

# 长盛纯债债券型证券投资基金 招募说明书

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

长盛纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2013 年 2 月 6 日获中国证监会证监许可【2013】145 号文批准募集。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动而波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险和信用风险等其他风险。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的基金份额净赎回申请与净转出申请之和超过上一日基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

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

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，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。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2016 年 3 月 13 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

重要提示 .....	2
目 录 .....	3
第一节 绪 言 .....	4
第二节 释 义 .....	5
第三节 基金管理人 .....	9
第四节 基金托管人 .....	18
第五节 相关服务机构 .....	20
第六节 基金的募集 .....	48
第七节 基金合同的生效 .....	49
第八节 基金份额的申购与赎回 .....	50
第九节 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押、定期定额投资计划 .....	59
第十节 基金的投资 .....	60
第十一节 基金的业绩 .....	69
第十二节 基金的财产 .....	70
第十三节 基金资产的估值 .....	72
第十四节 基金的费用与税收 .....	77
第十五节 基金的收益与分配 .....	80
第十六节 基金的会计与审计 .....	82
第十七节 基金的信息披露 .....	83
第十八节 风险揭示 .....	87
第十九节 基金合同的内容摘要 .....	90
第二十节 基金托管协议的内容摘要 .....	90
第二十一节 对基金份额持有人的服务 .....	91
第二十二节 其它应披露事项 .....	92
第二十三节 招募说明书的存放和查阅方式 .....	93
第二十四节 备查文件 .....	94
附件一：基金合同的内容摘要 .....	95
附件二：基金托管协议的内容摘要 .....	110

## 第一节 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》”）、《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》”）和其他相关法律法规的规定以及《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资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。

## 第二节 释义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

基金或本基金：	指长盛纯债债券型证券投资基金；
基金合同：	指《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书或本招募说明书：	指《长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书》及定期更新；
基金份额发售公告：	指《长盛纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告》；
托管协议：	指《长盛纯债债券型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 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做出的修订
《销售办法》：	指 2013 年 2 月 17 日经中国证券监督管理委员会第 28 次主席办公会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订
《运作办法》：	指中国证监会 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
《信息披露办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指长盛基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
基金份额持有人：	根据基金合同及相关文件合法取得本基金基金份额

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

- 申购：**指在基金合同生效后的存续期间，投资者按照基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：**指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为；
- 基金转换：**指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；
- 转托管：**指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；
- 销售服务费：**指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用；
- 基金份额类别：**指根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别代码不同，基金份额净值和基金份额累计净值或有不同；
- A 类基金份额：**指在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额；
- C 类基金份额：**指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额；
- 定期定额投资计划：**指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式；
- 指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
- 代销机构：**指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
- 销售机构：**指基金管理人及本基金代销机构；
- 基金销售网点：**指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；

指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的开放日；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
基金收益：	指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的客观事件。



### 第三节 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：高新

电话：（010）82019988

传真：（010）82255988

联系人：叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6 号文件批准，于 1999 年 3 月成立，注册资本为人民币 18900 万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%；新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。截至 2016 年 3 月 13 日，基金管理人共管理四十三只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

#### （二）主要人员情况

##### 1. 基金管理人董事会成员

高新先生，董事长，管理工程硕士。曾担任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券营业部经理，安徽国元信托投资有限责任公司总经理助理，上海安申投资管理公司总经理，国元证券有限责任公司投资银行总部总经理、总裁助理、副总裁，国元证券股份有限公司副总裁。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任，安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理，安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理，香港黄山有限公司总经理助理，国元证券股份有限公司董事、总裁、党委副书记。现任国元证券股份有限公司董事长、党委书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任公司党委委员、国元证券（香港）有限公司董事长。

钱力先生，董事，博士。曾任安徽省政府办公厅综合调研室干部、科员、副主任科员、一处副主任科员、主任科员、秘书一室主任科员、副调研员、副

主任，安徽省政府金融工作办公室处长、综合处处长、副主任、党组成员，淮南市政府副市长。现任安徽省信用担保集团有限公司总经理、党委副书记。

陈翔先生，董事，硕士。曾任安徽省六安行署办公室秘书、副科长、科长、副主任，安徽省政府办公厅综合调研室助理调研员、副主任、调研员，安徽省政府办公厅一处处长、助理巡视员兼秘书一室主任、副主任、党组成员，安徽省政府副秘书长、安徽省政府办公厅党组成员，安徽省委统战部副部长、安徽省工商联党组书记、第一副主席、安徽省委非公有制经济和社会组织工作委员会副书记。现任安徽省投资集团控股有限公司董事长、党委书记。

葛甘牛先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括所罗门兄弟公司、瑞士信贷第一波士顿银行(香港)有限公司、美林集团、德意志银行、荷兰银行、中银国际控股有限公司、瑞士信贷银行股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司。现任星展银行（中国）有限公司董事、行长/行政总裁。

陈健元先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括高盛(亚洲)有限责任公司、巴克莱银行。现任星展银行（香港）有限公司董事总经理兼北亚洲区私人银行业务主管。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。曾任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理（期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人）、北京朝阳门大街证券营业部总经理。2004年10月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理，兼任长盛基金（香港）有限公司董事长。

李伟强先生，独立董事，美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士，美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁，花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁。现任香港国际资本管理有限公司董事长。

