排不超过 10 个工作日的过渡期，基金管理人在过渡期内办理份额折算确认、久盈 B 的申购、赎回以及久盈 A 的申购等事宜。在每个分级运作期届满 10 个工作日前，基金管理人将公告本基金当前运作期结束后的过渡期安排及相关事宜。

过渡期内的申购与赎回的具体规则及相关事宜参见本基金合同“第九部分基金的过渡期”及基金管理人届时公告。

## 三、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，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 四、基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

#### 五、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。

#### 六、基金的冻结和解冻

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

## 第九部分 基金的过渡期

### 一、基金的过渡期

本基金每个分级运作期届满后转入下一分级运作期，本基金的过渡期为每个分级运作期届满日次日起(含该日)至下一分级运作期起始日前一工作日的期间，过渡期最长不超过 10 个工作日。基金管理人在过渡期内办理本基金的赎回以及申购等事宜。

### 二、过渡期的时间安排

每个分级运作期结束后，本基金将安排不超过 10 个工作日的过渡期，过渡期包括份额折算确认日、久盈 B 的开放期和久盈 A 的申购期三个阶段。其中第一个工作日为份额折算确认日，注册登记机构及基金管理人将为本基金份额持有人办理折算后的久盈 A 和久盈 B 份额的登记确认，份额折算确认日当日不接受申购与赎回。自过渡期的第二个工作日起本基金将进入久盈 B 的开放期，开放期的具体时间详见基金管理人发布的相关公告。久盈 B 的开放期结束后，基金管理人将以久盈 B 的开放期结束后的久盈 B 份额余额为基准，决定是否开放久盈 A 的申购。

过渡期结束后第一个工作日起（包括该日），本基金进入下一分级运作期。本基金过渡期内不开放久盈 A 的赎回。

### 三、过渡期内久盈 A、久盈 B 的份额配比

在过渡期内，基金管理人有权根据基金份额上限和两类份额配比进行规模控制；其中，过渡期内久盈 A、久盈 B 的份额配比不超过 7:3，两级基金份额上限详见相关公告，规模控制的具体方式包括但不限于比例确认、不进行或提前终止某一类份额的过渡期申购、减少某一类份额持有人所持份额等。

### 四、过渡期基金份额的申购与赎回原则

1、基金份额赎回、申购均采用“未知价”原则，即赎回、申购价格以申请当日收市后计算的对应基金份额净值为基准进行计算；

2、基金份额根据“金额申购、份额赎回”的原则，申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额的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，在当日的开放时间结束后不得撤销。基金管理人、基金注册登记机构或证券交易所另有规定的，从其规定；

4、基金管理人可以规定投资人在过渡期申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书；

久盈 A 和久盈 B 的销售机构可能不同，具体销售方式和销售机构详见本招募说明书及相关公告。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案。

5、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久盈 A/久盈 B 单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停久盈 A/久盈 B 申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

6、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

#### 五、过渡期申购的销售对象

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

#### 六、过渡期申购与赎回的费用

1、在过渡期久盈 B 的开放期内进行久盈 B 的赎回，不收取赎回费用，但对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并将赎回费全额计入基金财产。

2、在过渡期久盈 B 的开放期内进行久盈 B 的申购，具体申购费率参见招募说明书。

久盈 B 的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

3、在过渡期久盈 A 的申购期内进行久盈 A 的申购，不收取申购费用。

## 七、过渡期内申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

在过渡期内，基金投资者必须在久盈 B 的开放期的业务办理时间提出申购和赎回申请，必须在久盈 A 的申购期的业务办理时间提出申购申请。

投资者在申购时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时，必须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、申购和赎回申请的成交确认原则

