

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 基金合同

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二〇二一年三月

目 录

| | |
|---|----|
| 一、前言 | 3 |
| 二、释义 | 3 |
| 三、基金合同当事人 | 6 |
| 四、基金合同当事人的权利和义务 | 8 |
| 五、基金份额持有人大会 | 12 |
| 六、基金管理人、基金托管人的更换条件和更换程序 | 18 |
| 七、基金的基本情况 | 19 |
| 八、基金的发行、设立募集 | 20 |
| 九、基金的成立 | 21 |
| 十、基金的申购和赎回 | 21 |
| 十一、基金转换 | 27 |
| 十二、基金的托管 | 27 |
| 十三、基金的注册登记业务 | 27 |
| 十四、基金资料的保管 | 28 |
| 十五、基金的销售及服务代理 | 29 |
| 十六、基金的投资管理 | 29 |
| 十七、基金的融资 | 34 |
| 十八、基金的非交易过户与转托管 | 34 |
| 十九、基金资产 | 34 |
| 二十、基金资产估值 | 35 |
| 二十一、基金费用与税收 | 40 |
| 二十二、基金的收益与分配 | 42 |
| 二十三、基金的会计与审计 | 43 |
| 二十四、基金的信息披露 | 43 |
| 二十五、基金的终止和清算 | 48 |
| 二十六、业务规则 | 50 |
| 二十七、违约责任 | 50 |
| 二十八、争议的处理和适用法律 | 50 |
| 二十九、基金合同的效力 | 51 |
| 三十、基金合同的修改和终止 | 51 |
| 三十一、其它事项 | 52 |
| 三十二、基金合同当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日 | 52 |

一、前言

为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范长城久泰沪深300指数证券投资基金的运作，依照1997年11月14日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、2000年10月8日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《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》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）及其它有关规定，在平等自愿、诚实信用和充分保护基金投资者合法权益的原则的基础上，特订立《长城久泰沪深300指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“本基金合同”）。

本基金合同的当事人包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金持有人。基金发起人、基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自取得依本基金合同所发行的基金单位起，即成为基金持有人和本基金合同的当事人，其持有基金单位的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。本基金合同的当事人按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其它有关规定享有权利，同时需承担相应的义务。

长城久泰沪深300指数证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）由长城基金管理有限公司按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定发起，经中国证监会批准设立。该批准并不表明中国证监会对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，亦不表明投资于本基金没有风险。投资者投资于本基金，必须自负风险。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。

基金管理人保证将按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但由于证券投资具有风险，因此本基金并不保证一定盈利，也不保证基金持有人的最低收益。基金投资者赎回所持基金单位时，所得的金额可能高于或低于先前认购、申购基金时所支付的金额。

本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 《暂行办法》：指1997年11月14日经国务院批准发布并施行的《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则
- 《试点办法》：指2000年10月8日由中国证监会发布并施行的《开放式证券投资基金试点办法》
- 《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
- 《指数基金指引》：机关对其不时做出的修订
指中国证监会2021年1月22日颁布、同年2月1日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》及
- 中国证监会：颁布机关对其不时做出的修订
- 中国银监会：指中国证券监督管理委员会
- 基金或本基金：指中国银行业监督管理委员会
指依据本基金合同所设立的长城久泰沪深300指数证券投资
- 基金合同或本基金 资基金
- 合同：指《长城久泰沪深300指数证券投资基金基金合同》及对本
- 招募说明书：基金合同的任何修订和补充
- 基金产品资料概要：指《长城久泰沪深300指数证券投资基金招募说明书》及其
更新
指《长城久泰沪深300指数证券投资基金基金产品资料概要》
- 《信息披露办法》：及其更新
指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其
- 发行公告：不时做出的修订
- 元：指《长城久泰沪深300指数证券投资基金发行公告》
- 基金合同当事人：指人民币元
指受本基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义
- 基金发起人：人和基金持有人
- 基金管理人：指长城基金管理有限公司
- 基金托管人：指长城基金管理有限公司
- 基金销售机构：指招商银行股份有限公司

| | |
|----------|---|
| 直销机构: | 指基金管理人的直销机构及代销机构 |
| 代销机构: | 指长城基金管理有限公司 指接受长城基金管理有限公司委托代为办理本基金销售业务的机构 |
| 基金注册登记人: | 指办理基金注册与登记过户业务的机构。本基金的注册登记人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基金注册登记业务的机构 |
| 投资者: | 指投资于本基金的个人投资者和机构投资者 |
| 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 |
| 机构投资者: | 指在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续、依法可投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织，以及中国证监会批准的合格境外机构投资者 |
| 基金成立日: | 指基金达到法定成立条件后，基金发起人宣布基金成立的日期 |
| 基金设立募集期: | 指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段，最长不超过3个月 |
| 存续期: | 指基金成立并存续的不定期之期限 |
| 开放日: | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日 |
| 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 |
| T 日: | 指申购、赎回或其它交易的申请日 |
| 认购: | 指投资者在本基金募集期内购买本基金单位的行为 |
| 申购: | 指投资者在本基金存续期间提出申请购买本基金单位的行为 |
| 赎回: | 指本基金的持有人在基金存续期间要求基金管理人购回其所持有的部分或全部基金单位的行为 |
| 基金帐户: | 指基金注册登记人记录投资者持有的基金单位余额和基金变更情况的帐户 |
| 基金交易帐户: | 指基金销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖基金份额、基金份额变动及资金结余情况的帐户 |
| 基金单位: | 指基金发起人向不特定的投资者发行的，表示持有人对基金享有资产所有权、收益分配权和其它相关权利，并承担相应义务的凭证 |
| 基金收益: | 指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、 |

| | |
|------------|--|
| 基金资产总值: | 银行存款利息以及其它收益 |
| 基金资产净值: | 指基金所购买各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其它投资所形成的价值总和 |
| 估值或基金资产估值: | 指基金资产总值减去负债后的价值 |
| 流动性受限资产: | 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 |
| 摆动定价机制: | 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 |
| 基金份额类别: | 指当开放式基金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 |
| A 类基金份额: | 指根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,并分别计算和公告基金份额净值 |
| C 类基金份额: | 指在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别 |
| 销售服务费: | 指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别 |
| 指定媒体: | 指从C类基金份额的基金资产中计提的,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 |
| | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介 |