张仁良先生，独立董事，博士，公共政策讲座教授。曾任香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人、太平洋经济合作理事会（PECC）属下公司管制研究小组主席、上海交通大学管理学院兼职教授、上海复旦大学顾问教授、

香港城市大学讲座教授、香港浸会大学工商管理学院院长。现任香港教育学院校长、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席。2007 年被委任为太平绅士。2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，学士，教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、校学术委员会委员、政治经济学博士点学科带头人、武汉大学商学院博士生导师，中国科技大学兼职教授，安徽省政府决策咨询专家委员会委员，全国马经史学会理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会副会长。

周放生先生，独立董事，在职研究生毕业。曾任国家国有资产管理局副处长、处长，国有资产管理研究所副所长，国家经贸委国有企业脱困工作办公室副主任，财政部财政科学研究所国有资产管理研究室主任，国务院国资委企业改革局副巡视员。现任中国企业改革与发展研究会副会长，中国外运股份有限公司独立监事，恒安国际集团有限公司独立董事，北京北斗星通导航技术股份有限公司独立董事，中航光电科技股份有限公司独立董事。

## 2. 监事会成员

陈新先生，监事会主席，硕士，经济师。曾担任交通银行淮南分行信贷员，安徽省国债服务中心投资副经理，香港黄山有限公司投资业务经理，国元证券有限责任公司投资管理总部总经理、总裁助理、副总裁。现任国元证券股份有限公司副总裁，兼公司董事会秘书，同时兼任国元期货有限公司董事，国元股权投资有限公司董事，国元证券（香港）有限公司董事。

吴达先生，监事，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，特许金融分析师 CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司，历任星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理，新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员，华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理。2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。现任长盛基金管理有限公司国际业务部总监，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，兼任长盛基金（香港）有限公司副总经理，长盛创富资产管理有限公司总经理。

魏斯诺先生，监事，英国雷丁大学硕士。历任中国人寿资产管理有限公司投资组合经理、高级组合经理，合众资产管理有限公司组合管理部总经理。2013年7月加入长盛基金管理有限公司，现任社保业务管理部总监，社保组合组合经理。

### 3. 管理层成员

高新先生，董事长，管理工程硕士。同上。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

杨思乐先生，英国籍，拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位，特许另类投资分析师 CAIA。从 1992 年 9 月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司（新加坡）。2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司副总经理，兼任长盛基金（香港）有限公司董事、总经理。

叶金松先生，大学，会计师。曾任美菱股份有限公司财会部经理，安徽省信托投资公司财会部副经理，国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理。2004 年 10 月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司督察长。

林培富先生，上海财经大学经济学硕士。曾任安徽省信托投资公司国际业务部科长、副经理、投资银行总部副经理、经理，国元证券有限责任公司基金公司筹备组负责人。2005 年 1 月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司总经理助理。现任长盛基金管理有限公司副总经理，兼任人力资源部总监、长盛基金（香港）有限公司董事、长盛创富资产管理有限公司执行董事。

王宁先生，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005 年 8 月加盟长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理、长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理、长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，权益投资部总监，社保组合组合经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理蔡宾先生，中央财经大学硕

士，特许金融分析师 CFA。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理，投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理。

#### 4. 本基金基金经理

张帆先生，1983 年 1 月出生。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012 年 4 月加入长盛基金管理有限公司，曾任非信用研究员，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。自 2013 年 9 月 18 日起担任长盛纯债债券型证券投资基金(本基金)基金经理，自 2013 年 12 月 9 日起兼任长盛添利宝货币市场基金基金经理，自 2014 年 6 月 27 日起兼任长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2016 年 1 月 20 日起兼任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：杨衡先生，2013 年 3 月 13 日至 2014 年 4 月 10 日任本基金基金经理。

（本招募说明书基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。）

#### 5. 投资决策委员会成员

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

王宁先生，副总经理，EMBA。同上。

蔡宾先生，副总经理，中央财经大学硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

吴达先生，监事，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

魏斯诺先生，监事，英国雷丁大学硕士。同上。

刘旭明先生，清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，现任研究部总监，长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券

投资基金（LOF）基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （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、赎回和注册登记手续；
2. 办理基金备案手续；
3. 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. 编制季度报告、半年度和年度基金报告；
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. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
9. 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. 有关法律法规和中国证监会规定和基金合同约定的其他职责。

### （四）基金管理人承诺

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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。
3. 基金经理承诺
  - （1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着勤勉、谨慎的原则为

基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不能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、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

（五）基金管理人的内部控制制度

#### 1. 内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

（1）健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）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。

（3）独立性原则。公司各部门和岗位职责保持相对独立，基金资产、公司自有资产、委托理财及其他资产的运作应当分离。

（4）相互制约原则。公司及各部门在内部组织结构和岗位的设置上要权责分明、相互制衡。

（5）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。

（6）风险控制与业务发展并重原则。公司的发展必须建立在风险控制制度完善和健全的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上。

#### 2. 完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”（董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部、风险管理部）内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于公司风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况，组织指导公司监察稽核、风险管理部工作，对基金运作、内部管理的制度执行及遵纪守法进行检查监督；公司风险控制委员会定期对基金资产运作的风险进行评估，对存在的风险隐患或发现的风险问题进行研究；监察稽核部通过日常的监督检查工作，督促公司各部门

持续完善且严格执行内控制度，风险管理部通过全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度，从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面及时和全面揭示各基金风险控制要素，明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法，全面加强对各基金投资合规风险监控。