过渡期的久盈 B 的开放期内，在每一个开放日，对于久盈 B 赎回申请，上一工作日所有经确认有效的赎回申请全部予以成交确认。

过渡期的久盈 B 的开放期内，在每一个开放日，对于久盈 B 申购申请，如果对久盈 B 的全部有效申购申请进行确认后，久盈 B 的份额余额大于久盈 B 的份额上限，则在经确认后的久盈 B 份额余额不超过其份额上限的范围内，对上一工作日全部有效申购申请按比例进行成交确认；如果对久盈 B 的全部有效申购申请进行确认后，久盈 B 的份额余额小于或等于其份额上限，则对全部有效申购申请全部予以成交确认。

过渡期久盈 A 申购期内，对于久盈 A 申购申请，本基金以久盈 B 的份额余额为基准，以本基金管理人届时公告的久盈 A、久盈 B 的份额配比为基准对久盈 A 的申购进行份额限制。

基金销售机构对申购和赎回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申购和赎回申请。申购和赎回申请的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

## 八、申购份额与赎回金额的计算

### 1、久盈 A 和久盈 B 的申购份额的计算

久盈 A、久盈 B 申购份额的计算详见招募说明书。

久盈 A、久盈 B 申购份额的计算，采取四舍五入的方式保留到小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

### 2、久盈 B 赎回金额的计算

久盈 B 份额的赎回金额的计算详见招募说明书。



久盈 B 赎回金额的计算结果采取四舍五入的方式保留至小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

### 3、本基金基金份额净值的计算

过渡期内，久盈 A、久盈 B 按照各自对应的基金资产净值计算各自的基金份额净值，公式如下：

$$T \text{ 日久盈 A 的基金份额净值} = \frac{T \text{ 日长城久盈纯债分级债券型基金资产净值}}{T \text{ 日长城久盈纯债分级债券型基金份额数}}$$

$$T \text{ 日久盈 B 的基金份额净值} = \frac{T \text{ 日长城久盈纯债分级债券型基金资产净值}}{T \text{ 日长城久盈纯债分级债券型基金份额数}}$$

其中，T 日长城久盈纯债分级债券型基金份额数为 T 日久盈 A 份额数、T 日久盈 B 份额数之和。

基金份额净值计算结果采取四舍五入的方式保留至小数点后第 3 位，由此产生的误差计入基金财产。

### 九、过渡期的基金运作安排

- 1、过渡期内，本基金基金资产保持为现金形式（不能变现的资产除外）；
- 2、过渡期内，基金管理人停收管理费，基金托管人停收托管费，销售机构停收销售服务费；
- 3、过渡期结束后的下一工作日为久盈 A 约定年收益率起算日，即下一个分级运作期起始日；
- 4、下一个分级运作期在第一个半年内久盈 A 的份额净值、份额参考净值为在该分级运作期起始日前一日久盈 A 份额净值的基础上按照年化单利增长计算而得的份额净值、份额参考净值。

## 第十部分 基金合同当事人及权利义务

### 一、基金管理人

#### (一) 基金管理人简况

名称：长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：杨光裕

设立日期：2001 年 12 月 27 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元

存续期限：持续经营

联系电话：0755-23982338

#### (二) 基金管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 进行证券投资时，应当遵守审慎经营规则，制定科学合理的投资策略和风险管理制，有效防范和控制风险；

(5) 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；

(6) 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；

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

- (8) 依法接受基金托管人的监督；
- (9) 不得侵占、挪用基金财产；
- (10) 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；
- (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，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，不得利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (15) 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；
- (16) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (17) 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；
- (18) 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；
- (19) 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；
- (20) 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；
- (21) 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；
- (22) 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；
- (23) 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；

(24) 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；

(25) 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；

(26) 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；

(27) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(28) 建立并保存基金份额持有人名册；

(29) 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

### (一) 基金托管人简况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 9 月 17 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】143 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

### (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 不得侵占、挪用基金财产；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(13) 建立并保存基金份额持有人名册；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(16) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(17) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 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。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

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



## 第十一部分 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

在基金合同生效后每个分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人独立进行表决。久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