三、基金合同当事人

(一) 基金发起人

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：王军

成立时间：2001 年 12 月 27 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元

存续期间：持续经营

(二) 基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：王军

成立时间：2001 年 12 月 27 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元

存续期间：持续经营

(三) 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

设立日期：1987 年 4 月 8 日

批准设立机关：中国银监会

批准设立文号：银监复（2004）108 号

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：252.20 亿元

存续期间：持续经营

（四）基金持有人

基金投资者自依据本基金合同的规定认购、申购、继承、受赠或以其他合法方式持有了本基金单位，即成为基金持有人，其持有基金单位的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，也就成为本基金合同的当事人。基金持有人成为本契约的当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。

四、基金合同当事人的权利和义务

（一）基金发起人的权利和义务

1、基金发起人的权利

- （1）申请设立基金；
- （2）法律法规及基金合同规定的其他权利。

2、基金发起人的义务

- （1）遵守基金合同；
- （2）向中国证监会提交法律规定的申请设立基金所需的文件；
- （3）公告招募说明书和发行公告；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- （5）基金不能成立时在法定的时间内退还所募集资金本息并承担发行费用；
- （6）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

- （1）自本基金成立之日起，依据本基金合同及有关法律运用本基金资产；
- （2）依照《暂行办法》、《试点办法》及其它有关规定，代表基金对被投资的上市公司行使股东权利；
- （3）依据本基金合同及有关法律监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律对基金资产或基金持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，必要时应采取保护措施保护基金投资者的利益；
- （4）选择、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- （5）提议召开基金持有人大会；
- （6）担任注册登记人或委托其他机构担任注册登记人或更换注册登记人；
- （7）直接销售基金单位，获取认购（申购）费用；

- (8) 依据基金合同的规定获得基金管理费收入及其他法定或约定的收入；
- (9) 依据本基金合同及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- (10) 在法律、法规规定和基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理基金单位的申购和赎回；
- (11) 基金终止时，组建或参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (12) 法律法规及基金合同规定的其它权利。

2、基金管理人的义务

- (1) 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- (2) 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资产；
- (3) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购、赎回和其他业务或委托其它机构代理这些业务；
- (4) 设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与登记过户工作或委托其他机构代理该项业务；
- (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，保证所管理的基金资产和管理人的自有资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- (6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他法律法规的规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 负责基金注册与登记过户。基金管理人应严格按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定，为基金投资者办理基金注册与登记过户，并接受基金托管人的监督；
- (9) 按规定计算并公告基金净值信息；
- (10) 编制基金季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》和本基金合同及其它有关规定履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》和本基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (13) 按规定向基金持有人分配基金收益；

- (14) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回、分红款项;
- (15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
- (16) 依据《暂行办法》、《试点办法》和本基金合同及其它有关规定召集基金持有人大会;
- (17) 保存基金的会计帐册、报表、记录 15 年以上;
- (18) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出; 并且保证投资者能够按照招募说明书公告的时间和方式查阅与基金有关的公开资料, 并得到有关资料的复印件;
- (19) 参加基金清算小组, 参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;
- (21) 因过错导致基金资产的损失, 应承担赔偿责任, 采取适当、合理的方式向基金投资者进行赔偿, 其过错责任不因其退任而免除;
- (22) 监督基金托管人按基金合同规定履行自己的义务, 基金托管人因过错造成基金资产损失时, 应为基金向基金托管人追偿;
- (23) 不从事任何有损基金及其它基金当事人利益的活动;
- (24) 遵守基金合同
- (25) 法律法规及基金合同规定的其它义务。

(三) 基金托管人的权利和义务

1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金资产;
- (2) 依据本基金合同约定获得基金托管费;
- (3) 监督本基金的投资运作, 发现基金管理人的指令违法、违规的, 有权不予执行, 并向中国证监会报告;
- (4) 监督基金管理人的注册与登记过户服务;
- (5) 法律法规及基金合同规定的其它权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同;
- (2) 依据本基金合同以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产;
- (3) 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备有足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金资产托管事宜;

(4) 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，确保基金资产的安全，保证其托管的本基金资产与基金托管人自有资产以及其它基金的资产相互独立；对不同的基金分别设置帐户，独立核算，分帐管理，保证不同基金之间在名册登记保管、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立；

(5) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；

(6) 保管基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同和有关凭证、资料；

(7) 以托管人和基金联名的方式为基金开设证券帐户，以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来，代理基金的资金结算业务；

(8) 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》、基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(9) 复核基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值；

(10) 采取适当、合理的措施，使本基金单位的认购、申购和赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

(11) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算本基金单位的认购、申购、赎回的方法符合《暂行办法》、《试点办法》、基金合同等有关法律文件的规定；