### 3. 内部控制制度的内容

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度及公司及部门业务规章等三部分组成。

(1) 公司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，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和危机处理制度等。公司基本管理制度的制定在报经公司董事会批准后实施。

(3) 公司及部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对公司及各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、业务流程和操作守则等的具体说明。公司及部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟定，其制定和实施需报经公司总经理办公会批准。

公司的内部控制制度根据法律法规变化和公司发展实际适时修订完善。公司各部门对规章制度的调整由监察稽核部负责检查与督促。

### 4. 内部控制制度评价与报告

公司建立了严格的内控制度评价程序和报告制度，以保证公司内部控制制度的合理性与有效性。部门负责人是本部门内部控制与风险管理的第一责任人，须定期检查本部门的风险控制情况和风险控制措施是否有效，对相应的内部控制制度的合理性、有效性做出评价，并根据检查、评价结果及时调整内控制度或修正行为。公司监察稽核部在各部门自我监督基础之上实施再监督，通过对各项制度执行情况定期、不定期的稽核，对各项制度的合理性与有效性进



行检查评价，发现制度不合理的、不适用的，要求相关部门进行修改，同时报告公司总经理和督察长；发现制度未能有效执行、控制失效的，要求相关部门立即整改，并出具监察报告，及时向公司管理层和督察长报告。督察长就公司内控制度建设与执行情况定期向监管机构及公司董事会进行报告。

#### 5. 基金管理人关于内部控制的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四节 基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

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

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

### （三）证券投资基金托管情况

截至2015年12月31日，中国银行已托管418只证券投资基金，其中境内基金390只，QDII基金28只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### （四）托管业务的内部控制制度

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

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2014年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

## 第五节 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

住所：深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

法定代表人：高新

邮政编码：100088

电话：（010）82019799、82019795

传真：（010）82255981、82255982

联系人：吕雪飞、张晓丽

#### 2. 代销机构

##### （1）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

联系人：宋府

电话：（010）66594904

传真：（010）66594946

客户服务电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

##### （2）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：刘士余

联系人：唐文勇

电话：010-85108227

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（3）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

（4）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：姚磊、高天

电话：021—61614467

传真：021—63604196

客户服务电话：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（5）大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路88号

办公地址：大连市中山区上海路51号

法定代表人：陈占维

联系人：李格格

电话：0411-82356627

传真：0411-82356590

客户服务电话：400-664-0099

公司网址：[www.bankofdl.com](http://www.bankofdl.com)

（6）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：李博

电话：021—52629999

传真：021—62569070

客户服务电话：95561

公司网站：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

（7）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：廉赵峰

电话：89937369

传真：85230049

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

（8）徽商银行股份有限公司

注册地址：合肥安庆路 79 号天徽大厦 A 座

办公地址：合肥安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人：李宏鸣

联系人：叶卓伟

电话：0551-62667635

传真：0551-62667684

客服电话：4008896588（安徽省内可直拨 96588）

公司网站：[www.hsbank.com.cn](http://www.hsbank.com.cn)

（9）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：杨菲

电话：010-66107909

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

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

（10）包商银行股份有限公司

注册地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号

办公地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号

法定代表人：李镇西

联系人：刘芳

电话：0472-5189051

传真：0472-5189051

客户服务电话：95352

公司网站：[www.bsb.com.cn](http://www.bsb.com.cn)

（11）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451958

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：[www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

（12）财通证券股份有限公司

注册地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：0571-87822359

传真：0571-97918329

客户服务电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

公司网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

（13）长城证券有限责任公司

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

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

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

（14）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（15）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：（0755）23838750

传真：（0755）23838701

客户服务电话：400-888-1888



公司网址：[www.fcsc.com](http://www.fcsc.com)

（16）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：400-600-0686

传真：(0431) 85096795

客户服务电话：400-600-0686

公司网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

（17）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

电话：95531、400-8888-588

传真：(021) 50498825

客户服务电话：95531、400-8888-588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（18）东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：4008888993

公司网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

（19）东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：乔芳

电话：0769-22100155

传真：0769-22119426

客户服务电话：0769-961130

公司网址：www.dgzq.com.cn

（20）方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

客户服务电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

（21）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

客户服务电话：95525 4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

（22）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

层

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

（23）国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客户服务电话：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

（24）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客户服务电话：4006-600109 地区服务热线：95105111（四川）

公司网址：www.gjq.com.cn

（25）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：上海市延平路 135 号

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：（021）62580818-213

传真：（021）62569400

客户服务电话：95521

公司网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

（26）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 楼

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

（27）国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：蔡咏

联系人：祝丽萍

电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

传真：（0551）2272100

客户服务电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

公司网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

（28）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

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：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客户服务电话：400-8888-001、(021) 962503

公司网址：www.htsec.com

（29）恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路 111 号

办公地址：上海浦东松林路 357 号通贸大厦 20 楼

法定代表人：刘汝军

联系人：张同亮

电话：021-68405273

传真：021-68405181

客户服务电话：0471-4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

（30）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

客户服务电话：96518（安徽）、4008096518（全国）

公司网址：www.hazq.com

（31）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张宗锐

电话：(0591) 87383600

传真：(0591) 87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（32）华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客户服务电话：4006898888、0931-96668