### 一、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) 基金扩募或者延长基金合同期限；
- (2) 决定修改基金合同的重要内容或者终止《基金合同》，但《基金合同》另有约定的除外；
- (3) 更换基金管理人；
- (4) 更换基金托管人；
- (5) 转换基金运作方式；
- (6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等标准或费率的除外；
- (7) 变更基金类别；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；
- (10) 变更基金份额持有人大会程序；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 单独或合计持有久盈 A 和久盈 B 基金份额达到各自的基金总份额 10% 以上（含 10%）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；
- (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额

持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

4、单独或合计持有久盈 A 和久盈 B 基金份额达到各自的基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有久盈 A 和久盈 B 基金份额达到各自的基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，

应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

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

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

### 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的久盈 A 和久盈 B 基金份额不少于本基金在权益登记日各自的基金总份额的 50%（含 50%）。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会的，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久盈 A 和久盈 B 基金份额不少于权益登记日各自的基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的久盈 A 和久盈 B 基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50%（含 50%）；参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人所持有的久盈 A 和久盈 B 基金份额占权益登记日各自的总基金份额的三分之一以上；

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

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

## 五、议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 的表决权 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。

## 六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 的表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并，以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## 七、计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

### 2、通讯开会

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

## 八、生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法备案或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全

文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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



## 第十二部分 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职责终止的情形

#### （一）基金管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- 1、被依法取消基金管理资格；
- 2、被基金份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。

#### （二）基金托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- 1、被依法取消基金托管资格；
- 2、被基金份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形。

### 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

#### （一）基金管理人的更换程序

1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有久盈 A 和久盈 B 基金份额达到各自的基金总份额 10% 以上（含 10%）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久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；

3、临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；

4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会备案后 2 日内在指定媒体公告。

6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值；

7、审计：基金管理人职责终止的，应当按照法律法规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；

8、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，应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称字样。

## （二）基金托管人的更换程序

1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有久盈 A 和久盈 B 基金份额达到各自的基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金持有人提名；

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久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；

3、临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会备案后 2 个工作日内在指定媒体公告。

6、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，新任基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值；

7、审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规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。

## （三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

1、提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有久盈 A 和久盈 B 基金份额达到各自的基金总份额 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备案后 2 日内在指定媒体上联合公告。

## 第十三部分 基金的托管

基金托管人和基金管理人按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定订立托管协议。

订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、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。

## 第十四部分 基金份额的登记

### 一、基金的份额登记业务

本基金的登记业务指本指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。

### 二、基金登记业务办理机构

本基金的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登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

### 三、基金登记机构的权利

基金登记机构享有以下权利：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资者基金账户；
- 3、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；
- 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒体上公告；
- 5、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

### 四、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；
- 3、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；
- 4、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，但司法强制检查情形及法律

法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；

5、按《基金合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

6、接受基金管理人的监督；

7、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。

## 第十五部分 基金的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不直接参与股票、权证投资，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起 90 个交易日内卖出。

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

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

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置，主要通过对宏观经济运行周期、财政政策、货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响资本市场的重要因素进行研究和预测，分析债券市场、债券品种、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，以控制系统性风险。本基金将择机利用债券回购交易放大组合债券资产杠杆，在严格控制信用风险、流动性风险的基础上增强基金整体收益。

#### 2、固定收益类资产投资策略

本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供

求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。本基金具体投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略、债券回购杠杆策略等。

#### （1）久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。本基金的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标包括 GDP、CPI、PPI、固定资产投资、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量、新增贷款、新增存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将用于估计央行货币政策，以考察央行调整利率、存款准备金率，进行公开市场操作和窗口指导等操作对市场利率的影响程度。本基金将在对市场利率变动进行充分分析的基础上，选择建立和调整最优久期固定收益类资产组合。