(12) 采用适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合《暂行办法》、《试点办法》基金合同及其它有关规定；

(13) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国银监会；

(14) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具托管人意见，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；

(15) 负责建立并保存基金持有人名册；

(16) 按有关规定，保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上；

(17) 按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；

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

(19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会

和中国银监会，并通知基金管理人；

- (21) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (24) 法律法规及基金合同规定的其它义务。

(四) 基金持有人的权利和义务

1、同一类别每份基金单位代表同等的权利和义务。

2、基金持有人的权利

- (1) 出席或者委派代表出席基金持有人大会，并对审议事项行使表决权；
- (2) 分享基金收益；
- (3) 按基金合同的规定查询或者获取公开的基金业务和基金财务状况资料；
- (4) 申购、赎回及其它对基金单位处分的权利，并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金单位；

(5) 因基金管理人或基金托管人或基金注册登记人或基金销售机构的过错导致利益受到损害时，有要求赔偿的权利；

- (6) 获取基金清算后的剩余资产；
- (7) 法律法规及基金合同规定的其它权利。

3、基金持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- (3) 在所持有的基金单位范围内承担基金亏损或者终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动；
- (5) 法律法规及基金合同规定的其它义务。

(五) 本基金合同当事各方的权利和义务以本基金合同为依据，不因基金资产帐户名称的改变而有所改变。

五、基金份额持有人大会

(一) 本基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金的每一基金份额都拥有平等的投票权。

基金份额持有人大会决议须经基金份额持有人大会讨论通过。上述通过事项自表决通过

之日起生效。

(二) 基金份额持有人大会召开事由

有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- 1、变更基金合同(因相应的法律、法规发生变动导致必须对基金合同进行修改的情况除外)；
- 2、决定终止基金合同；
- 3、更换基金管理人；
- 4、更换基金托管人；
- 5、变更基金类型或转换基金运作方式；
- 6、与其他基金合并；
- 7、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 8、基金管理人和基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 9、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会；
- 10、中国证监会规定的其它情形以及法律法规及基金合同规定的其它事项。

(三) 基金份额持有人大会召集方式

- 1、在正常情况下,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、基金托管人发起召集基金份额持有人大会的，按照《证券投资基金运作管理办法》第三十八条执行；
- 4、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的,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十日内决定是否召集,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六十日内召开；基金管理人决定不召集或在规定时间内未能做出书面答复,代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集,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六十日内召开。如果基金托管人也决定不召集或在规定时间内未能做出书面答复,代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有

权自行召集,并应当至少提前三十日向中国证监会备案。基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

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。

(四) 基金份额持有人大会的通知

召开基金份额持有人大会,召集人必须至少提前三十日在中国证监会指定媒体上公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容:

- 1、会议召开的时间、地点和方式;
- 2、有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
- 3、代理投票授权委托书(内容要求包括但不限于委托人身份、代理人身份、代理权限、代理有效期限等)送达时间和地点;
- 4、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 5、会议拟审议的主要事项和议事日程;
- 6、会议的议事程序和表决方式;
- 7、会务常设联系人姓名、电话;
- 8、召集人需要通知的其他事项。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交、收取方式和截止时间。

(五) 基金份额持有人大会的召开方式

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开,也可以采取通讯等方式召开。

基金份额持有人大会的召开方式由召集人确定,但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表百分之五十以上基金份额的持有人参加,方可召开。

1、现场方式召开

由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席并行使表决权。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。

亲自出席会议者应持有基金份额的凭证、受托出席会议者应出具的委托人持有基金份额的凭证以及委托人的代理投票授权委托书应当符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定。

如果出席会议的持有人代表的基金份额未达到百分之五十以上,或有其他情况未达到现场开会的条件,则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为 15 天,但确

定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。再次开会仍然必须达到上述所有相关条件,才能视为有效。

2、通讯方式召开

通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1) 召集人按本基金合同的规定公告会议通知后,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;

(3)直接出具书面意见的基金份额持有人所提交的持有基金份额的凭证,以及受托代表他人出具书面意见的代理人所应出具的委托人持有基金份额的凭证和委托人的代理投票授权委托书应当符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定;

(4) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决;表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

如果以通讯方式开会达不到上述通讯方式开会的条件,或者召集人收到的出具书面表决意见书的基金份额持有人所代表的基金份额未能达到权益登记日基金总份额的百分之五十以上,则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为 15 天,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。再次开会仍然必须达到上述所有相关条件,才能视为有效。

(六) 基金份额持有人大会的议事内容与程序

1、议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项,如修改基金合同、决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、与其他基金合并、提高基金管理人或基金托管人报酬以及召集人认为需要提交基金份额持有人大会讨论的其它事项。

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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额百分之十以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召

开日前 15 天提交召集人。召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案应当在大会召开日前 10 天公告。

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日前 10 天公告,否则会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

召集人应按照以下原则对提案进行审核:

(1)关联性: 召集人负责对提案进行审议,如果提案所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,则可以提交大会审议; 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进行解释和说明。

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

单独或合并持有权益登记日基金总份额百分之十以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,以及基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,如未获得基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议其时间间隔不少于六个月。

2、议事程序

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(8)款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,在基金管理人未能主持大会的情况下,由基金托管人授权出席会议的代表主持; 如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额百分之五十以上多数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。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

在通讯方式开会的情况下,由召集人提前 30 天公布提案,在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决,在公证机构监督下形成决议。

(七) 基金份额持有人大会的表决

- 1、基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权;
- 2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1)一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上通过方为有效,除下列 B 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