公司网址：www.hlzqgs.com

（33）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：宋德清

联系人：黄恒

电话：010-58568235

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

公司网址：www.hrsec.com.cn

（34）华鑫证券有限责任公司

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

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨丽娟

电话：021-54967202

传真：021-54967293

客户服务电话：021-32109999、029-68918888

公司网址：www.cfsc.com.cn

（35）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：刘爽

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

客户服务电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（36）联讯证券股份有限公司

注册地址：中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

办公地址：中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

法定代表人：徐刚

联系人：郭晴

电话：0752-2119391

传真：0752-2119369

客户服务电话：95564

公司网址：www.lxsec.com.cn

（37）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

客户服务电话：95511—8

公司网址：www.pingan.com

（38）山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351—8686659

传真：0351—8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

（39）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华

电话：021-53686888

传真：021-53686100

客户服务电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

（40）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523 电话委托：021-962505

公司网址：国际互联网网址：www.swhysc.com

（41）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单

元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 47-49 楼

法定代表人：张永衡



联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客户服务电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

（42）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：赵小明

电话：021-68634510-8620

传真：021-68865680

客户服务电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

（43）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（44）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（45）浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座

办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6/7

法定代表人：吴承根

联系人：李凌芳

电话：021-64718888

传真：021-64713795

客户服务电话：0571967777

公司网址：www.stocke.com.cn

（46）中国国际金融有限公司

办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户服务电话：400-910-1166

公司网址：www.cicc.com.cn

（47）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：（010）66568430

传真：（010）66568536

客户服务电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（48）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

客户服务电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（49）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

电话：0755-82570586

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011

公司网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

（50）中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

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

（51）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：400-8888-108

传真：(010) 65182261

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（52）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号天泰金融广场 A 座 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号天泰金融广场 A 座 20 层（266061）

法定代表人：杨宝林

联系人：赵艳青

电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

（53）中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

联系人：张于爱

电话：010-84864818

传真：010-84865560

客户服务电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（54）北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安福街 6 号

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

联系电话：010-62020088

传真：010-62020355

客服电话：400-888-6661

公司网站：<http://www.myfp.cn>

（55）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座九层

法定代表人：其实

联系人：何春燕

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

公司网站：<http://www.1234567.com.cn/>

（56）杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：徐晔绯

联系电话：021-60897840

客服电话：4000-766-123

公司网站：<http://www.fund123.cn/>

（57）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国企大厦 C 座 9 层

法定代表人：马令海

联系人：邓洁

联系电话：010-58321105

传真：010-58325282

客服电话：4008507771

网站：[www.jrj.com.cn](http://www.jrj.com.cn)

（58）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人：王莉

联系人：吴卫东

联系电话：021-20835787

客服电话：400-920-0022

网站：<http://licaike.hexun.com>

（59）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：吴强

联系电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：0571-88920897 4008-773-772

公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

（60）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

开放式基金咨询电话：400-700-9665

开放式基金业务传真：021-68596916

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

（61）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：沈伟桦

联系人：宋欣晔

联系电话：010-52361860

客服电话：400-6099-500

网站：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

（62）北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

联系人：陈攀

联系电话：010-57756019

传真：010-57756199

客服电话：4007-868-868

网站：<http://www.chtfund.com>

（63）北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：周悦

联系电话：010-57418829

传真：010-57569671

客服电话：400-678-5095

网站：<http://www.niuji.net>

（64）万银财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201

法定代表人：王斐

联系人：廉亮

电话：010-53300532

传真：010-59393074

客服电话：400-808-0069

网站：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(65) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：郑茵华

电话：021-20691831

传真：021-20691861

客户服务电话：400-089-1289

公司网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(66) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702

办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

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

(67) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 227 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人：燕斌

联系人：汤蕾

电话：021-51507071

传真：021-62990063

客户服务电话：021-51507071



网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

（68）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

法定代表人：冯修敏

联系人：周丹

电话：021-33323999\*8318

传真：021-33323830

客服电话：4008202819

网站：[fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

（69）济安财富（北京）资本管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心 A 座 46 层

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516 转 814

传真：010-65330699

客服电话：400-075-6663

网站：[www.pjfortune.com](http://www.pjfortune.com)

（70）中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号

法定代表人：徐福星

联系人：李美

电话：010-68998820

客服电话：400-600-0030

网站：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

（71）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

电话：13521165454

传真：010-67000988-6000

客服电话：400-001-8811

网站：www.zcvc.com.cn

（72）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：何雪

电话：02120665952

传真：02122066653

客服电话：400-821-9031

网站：lufunds.com

（73）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈纪伟

联系人：赵沛然

电话：02150583533

传真：02150585353

客服电话：400-033-7933

网站：www.leadfund.com.cn

（74）泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：薛长平

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客服电话：400-6411-999

网站：[www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

（75）北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号景山财富中心 341 室

法定代表人：梁洪军

联系人：季长军

电话：010-68854005

传真：010-68854009

客户服务电话：400-819-6665

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

（76）北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室

法定代表人：董浩

联系人：张婷婷

电话：18510450202

传真：010-56580660

客户服务电话：400-068-1176

公司网址：[www.jimufund.com](http://www.jimufund.com)

（77）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

联系人：陈勇军

电话：0755-83999907-806

传真：0755-83999926

客户服务电话：0755-83999913

公司网址：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

（78）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼  
B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