#### （2）收益率曲线策略

本基金将在确定固定收益类资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

#### （3）个券选择策略

在对利率产品和信用产品的资产配置上，本基金将综合对宏观周期、利率市场、行业基本面和企业基本面等方面的分析结果，考察信用产品相对利率产品的信用溢价，结合市场情绪，动态调整利率产品和信用产品的配置比例，获取超越业绩基准的超额收益。本基金将主要依托公司内部的债券信用评级系统对持有债券的信用评级进行持续跟踪，防范信用风险。

#### （4）可转换债券投资策略

当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。

#### （5）中小企业私募债投资策略



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

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

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

本基金将根据相关法律法规要求披露中小企业私募债的投资情况。

#### （6）债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求固定收益类资产的超额收益。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金债券的投资比例不低于基金资产的 80%；
- （2）本基金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，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；
- （3）本基金不直接参与股票、权证投资；
- （4）本基金投资于单只中小企业私募债的比例不得超过本基金资产净值的 10%。
- （5）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%；
- （6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(11) 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%;

(12) 本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%;

(13) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(14) 久盈 A 开放日或过渡期内,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(15) 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;

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(10)、(14)、(15)项外,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。

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（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），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数作为业绩比较基准。

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比较基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 六、风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

从投资者具体持有的基金份额来看，在基金合同生效后每个分级运作期内，由于基金收益分配的安排，久盈 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；久盈 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

## 第十六部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

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

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

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

### 四、基金财产的保管和处分

基金财产的债务由基金财产本身承担，基金份额持有人以其出资为限对基金财产的债务承担责任。

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

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

## 第十七部分 基金资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

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

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

6、债券回购以成本列示，按协议商定利率在实际持有期内逐日计提利息。

7、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。

8、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

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

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

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

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

#### 五、估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

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

##### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。



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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### 六、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；  
2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；  
3、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人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

4、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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

5、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### 八、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不能作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十八部分 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、基金销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

久盈 A 收取基金销售服务费，久盈 B 不收取销售服务费。

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

久盈 A 的销售服务费按前一日久盈 A 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 为久盈 A 每日应计提的销售服务费

E 为久盈 A 前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣

缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十九部分 基金的收益与分配

### 一、基金利润的构成

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

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

在基金合同生效后每个分级运作期内，本基金不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

### 六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第二十章 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

## 第二十一部分 基金的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“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：

- （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议



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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

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

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

## （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媒体上。

## （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在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

## （四）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额（参考）净值公告

1、基金合同生效后，在久盈 A 的首次开放期前，基金管理人应至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值；

2、在久盈 A 的首次开放期后，基金管理人应在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值，以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值；

3、基金管理人应公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净

值以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值登载在指定媒体上；

4、在基金的过渡期内，基金管理人公告久盈 A 和久盈 B 的基金份额净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

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

#### （六）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上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人应当在基金定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### （七）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 个工作日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金销售机构；
- 20、更换基金登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、久盈 A 办理申购、赎回；

- 27、久盈 A、久盈 B 进行基金份额折算；
- 28、久盈 A 的收益率设定及其调整；
- 29、本基金基金合同生效后分级运作期届满，转入下一分级运作期后开始办理申购、赎回；
- 30、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；
- 31、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 32、中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《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。

#### （九）基金份额持有人大会决议

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

#### （十）中小企业私募债

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

#### （十一）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、

基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体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披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 第二十二部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒体公告。

### 二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

### 三、基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 四、清算费用

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

#### 五、基金财产清算剩余资产的分配

在基金合同生效后每个分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将优先满足久盈 A 的本金及应计收益分配，如有剩余部分，则由久盈 B 的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

#### 六、基金财产清算的公告

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

#### 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十三部分 违约责任

一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，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，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

三、由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。



## 第二十四部分 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

## 第二十五部分 基金合同的效力

《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、《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。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，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。

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

## 第二十六部分 其他事项

《基金合同》如有未尽事宜，由《基金合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。

## 第二十七部分 基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

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

供服务的外部机构；

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

## 2. 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) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 进行证券投资时，应当遵守审慎经营规则，制定科学合理的投资策略和风险管理制，有效防范和控制风险；