(2)特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过方为有效。更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金合同、转换基金运作方式等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时,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无效表决。

5、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。

未经公告的事项不得表决。

(八) 计票

1、现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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,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。

(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)如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人的代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议,有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果;

(4)记票过程应当由公证机关予以公证。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(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。

(九) 生效与公告

基金份额持有人大会决议自作出之日起五日内应报中国证监会备案，自表决通过之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人均具有法律约束力。

基金份额持有人大会决议应在生效之日起 2 日内在中国证监会指定媒体公告。

六、基金管理人、基金托管人的更换条件和更换程序

（一）基金管理人、基金托管人的更换条件

1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，可更换基金管理人：

- （1）基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；
- （2）基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金持有人利益的；
- （3）代表 50%以上（不含 50%）基金单位的基金持有人要求基金管理人退任的；
- （4）中国证监会充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责的。

2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国银监会批准，可更换基金托管人：

- （1）基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；
- （2）基金管理人充分理由认为更换基金托管人符合基金持有人利益的；
- （3）代表 50%以上（不含 50%）基金单位的基金持有人要求基金托管人退任的；
- （4）中国银监会有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

（二）基金管理人、基金托管人的更换程序

1、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提名；
- （2）决议：基金持有人大会对被提名的基金管理人形成决议；
- （3）备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；
- （4）公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在中国证监会指定媒体上公告。新任基金管理人与原基金管理人进行资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人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生效后 2 日内在中国证监会指定媒体上联合刊登公告；

(5) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果基金管理人要求，新的基金管理人应按其要求替换或删除基金名称中的“长城”字样。

2、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提名；

(2) 决议：基金持有人大会对被提名的基金托管人形成决议；

(3) 备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；

(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在中国证监会指定媒体上刊登公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产托管的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由新任的基金管理人和新任的基金托管人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生效后 2 日内在中国证监会指定媒体上联合刊登公告。

七、基金的基本情况

1、基金名称：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金。

2、基金类型：契约型开放式。

3、基金投资目标：以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

4、基金单位面值：面值为 1.00 元。

5、基金存续期限：不定期

6、基金份额类别：本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。

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

投资人可自行选择申购的基金份额类别。

本基金有关基金份额类别的具体设置以及费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明

书中公告。根据基金销售情况，在符合法律法规及中国证监会规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别、调整现有基金份额类别的费率或者停止现有基金份额类别的销售等，或对基金份额分类办法及规则进行调整，而无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

八、基金的发行、设立募集

除法规另有规定外，任何与基金单位发行有关的当事人不得预留和提前发售基金单位。

（一）基金设立募集期：

自招募说明书公告之日起不超过 3 个月。

（二）发行对象：

合格的个人投资者和机构投资者（法律、法规和其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）。

（三）发行方式：

通过本基金销售机构（基金管理人的直销机构及代销机构的指定营业网点）同时公开发售。

（四）设立募集规模：

本基金不设固定的设立募集规模。

（五）有关本基金认购数额的计算：

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。其中，

认购费用 = 认购金额 × 认购费率

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份数 = 净认购金额 / 基金单位面值

认购基金单位份数四舍五入，保留到小数点后二位。

（六）认购费用：

本基金认购费率不高于认购金额（含认购费）1%。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等设立募集期间发生的各项费用。

（七）基金认购的规定：

1、投资者在设立募集期内可以多次认购基金单位，已受理的认购申请不允许撤销。

2、投资者在代销机构的指定营业网点首次认购最低金额为 1,000 元（含认购费），在直销机构的首次认购最低金额为 10 万元（含认购费），追加认购最低金额为 1,000 元（含认购费）。不设认购金额级差。

（八）首次设立募集期间认购资金利息的处理方式：

认购资金在设立募集期所生利息在认购期结束后计入投资者的认购金额中，折合成基金份额，归投资者所有。

九、基金的成立

（一）基金的成立

本基金自招募说明书公告之日起三个月内，在基金净认购金额超过 2 亿元，且认购户数达到或超过 100 户的条件下，基金发起人依据《试点办法》及招募说明书的规定可以停止发行，并宣告本基金成立；否则本基金不能成立。

本基金成立前，投资者的认购款项必须存入指定商业银行的专用帐户，不作它用。

（二）基金不能成立时已募集资金的处理方式

本基金不能成立时基金发起人承担全部的募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在募集期结束后 30 天内退还给基金认购人。

（三）基金存续期内的基金持有人数量和资金额

本基金成立后的存续期间内，有效基金持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金管理人应当在出现该种情况后的第二个工作日向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。存续期内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金管理人将宣布本基金终止，并报中国证监会批准。若中国证监会另有规定的，则按其规定办理。

十、基金的申购和赎回

（一）基金投资者范围

合格的个人投资者和机构投资者（法律、法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）。

（二）申购与赎回的场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销机构及基金代销机构的指定营业网点进行，具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或者基金管理人网站披露并不时更新的销售机构名录中列明。本基金管理人同时考虑，在国内的电子结算和其它技术成熟的时候，投资者可通过本基金销售机构以电话、传真或网上等形式进行申购与赎回。

（三）申购与赎回办理的时间

基金管理人有权决定基金的申购自基金成立后的某个工作日开始办理，但应自基金成立之日起最迟不超过三个月开始办理，基金管理人在申购开放前的 3 个工作日必须在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