（79）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

电话：021-63333319

传真：021-63332523

客户服务电话：4000 178 000

公司网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

（80）浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路55号一楼

法定代表人：徐黎云

联系人：孙成岩

电话：0571-88337717

传真：0571-88337666

客户服务电话：400-068-0058

公司网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

（81）泰信财富投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间

办公地址：北京市海淀区西四环北路 69 号一层

法定代表人：李静

联系人：周栋

电话：010-88499161

传真：010-88460066

客户服务电话：400-168-7575

公司网址：www.taixincf.com

（82）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：俞申莉

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

公司网址：www.jiyufund.com.cn

（83）奕丰科技服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

公司地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法人：TAN YIK KUAN

联系人：项晶晶

电话：0755 8946 0500

传真：0755 2167 4453

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（84）北京君德汇富投资咨询有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 18 号 15 层办公楼一座 1502 室

办公地址：北京市东城区建国门内大街 18 号恒基中心办公楼一座 2202 室

法定代表人：李振

联系人：周汶

电话：13810043063

传真：010-65174782

客户服务电话：400-057-8855

公司网址：www.vjinke.com

（85）深圳众禄金融控股有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩萍

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网站：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（86）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

联系电话：021-38509636

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（二）注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：高新

电话：（010）82019988

传真：（010）82255988

联系人：龚珉

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办会计师：陈玲、沈兆杰

联系人：沈兆杰

## 第六节 基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《暂行规定》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2013年2月6日证监许可【2013】145号文批准募集。

募集期为2013年2月25日到2013年3月8日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，募集期募集长盛纯债债券A 2,480,359,940.51份、长盛纯债债券C 854,706,495.72份，合计募集3,335,066,436.23份基金份额，有效认购户总数11,979户。



## 第七节 基金合同的生效

本基金基金合同自 2013 年 3 月 13 日起生效，基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，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 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 第八节 基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点由基金管理人在基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （二）申购与赎回的开放日及时间

1、申购、赎回的开放日：指本基金为投资人办理基金份额申购、赎回等业务的工作日，为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购、赎回时除外）。

申购开始日：2013年5月10日

赎回开始日：2013年5月10日

#### 2、开放时间：

上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日交易时间，即上午9:30-11:30，下午1:00-3:00。

若未来证券交易市场、证券交易所交易时间更改或根据实际情况需要，基金管理人可以对申购、赎回时间进行调整，但需报中国证监会备案，并在实施前3个工作日在至少一种证监会指定的媒体上刊登公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期和时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。

### （三）申购与赎回的原则

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

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理时，认购、申购

确认日期在前的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

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

5、基金管理人在法律法规或中国证监会允许的、不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （四）申购和赎回的程序

##### 1、申购与赎回申请的提出

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

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购与赎回申请的确认

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

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

##### 3、申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

#### （五）申购与赎回的数额限制

##### 1、申购金额的限制

基金管理人直销中心、网上交易及代销机构每个账户单笔申购的最低金额为 1,000 元（含申购费）；

2、投资者赎回份额不设限制；

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

#### （六）申购份额和赎回金额的计算方式

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

##### 1、本基金申购份额的计算方式：

申购的有效份额为净申购金额除以受理申请当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

（1）本基金 A 类基金份额申购份额的计算方式。具体申购份额的计算方法如下：

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）

申购费用=申购金额-净申购金额

（注：对于适用固定金额申购费的申购，申购费用=固定申购费金额）

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

（2）本基金 C 类基金份额的申购份额的计算方法如下：

申购金额=净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

##### 2、本基金赎回金额的计算：

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后的余额，赎回金额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以

后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

本基金赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

(1) A 类基金份额赎回金额计算方法

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

(2) C 类基金份额赎回金额计算方法

赎回总金额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

3、本基金基金份额净值的计算：

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

(七) 基金的申购费与赎回费及其用途

1、申购费用

本基金基金份额分为 A 类和 C 类两类不同的类别。本基金 A 类基金份额的申购费率按申购金额的大小划分为四档，随申购金额的增加而递减（适用固定金额费率的申购除外）；投资者申购 C 类基金份额不收取申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。具体费率如下表所示：

	单笔金额	费率
A 类申购费	50 万元以下	0.8%
	50 万元（含） - 200 万元	0.5%
	200 万元（含） - 500 万元	0.3%
	500 万元以上（含）	每笔 1000 元
C 类申购费	0	

例 1：某投资者以 40 万元申购本基金 A 类基金份额，申购费率为 0.8%，假设申购当日基金份额净值为 1.100 元，则其可得到的申购份额为：

净申购净额 =  $400,000 / (1 + 0.8\%) = 396,825.40$  元

申购费用=400,000-396,825.40=3,174.60 元

申购份额=396,825.40/1.100=360,750.36 份

即：投资者以 40 万元申购本基金 A 类基金份额，如果申购当日基金份额净值为 1.100 元，则其可得到的申购份额为 360,750.36 份。

例 2：某投资人投资 100,000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.060 元，则可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.060=94,339.62 份

即：投资人投资 100,000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.060 元，则其可得到 94,339.62 份基金份额。

## 2、赎回费用

投资人赎回 A 类基金份额收取赎回费用，该费用随基金份额的持有期限的增加而递减；本基金管理人对持有 C 类基金份额期限少于 30 日的该类别基金份额的赎回收取赎回费，对于持有期限不少于 30 日的该类别基金份额不收取赎回费。