(5) 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；

(6) 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；

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

(8) 依法接受基金托管人的监督；

(9) 不得侵占、挪用基金财产；

(10) 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；

(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，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，不得利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(15) 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；

(16) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(17) 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；

(18) 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；

(19) 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；

(20) 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；

(21) 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；

(22) 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；

(23) 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；

(24) 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；

(25) 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；

(26) 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；

- (27) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (28) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (29) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3. 基金托管人的权利

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

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

### 4. 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

产或者利用职务之便为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 不得侵占、挪用基金财产；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(13) 建立并保存基金份额持有人名册；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(16) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(17) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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



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

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

(22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(23) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

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

## 6. 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定；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

在基金合同生效后每个分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人独立进行表决。久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

### (一) 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) 基金扩募或者延长基金合同期限；

(2) 决定修改基金合同的重要内容或者终止《基金合同》，但《基金合同》另有约定的除外；

(3) 更换基金管理人；

(4) 更换基金托管人；

(5) 转换基金运作方式；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等标准或费率的除外；

(7) 变更基金类别；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；

(10) 变更基金份额持有人大会程序；

(11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(12) 单独或合计持有久盈 A 和久盈 B 基金份额达到各自的基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，

下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(13)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

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

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

(1)调低基金管理费、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用;

(2)法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率;

(4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(5)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;

(6)按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二)会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集;

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

4、单独或合计持有久盈A和久盈B基金份额达到各自的基金总份额10%以上(含10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决

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

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

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

(三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的久盈 A 和久盈 B 基金份额不少于本基金在权益登记日各自的基金总份额的 50%（含 50%）。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会的，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久盈 A 和久盈 B 基金份额不少于三分之一。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人所持有的久盈 A 和久盈 B 基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 50% (含 50%); 参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例,召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会的,基金份额持有人所持有的久盈 A 和久盈 B 基金份额占权益登记日各自的总基金份额的三分之一以上;

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

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持

大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 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。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 的表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的久盈 A、久盈 B 的基金份额持有人或其代理人各自所持分别代表久盈 A、久盈 B 的表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

总数。

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### （八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法备案或者出具无异议意见之



日起生效。

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

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

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

在基金合同生效后每个分级运作期内，本基金不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登

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

#### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### （一）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### （二）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### （三）基金销售服务费

久盈 A 收取基金销售服务费，久盈 B 不收取销售服务费。

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

久盈 A 的销售服务费按前一日久盈 A 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 为久盈 A 每日应计提的销售服务费

E 为久盈 A 前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不直接参与股票、权证投资，也不参与一级市场新股或增发新股，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起 90 个交易日内卖出。

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

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

### （三）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本基金债券的投资比例不低于基金资产的 80%；

(2) 本基金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，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

(3) 本基金不直接参与股票、权证投资；

(4) 本基金投资于单只中小企业私募债的比例不得超过本基金资产净值的 10%。

(5) 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%；

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

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

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

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

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

(11) 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%；

(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；

(13) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(14) 久盈 A 开放日或过渡期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基

金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 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；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(10)、(14)、(15)项外，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。

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 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。

基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

(二) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额（参考）净值公告

1、基金合同生效后，在久盈 A 的首次开放期前，基金管理人应至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值；

2、在久盈 A 的首次开放期后，基金管理人应在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露基金份额净值，以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值；

3、基金管理人应公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、基金份额净值以及久盈 A 和久盈 B 的基金份额参考净值登载在指定媒体上；

4、在基金的过渡期内，基金管理人公告久盈 A 和久盈 B 的基金份额净值；

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一) 《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会备案生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒体公告。

(二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

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

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

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

#### 4、基金财产清算程序：

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

### （四）清算费用

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

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

在基金合同生效后每个分级运作期内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将优先满足久盈 A 的本金及应计收益分配，如有剩余部分，则由久盈 B 的基金份额持有人按其持有的基金份

额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

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

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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