基金的赎回自基金成立之日起最迟不超过三个月开始办理。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日，在开放日的具体业务办理时间由基金管理人与销售机构约定。在确定了基金开放日申购与赎回的时间后，由基金管理人最迟在开放前的 3 个工作日连续予以公告。

基金管理人如果对申购、赎回时间进行调整，应报中国证监会备案，并在中国证监会指定媒体上公告。

（四）申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的该类基金份额净值为基准进行计算
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
- 3、申购费用按单笔申购申请金额对应的费率计算；
- 4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销；
- 5、基金管理人在不损害基金持有人权益的情况下，可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前的 3 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登公告。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的手续，向基金销售机构提出申购或赎回的申请。投资者在申购本基金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，必须有足够的基金单位余额。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以收到申购或赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，并在收到申请后的 1 个工作日内(T+1 日)对该交易的有效性进行确认。投资者可在 2 个工作日(T+2 日，

包括该日)之后向基金销售机构查询申购与赎回的成交情况。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式,若资金在规定时间内未全额到帐则申购不成功。若申购不成功或无效,申购款项将退回投资者帐户。

投资者赎回申请成功后,基金管理人应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(T+7)的时间内,支付赎回款项。

在发生巨额赎回的情形时,款项的支付办法参照本基金合同的有关条款处理。

(六) 申购与赎回的数额限制

1、投资者首次申购最低金额和每次申购最低金额由基金管理人确定,具体规定请参见招募说明书或相关公告;

2、本基金每次赎回最低份额为 100 份基金单位,基金持有人可将其全部或部分基金单位赎回;

3、基金管理人可根据市场情况,调整对首次申购金额、每次申购金额和赎回份额的数量限制,调整前的 3 个工作日基金管理人必须在中国证监会指定媒体上刊登公告;

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基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见相关公告;

5、申购份额、余额的处理方式:申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日该类基金份额净值为基准计算,保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分四舍五入,舍去部分所代表的资产归基金所有;

6、净赎回金额的计算:净赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值为基准并扣除相应的费用,保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分四舍五入,舍去部分所代表的资产归基金所有。

(七) 申购份额与赎回支付金额的计算方式

1、本基金申购份额的计算:

本基金 C 类基金份额不收取申购费。本基金 A 类基金份额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)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日 A 类基金份额的基金份额净值

对于 C 类基金份额的申购：申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

2、本基金赎回支付金额的计算：

本基金的赎回支付金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

赎回支付金额=赎回金额-赎回费用

3、T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 工作日内公告。遇特殊情况，本基金各类基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并依法报中国证监会备案。

4、本基金的申购费用由 A 类基金份额的申购人承担，不列入基金资产，用于市场推广、销售等各项费用。基金赎回费用由赎回人承担，对持续持有期少于 7 日的投资者需收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的投资者，所收取赎回费的 10% 归入基金资产，其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

5、本基金 C 类基金份额不收取申购费。本基金 A 类基金份额的申购费率最高不超过 1.5%，对持续持有期少于 7 日的各类基金份额的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，对持续持有期不少于 7 日的 A 类基金份额的投资者收取的赎回费率最高不超过 0.5%，对持续持有期不少于 7 日的 C 类基金份额的投资者不收取的赎回费。本基金的实际执行费率由基金管理人决定。本基金的申购费率和赎回费率在最新的招募说明书中列示。基金管理人认为需要调整费率时，如果没有超过上述费率限额的，基金管理人可以自行调整，基金管理人必须于新的费率开始实施日前的 3 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登公告；如果超过上述费率限额的，必须召开持有人大会，修改基金合同。

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。

（八）申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记人在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金。

投资者赎回基金成功后，注册登记人在 T+1 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金在单个开放日内，基金的净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额）超过上一日基金单位总份数的 10% 时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

（1）巨额赎回申请发生时，基金管理人可选择下面两种方式进行处理：

①全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时，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可能导致基金持有人的利益受损或无法实现时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个帐户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入第二个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的该类基金份额净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

③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 20% 的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。

（2）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付时，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，并在两日内在指定媒体上刊登公告。

（3）本基金连续两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，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在中国证监会指定媒体公告。

（十）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

（1）基金管理人认为基金资产规模过大，市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有的基金持有人利益产生损害；

（2）基金管理人、基金托管人、基金代销机构或基金注册登记人的技术保障或人员支

持等不充分；

(3) 由于不可抗力而导致基金无法正常运行；

(4) 证券交易所交易时间非正常停市；

(5) 基金管理人认为会有损于现有基金持有人利益的其他申购；

(6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时，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；

(7) 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；

(8) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它可暂停申购的情形。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资者的赎回申请：

(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常运行；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市；

(3) 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(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；

(5) 法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可兑付部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未兑付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的各类基金份额净值为依据计算赎回金额。在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资者在申请赎回时可选择将当日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。

3、发生基金合同、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资者的申购、赎回

申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在中国证监会指定媒体公告。

(十一) 重新开放申购或赎回的公告

暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应予公告。如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在中国证监会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一个开放日的各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停期间结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停期间结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日在中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

十一、基金转换

基金转换是指本基金持有人可按规定申请将所持有的本基金份额转换为本基金管理人所管理并在同一注册登记人处登记的其它开放式基金份额。有关业务规则和费率安排由基金管理人另行公告。

十二、基金的托管

本基金资产由基金托管人持有并保管。基金管理人和基金托管人应按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其它有关规定就本基金的托管事项订立《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》，用以明确基金托管人与基金管理人之间在基金资产的保管、基金资产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金资产的安全，保护基金持有人的合法权益。