本基金 A 类和 C 类基金份额的赎回费率见下表：

A 类赎回费	持有期	费率
	1 年以内	0.1%
	1 年（含）- 2 年	0.05%
	2 年（含）以上	0
C 类赎回费	持有期	费率
	30 日以内	0.3%
	30 日（含）以上	0

例 3、某基金份额持有人赎回持有不超过 6 个月的 1,000 份 A 类基金份额，赎回对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则其可得到的赎回净额为：

赎回金额=1,000×1.100=1,100 元

赎回费用=1,100×0.1%=1.10 元

赎回净额=1,100-1.1=1,098.90 元

即：基金份额持有人赎回持有不超过 6 个月的 1,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则其可得到的赎回净额为 1,098.90 元。

例 4：某投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，持有时间为 15 天，

假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.250 元，对应的赎回费率为 0.3%，则其可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.250 = 12,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500 \times 0.3\% = 37.50 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500 - 37.50 = 12,462.50 \text{ 元}$$

即：投资人赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，持有时间为 15 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.250 元，则其可得到的净赎回金额为 12,462.50 元。

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

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

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

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低申购费率和赎回费率。

#### （八）申购和赎回的注册登记

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

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

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

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进

行调整，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的规定指定媒体上公告。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

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

#### （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：



(1) 因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法受理投资者的申购申请；

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

(3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

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

(5) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；

(6) 基金管理人、基金托管人、销售机构或注册登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行；

(7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)、(2)、(3)、(4)、(6)、(7)项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停基金投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将在七日内退还给投资人。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

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

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

(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请时，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。除非发生巨额赎回，已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支

付部分可延期支付，并在后续开放日予以支付。若出现上述第(3)项所述情形，按基金合同的相关条款处理。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

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

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

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

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

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

#### (十一) 基金转换

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

## 第九节 基金的非交易过户、转托管、冻结与质押、定期定额投资计划

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

“继承”指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。

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

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

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

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

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

## 第十节 基金的投资

### （一）投资目标

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

### （二）投资范围

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

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

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

### （三）投资理念

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

### （四）投资策略

#### A. 大类资产配置策略

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

置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。

## B. 债券组合管理策略

### 1、利率策略

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

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

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

### 2、类属配置策略

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

### 3、信用策略

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

#### （1）宏观环境和行业分析

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

#### （2）发债主体基本面分析

主要包括定性分析和定量分析两个方面：

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

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

### （3）内部信用评级定量分析体系。

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

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

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

3) 行业内信用等级的切分。根据信用分数的统计分布进行类别划分。

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

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

### 4、相对价值策略

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

## 5、债券选择策略

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

## 6、资产支持证券等品种投资策略

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

### （五）投资决策依据

#### A. 决策依据

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

#### B. 决策程序

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

#### 1、投资研究及投资策略制定

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

#### 2、投资决策

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

决策委员会审批。

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

### 3、投资组合构建

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

### 4、交易执行

交易员负责在合法合规的前提下，执行基金经理的投资指令。

### 5、风险管理及绩效评估

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

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

## （六）业绩比较基准

中债综合指数（全价）。

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

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

## （七）风险收益特征



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

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

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

2、基金投资组合比例限制

- （1）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- （2）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- （3）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （5）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （6）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支

持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

(8) 本基金投资固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

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

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

(九) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

(十) 基金投资组合报告

基金投资组合报告数据摘自本基金2014年第4季度报告（以下简称“本报告”）。

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自长盛纯债债券型证券投资基金2015年第4季

度报告，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	212,345,924.60	90.26
	其中：债券	207,099,924.60	88.03
	资产支持证券	5,246,000.00	2.23
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,808,119.62	5.44
7	其他资产	10,096,415.23	4.29
8	合计	235,250,459.45	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资 明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,019,791.60	1.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	114,481,000.00	57.57
	其中：政策性金融债	114,481,000.00	57.57
4	企业债券	59,490,133.00	29.92
5	企业短期融资券	30,109,000.00	15.14
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	207,099,924.60	104.15

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资 明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150218	15 国开 18	400,000	42,008,000.00	21.12
2	150207	15 国开 07	300,000	31,017,000.00	15.60
3	150405	15 农发 05	100,000	10,557,000.00	5.31
4	150216	15 国开 16	100,000	10,466,000.00	5.26
5	150213	15 国开 13	100,000	10,421,000.00	5.24

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123501	PR 隧道 02	100,000	5,246,000.00	2.64

注：本基金本报告期末仅持有上述一只资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### （1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

##### （2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### （3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 10、投资组合报告附注

（1）声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

（2）声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期内未进行股票投资。

### （3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,593.75
2	应收证券清算款	3,500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,662,591.23
5	应收申购款	1,929,230.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,096,415.23

### （4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### （5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### （6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十一节 基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

### 1、长盛纯债债券 A

	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	同期业绩比较基准收益率超额收益率
2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-1.70%	-4.40%	2.70%
2014年1月1日至2014年12月31日	11.19%	6.54%	4.65%
2015年1月1日至2015年12月31日	11.16%	4.19%	6.97%
2013年3月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日	21.50%	6.12%	15.38%

### 2、长盛纯债债券 C

	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	同期业绩比较基准收益率超额收益率
2013年3月13日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-2.00%	-4.40%	2.40%
2014年1月1日至2014年12月31日	10.82%	6.54%	4.28%
2015年1月1日至2015年12月31日	10.96%	4.19%	6.77%
2013年3月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日	20.50%	6.12%	14.38%

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

## 第十二节 基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

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

### （四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破

产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

### 第十三节 基金资产的估值

#### （一）估值目的

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

#### （二）估值日

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

#### （三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

#### （四）估值原则

对于存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确定计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

#### （五）估值方法

##### 1、证券交易所上市交易的有价证券的估值

（1）交易所上市交易的有价证券，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）交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（4）交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘全价减去债券收



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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）首次公开发行未上市债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（2）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

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

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

#### （六）估值程序

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

#### （七）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### （八）基金份额净值的确认

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

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

#### （九）估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进

行更正和赔偿损失；

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（十）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额估值错误处理。

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

## 第十四节 基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

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

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.7% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费率按年费率 0.35%。

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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

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

#### （三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### （四）基金管理费、基金托管费、销售服务费的调整

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

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施日前依照《信息披露办

法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 第十五节 基金的收益与分配

### （一）收益的构成

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

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

### （二）收益分配原则

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

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

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

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

6、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

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



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

9、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

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

### （四）收益分配方案的确定与公告

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

### （五）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

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

## 第十六节 基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人和基金托管人应各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后2日内公告；
- 3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

## 第十七节 基金的信息披露

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

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

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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

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

### （二）基金份额发售公告

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

### （三）基金合同生效公告

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

### （四）基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当

至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

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

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

#### （五）定期报告

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

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

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

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （六）临时报告与公告

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

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格

产生重大影响的事件，包括：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值估值错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、调整基金份额类别的设置；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### （七）公开澄清

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

#### （八）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

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

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

#### （九）中国证监会规定的其他信息

#### （十）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，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报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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 10 年。

#### （十一）信息披露文件的存放与查阅

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

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

## 第十八节 风险揭示

尽管本基金属于基金产品中风险较低的产品类型，但是并不意味着投资本基金不承担任何风险，基金管理人在资产管理中将采用审慎的原则尽量规避投资风险，同时也提醒投资人注意以下几方面的投资风险。

### 1、市场风险

本基金为证券投资基金，证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素都将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

（1）政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（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证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。本基金投资于短期固定收益工具，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。另外，利率期限结构的变化带来收益率曲线的非平行移动，导致期限不同的两种债券的收益率之间的差幅发生变化而产生风险，形成收益率曲线风险，也称为利率期限结构变化风险；单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

（4）购买力风险：基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（5）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。

本基金主要投资于银行间市场交易的短期固定收益工具，且以摊余成本法进行估值计量，因此无重大市场价格风险。

## 2、信用风险

信用风险主要来自于发行人、存款银行及其担保人，指债券、资产支持证券、短期融资券等信用证券发行主体信用状况恶化，到期不能履行合同进行兑付的风险，同时当基金持有的债券、票据或其发行人的信用等级下降时，会因违约风险的加大而导致市场价格的下降，从而导致基金资产的损失。

另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金将在投资决策中充分考虑交易对手的信用状况，尽可能避免上述信用损失。

## 3、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

## 4、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

### （1）市场整体流动性风险

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本基金的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。这种风险在发生大额申购和大额赎回时表现尤为突出。

### （2）个券流动性风险

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加基金投资成本。

## 5、操作风险



操作风险是指基金运作过程中，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。

#### 6、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。

#### 7、本基金的特定风险

##### （1）特定投资对象风险

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%。因此，本基金需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及发债主体特别是公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险，以及无法偿债造成的信用违约风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

##### （2）顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资人在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

#### 8、其他风险

（1）在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

（2）因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

（3）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

（4）因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

（5）对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

（6）战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

（7）其他意外导致的风险。

本基金管理人在充分认识上述风险与对风险做出正确评估的基础之上，结合现代风险控制技术与公司风险控制体系，保证在低风险的环境下，实现风险收益的均衡。

## 第十九节 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要详见附件一。

## 第二十节 基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要详见附件二。

## 第二十一节 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和基金代销机构提供。基金管理人为基金份额持有人提供以下一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，增加、修改服务项目：

### （一）电话服务

客户服务中心自动语音系统提供每周七天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可以通过电话查询基金份额净值和基金份额持有人账户信息查询。同时，客服中心提供工作日每天 8:30-17:00 的电话人工服务。

长盛基金管理有限公司客户服务热线：(010)62350088 400-888-2666（免长途话费）

### （二）在线服务

通过基金管理人网站，投资者可以获得如下服务：

- 1、在线客服。投资者可点击基金管理人网站“在线客服”，进行咨询或留言。
- 2、资讯服务。投资者可通过基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、基金管理人最新动态、热点问题等。

长盛基金管理有限公司网址：[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)

长盛基金管理有限公司客户服务电子信箱：[services@csfunds.com.cn](mailto:services@csfunds.com.cn)

### （三）投诉建议受理

如果基金份额持有人对基金管理人提供的各项服务有疑问，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等方式随时向基金管理人提出，也可直接与客户服务人员联系，基金管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉；同时，基金份额持有人的合理建议是基金管理人发展的动力与方向。