十三、基金的注册登记业务

本基金的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帐户管理、基金单位注册登记、基金交易确认及清算、代理发放红利、建立并保管基金持

有人名册等业务。

本基金的注册登记业务目前由基金管理人负责办理。基金管理人设立了专门的注册登记部门负责本开放式基金的注册登记、存管、清算和交收业务等。基金管理人根据业务需要也可以委托其他符合条件的机构代理办理注册登记业务，但应与代理机构签署委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金帐户管理、基金单位注册登记、基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金持有人的合法权益。

基金注册登记人享有如下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、保管基金持有人开户资料、交易资料、基金持有人名册等；
- 3、法律法规规定的其他权利。

基金注册登记人承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 3、保存基金持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 4、对基金持有人的基金帐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，但司法强制检查及法律法规规定的其它情形除外；
- 5、法律法规规定的其他义务。

基金管理人在办理或委托其它机构办理本基金的注册登记业务时，因过错造成投资者或基金持有人损失时，基金管理人应按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其它有关规定予以赔偿。

十四、基金资料的保管

（一）资料保管的内容与分工

1、由基金管理人负责保管的资料

- （1）基金持有人开户资料；
- （2）基金持有人交易资料和帐户变更资料；
- （3）基金的会计帐册、报表和记录；
- （4）基金持有人名册；

(5) 法律、法规规定的其它需保管的资料。

2、由基金托管人负责保管的资料

- (1) 基金持有人名册；
- (2) 基金的会计帐册、报表和记录；
- (3) 与基金资产有关的对外签署的全部合同(席位租用合同除外)的正本；
- (4) 法律、法规规定的其它需保管的资料。

(二) 资料保管的期限

- 1、属于基金会计档案方面的资料按照国家有关规定执行；
- 2、开户资料保存期限为 15 年；
- 3、基金交易资料或帐户变更资料保存期限为 15 年；
- 4、基金持有人名册保存按有关规定执行；
- 5、其它有关资料的保管期限按照国家有关法律、法规执行。

十五、基金的销售及服务代理

本基金的认购、申购、赎回及相关的客户服务等业务由基金管理人和基金管理人委托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上述业务的，应与代理人按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其它有关规定就本基金的销售和服务事项签订《长城久泰指数证券投资基金销售代理协议》。订立代销协议的目的是为了明确基金代销机构和基金管理人之间在基金单位认购、申购、赎回以及相关的客户服务等事宜中的权利、义务和职责，确保基金资产的安全，保护基金持有人的合法权益。

十六、基金的投资管理

(一) 投资目标

以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

(二) 投资对象

本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票（含存托凭证），包括沪深 300 指数的成份股（投资组合中持有的沪深 300 指数成份股的数量不低于 240 只）；因增强性投资而选择的其他投资品种（含存托凭证）；在不增加额外风险的前提下，还可适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发、存托凭证），以提高收益水平。

本基金债券投资部分主要投资于国债、政策性金融债。

(三) 目标指数

本基金为增强型指数基金，以沪深 300 指数为目标指数。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取的 300 只 A 股作为样本编制而成的指数。它是国内第一条由上海证券交易所和深圳证券交易所联合编制、发布的全市场指数,成份股流动性高,可投资性强,综合反映了中国证券市场最具市场影响力的一批蓝筹股的整体状况,反映 A 股市场总体发展趋势。

(四) 投资理念

以指数化投资为主，辅以适度的积极管理，分享中国经济增长的长期收益。

本基金认为中国宏观经济将保持持续稳定增长的态势，为指数化投资获得长期稳定收益奠定了良好的宏观经济基础。本基金通过跟踪同步于中国资本市场长期增长的有代表性的指数，使投资者充分分享中国经济增长的长期收益。

(五) 投资策略

1、资产配置策略

本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。

在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 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。

本基金运作过程中，当目标指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

2、股票（含存托凭证）投资策略

(1) 指数化投资

本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。

非成份股的入选主要基于以下原因：①有望入选沪深 300 指数的准成份股；②少量为提高组合流动性而可能投资的其他品种；③新股配售得到的非成份股，本基金将在新股上市后 1 个月以内择机卖出此类股票。

成份股出现以下几种情况可剔除：①公司经营状况、财务状况恶化，基本面发生重大变化，导致投资价值严重降低的上市公司；②成份股中流动性太差的个股。

（2）增强性投资

指数化基础上的增强投资将通过证券选择实现。基金管理小组将对组合品种的流动性和公司基本面进行评估，根据沪深 300 指数的行业配置情况，采取有限度的增强投资。

① 流动性优化

组合品种的流动性评价指标包括：股票的流通市值、股票近半年的累积换手率、单位换手率对应的当日股票价格波动幅度（B 值）， $B = (H - L) / V / CAP$ ，H 为当日最高价，L 为当日最低价，V 为当日成交量，CAP 为流通股本。

要求组合品种的流动性同时达到以下要求：近半年累积换手率居前 4/5，近半年的累积 B 值居前 4/5，优先选择大市值股票。

② 基本面优化

本基金基于对上市公司及行业的基本面分析对指数化投资组合进行优化，具体而言，本基金将提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

- A. 上市公司基本面较好，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力；
- B. 中长期估值水平明显高于目前股价水平，在同行业中，股票相对价格偏低；
- C. 预期将纳入指数的个股；
- D. 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成份股。

本基金将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重（极端情况下可降低至零）：

- A. 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑；
- B. 中长期估值水平明显低于目前股价水平；在同行业中，股票相对价格偏高；
- C. 短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调；
- D. 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

3、债券投资策略

本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。

（六）投资范围

在正常情况下,本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 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。

(七) 业绩比较基准

95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

(八) 组织架构和投资决策程序

本基金管理人内部设立基金投资部、研究策划部、集中交易室、监察稽核部、投资决策委员会和风险控制委员会,进行基金资产的投资和风险控制。基金管理实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策程序如下:

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

2、公司研究策划部负责建立和维护公司股票基本库,入选基本库的股票为各基金可以投资的股票,提供各入选股票的基本面情况及投资要点分析;在公司股票基本库的基础上,研究策划部与本基金管理小组研究建立符合本基金合同规定和投资需求的股票投资备选库。

3、本基金管理小组在基金经理的领导下,在对经济形势和市场运作态势进行讨论分析后,拟定下一阶段基金投资持仓比例,明确股票、债券、现金和融资比例,做出《资产配置提案》和重点个股投资方案,报投资决策委员会讨论。

4、投资决策委员会在基金经理上报的资产配置提案的基础上,进行讨论并确定下一阶段的资产配置和重点个股投资决定,会议决定以书面形式下达给基金经理。

5、根据决策委员会确定的资产配置决议和重点个股投资决定,基金经理负责在股票投资备选库中选择拟投资的个股制定投资组合方案。

6、在基金经理权限内的投资，由基金经理自主实施；超过基金经理权限的，根据规定须经报经投资决策委员会执行委员或投资决策委员会批准的，须经报批后实施。

7、公司研究策划部负责开发基金投资组合的分析评价体系及其他辅助分析统计工具，对本基金投资组合进行定期跟踪分析，为基金经理和投资决策委员会提供决策支持。

（九）投资组合

1、本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种，不受前述比例限制；

2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种，不受前述比例限制；

3、本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

4、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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

5、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；

6、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。

7、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

8、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

（十）投资限制

1、本基金不得投资于其他基金；

2、本基金不得将基金资产用于抵押、担保；

3、本基金不得从事证券信用交易；

4、本基金不得进行房地产投资；

5、本基金不得从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

6、本基金不得将资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券，但为完全按照标的指数构成比例进行证券投资的除外；

7、本基金不得从事法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

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

(十一) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

1、不谋求对所投资企业的控股或者进行直接管理；

2、所有参与行为均应在合法合规和维护基金投资者利益的前提下进行，并谋求基金资产的保值和增值。

十七、基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

十八、基金的非交易过户与转托管

(一) 非交易过户

基金注册登记人受理继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。其中继承是指基金持有人死亡，其持有的基金单位由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金持有人将其合法持有的基金单位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持有人持有的基金单位强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其它组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理，并按基金注册登记人规定的标准收取过户费用。

(二) 转托管

基金持有人可办理已持有基金单位在不同销售机构之间的转托管，转入到直销机构需符合有关最低金额的规定。投资者在进行转托管时，可以将一个销售机构的基金份额全部或部

分转出。办理转托管业务的基金持有人需在原销售机构办理转托管转出手续，然后在拟转托管转入的销售机构办理转托管转入手续，基金单位将在注册登记确认后自动转入持有人指定的销售机构。转托管业务收取一定的固定手续费。

十九、基金资产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金资产的帐户

本基金以托管人和基金联名的方式开设证券帐户，以基金托管人名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户应与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记人自有的资产帐户以及其它基金资产帐户相独立。

（四）基金资产的处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的自有资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人和基金销售机构以其自有资产承担自身的法律责任，其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押或其它权利。除依《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其它有关规定处分外，基金资产不得被处分。

二十、基金资产估值

（一）估值目的

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

（二）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场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

基金依法拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（四）估值方法

1、股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如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) 未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

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市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

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

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法：

(1) 证券交易所市场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；

(2) 证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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净价估值；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) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 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，按成本进行后续计量；

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

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

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值方法：

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

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值；

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

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

5、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。

6、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。

7、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。

(五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人与基金托管人同步进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务章后以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误加盖业务章后返回给基金管理人。

月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

(六) 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它原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理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；
- 4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 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一致的，基金管理人应当暂停基金估值；
- 6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金份额净值估值错误的确认及处理方式

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单位资产估值的准确性和及时性。各类基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。当基金资产的估值导致某一类基金份额净值小数点后四位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

- 1、差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或

其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

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

4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 某一类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) 因某一类基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(八) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理；

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

二十一、基金费用与税收

(一) 基金费用

1、基金费用的种类：

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) C 类基金份额的销售服务费；
- (4) 证券交易费用；
- (5) 基金法定信息披露费用；
- (6) 基金持有人大会费用；
- (7) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式**(1) 基金管理人的管理费**

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.98% 年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.98\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，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

基金托管费按前一日的基金资产净值的 2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.3% 年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(4) 上述 1 中 (4) 至 (8) 项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金持有人大会决议通过。

(二) 基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家有关税收法律、法规执行。

二十二、基金的收益与分配

(一) 收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券已实现价差、银行存款利息以及其它合法收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

(二) 收益分配原则

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每份基金单位享有同等分配权；

2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

3、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；

5、在符合有关分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益可以不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

6、投资者可以选择现金分红方式或红利再投资方式，默认方式为现金分红方式，投资者分红方式的变更须在分红权益登记日前向销售机构提出申请；

7、红利分配时所发生的银行转帐或其它注册登记费用由投资者自行承担。基金管理人若收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定；

8、法律法规以及中国证监会的其它规定。

（三）收益分配方案

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

（四）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，经基金托管人核实后确定，在 2 日内在指定媒体公告。