## 第二十二节 其它应披露事项

其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露日期
1	本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。	
2	最近3年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚。	
3	关于增加泰诚财富为旗下部分基金代销机构并开通定投及转换业务的公告	2015/9/23
4	关于旗下部分开放式基金参加中金公司网上交易 电话委托及柜台委托申购（不含定投）费率优惠活动的公告	2015/9/24
5	关于增加利得基金为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告	2015/10/8
6	关于长盛纯债基金和长盛新兴成长基金增加代销机构的公告	2015/10/13
7	长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	2015/10/14
8	长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	2015/10/14
9	关于旗下部分基金增加代销机构的公告	2015/10/15
10	关于增加微动利为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及转换业务的公告	2015/10/19
11	关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	2015/10/20
12	关于旗下基金参加好买基金费率优惠活动的公告	2015/10/20
13	关于增加交通银行为长盛电子信息主题混合型基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参与基金申购费率优惠活动的公告	2015/10/22
14	长盛纯债债券型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	2015/10/23
15	关于增加中国农业银行为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	2015/10/29
16	关于增加工商银行为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通基金转换业务并参加个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	2015/11/2
17	关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务的公告	2015/11/16
18	关于增加富济财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告	2015/11/24
19	关于增加凯石财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告	2015/11/24
20	关于增加盈米财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告	2015/11/24
21	长盛基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠活动并开通	2015/11/30

	转换业务的公告	
22	关于增加国信证券为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告	2015/12/15
23	关于增加金观诚为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	2015/12/15
24	关于旗下部分基金参加中国农业银行定投申购优惠活动的公告	2015/12/31
25	关于旗下部分基金开通中国工商银行定投业务并参加定投申购优惠活动的公告	2015/12/31
26	关于长盛基金指数熔断机制实施后基金配套工作安排的公告	2015/12/31
27	长盛基金关于交易所指数熔断后相关基金业务办理时间调整的公告	2016/1/4
28	长盛基金关于旗下开放式基金指数熔断发生后相关业务处理规则的公告	2016/1/4
29	关于增加包商银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务的公告	2016/1/6
30	关于交易所指数熔断后相关基金业务办理时间调整的公告	2016/1/7
31	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	2016/1/7
32	长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	2016/1/8
33	长盛纯债债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	2016/1/20
34	关于增加恒宇天泽为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务的公告	2016/1/21
35	关于增加泰信财富为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	2016/1/21
36	关于暂停旗下部分基金在恒宇天泽的基金销售业务的公告	2016/1/26
37	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚正行和金观诚基金费率优惠活动的公告	2016/1/29
38	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加信达证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	2016/3/4
39	长盛基金管理有限公司关于增加浦发银行为长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金代销并开通基金定投及转换业务的公告	2016/3/11

### 第二十三节 招募说明书的存放和查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 第二十四节 备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会批准长盛纯债债券型证券投资基金募集的文件；
- 2、《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于募集长盛纯债债券型证券投资基金的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）备查文件存放地点

本基金管理人长盛基金管理有限公司办公地点—北京海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层。

### （三）投资者查阅方式

可咨询本基金管理人，部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

长盛基金管理有限公司

2016年4月20日

## 附件一：基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### （一）基金管理人

##### 1、基金管理人

长盛基金管理有限公司

##### 2、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （10）依据基金合同及有关法律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，在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高管理费、托管费和销售服务费之外的基金费率结构和收费方式；

(17) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

(2) 办理基金备案手续；

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

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；



（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

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

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

- (26) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## （二）基金托管人

### 1、基金托管人

中国银行股份有限公司

### 2、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 3、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 1、基金份额持有人的权利

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 2、基金份额持有人的义务

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

(1) 认真阅读并遵守基金合同；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、本基金与其他基金合并；
- 9、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 10、单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 11、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 12、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事

项。

（三）有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费、销售服务费和其他应由基金承担的费用；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，调整基金份额类别的设置；
- 3、在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；
- 4、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 5、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- 6、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

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

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

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

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30

日报中国证监会备案。

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

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

#### （五）通知

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

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

#### （六）开会方式

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

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- （1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布

相关提示性公告；

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

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

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

(七) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

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

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

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



(4) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

## (八) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### (1) 特别决议

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

### (2) 一般决议

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

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

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表

决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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

### （九）计票

#### 1、现场开会

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

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

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

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

#### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

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

### （十）生效与公告

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

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

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

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

（十一）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

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

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，以及本基金合同约定无需召开基金份额持有人大会的其他情形，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

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

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

### （三）基金财产的清算

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

#### 2、基金财产清算组

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

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

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

（4）基金财产清算的期限为 6 个月。

#### 3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

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

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

#### 6、基金财产清算的公告

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

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

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

#### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

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

## 附件二：基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人（或简称“管理人”）

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：高新

成立时间：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[1999]6 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币 18900 万元

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

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

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

### 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

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

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

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

基金管理人应将拟投资的债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

### 2、对基金投融资比例进行监督。

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

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

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

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

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

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

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

(8) 本基金投资固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

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

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



3、为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单。

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督。

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

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

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

（三）基金托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规

定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

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

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务监督和核查

1、在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

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、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、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。

### 四、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的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、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）《基金合同》生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，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》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

#### （三）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

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

3、本基金银行账户的开立和使用，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其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以本基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

#### （五）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本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转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、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的，涉及相关账户的开设、使用的，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。

#### （六）债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后，基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、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。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

### 五、基金资产净值计算与复核

1、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该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的各类基金份额的基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后3位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、除本协议和《基金合同》另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以

弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

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

### （三）基金份额持有人名册的保管

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

## 七、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## 八、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准或备案。

### （二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

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