二十三、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会计责任人；

2、基金的会计年度为公历每年 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：如果基金成立少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；

4、会计制度执行国家有关的会计制度；

5、本基金独立建帐、独立核算；

6、本基金管理人和基金托管人各自保留完整的基金会计帐目、凭证（原始凭证由基金托管人保管）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）基金审计

1、本基金管理人聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度报表及其他规定事项进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人和基金托管人同意。

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在指定媒体公告。

二十四、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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

（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、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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、法人和非法人组织的祝贺性、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不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

（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，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

（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。

（4）基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

2、发行公告

本基金管理人按照《暂行办法》及其实施准则、《试点办法》的有关规定编制并发布发行公告。

3、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。

4、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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

5、基金定期报告，包括基金年度报告、中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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、中期报告或者年度报告。

如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，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

6、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- (2) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13) 基金管理人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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- (14) 基金收益分配事项；
- (15) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (17) 本基金开始办理申购、赎回；
- (18) 本基金发生巨额赎回并延期办理；
- (19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- (20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (21) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- (22) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；
- (23) 基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

7、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，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。

8、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备案，并予以公告。

9、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，指定专门部门及高级管理人员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等法规的规定。

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、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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介披露信息，但是其他公共媒介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 10 年。

（七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

投资者按上述方式所获得的文件或其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

二十五、基金的终止和清算

（一）基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

- 1、存续期内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金管理人将依照法律法规规定的程序宣布本基金终止；
- 2、基金经持有人大会表决终止的；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其它适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；
- 5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它适当的托管机构承受其原有权利及义务；
- 6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 7、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 8、中国证监会允许的其它情况。

(二) 基金的清算

1、基金清算小组

- (1) 自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算；
- (2) 基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘请必要的工作人员；
- (3) 基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金清算程序

- (1) 基金终止后，发布基金清算公告；
- (2) 由基金清算小组统一接管基金资产；
- (3) 对基金资产和负债进行清理和确认；
- (4) 对基金资产进行估值和变现；
- (5) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (6) 公布基金清算结果公告；
- (7) 进行基金剩余资产的分配。

3、清算费用

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

4、基金资产按下列顺序清偿

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

5、基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后三个工作日内公告。清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

6、基金清算帐册及文件的保存

基金清算帐册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

二十六、业务规则

基金合同当事人应遵守《长城基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》。该规则由基金管理人在符合法律法规及本基金合同规定的前提下制订，并由其解释与修改。

二十七、违约责任

(一) 由于基金合同一方当事人的过错，造成基金合同不能履行或不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属基金合同双方或多方当事人的过错，根据实际情况，由双方或多方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况时，当事人可以免责：

- 1、不可抗力；
- 2、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律、法规及有关规定或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；
- 3、在没有欺诈或过失的情况下，基金管理人由于按照本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) 当事人违反基金合同, 给其他方造成直接损失的, 应进行赔偿。

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

(四) 因第三方的过错而导致本基金合同当事人一方违约, 并造成其他当事人损失的, 违约方并不因此免除其赔偿责任。

二十八、争议的处理和适用法律

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, 如经友好协商或调解未能解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对当事人均有约束力。

本基金合同受中国法律管辖。

二十九、基金合同的效力

(一) 本基金合同经基金发起人、基金管理人、基金托管人三方盖章以及三方法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。本基金合同的有效期限自生效之日起至该基金清算结果报中国证监会批准并公告之日止。基金持有人根据本基金合同的规定依法持有本基金单位即表示对本基金合同的承认和接受。

(二) 本基金合同自生效之日起对本基金合同的各方当事人具有同等的法律约束力。

(三) 本基金合同正本一式十份, 除上报中国证监会和中国银监会各二份外, 基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有二份, 每份具有同等的法律约束力。

(四) 本基金合同存放在基金管理人和基金托管人的营业场所, 投资者可免费查阅, 也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件; 如涉及争议事项需协商、仲裁的, 应以基金合同正本为准。

三十、基金合同的修改和终止

(一) 基金合同的修改

- 1、本基金合同的修改应经基金发起人、基金管理人和基金托管人同意;
- 2、修改本基金合同应召开基金持有人大会, 基金合同修改的内容应经基金持有人大会决

议通过；

3、基金合同的修改应报中国证监会批准，自批准之日起生效；但出现下列情况时，可不经基金持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后修改公布，并报中国证监会备案：

- (1) 因相应的法律、法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形；
- (2) 基金合同的修改并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；
- (3) 因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

(二) 基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

- (1) 存续期间内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人将依照法律法规规定的程序宣布本基金终止；
- (2) 基金持有人大会表决终止的；
- (3) 因重大违法行为，基金被中国证监会责令终止的；
- (4) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其它适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；
- (5) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它适当的托管机构承受其原有权利及义务；
- (6) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤消；
- (7) 出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- (8) 中国证监会允许的其它情形。

2、基金合同的终止

本基金终止后，应当依照有关法律法规和本基金合同的规定对基金进行清算。本基金合同于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

三十一、其它事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

三十二、基金合同当事人盖章及其法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日

(见下页)

（此页无正文）

基金发起人：长城基金管理有限公司（章）

法定代表人（签字）：

（或授权代理人）

基金管理人：长城基金管理有限公司（章）

法定代表人（签字）：

（或授权代理人）

基金托管人：招商银行股份有限公司（章）

法定代表人（签字）：

（或授权代理人）

签订地：深圳市

签订日： 年 月 日