

长盛全债指数增强型债券投资基金 招募说明书（更新）

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示

本基金于2003年7月30日经中国证监会证监基金字【2003】90号文批准募集。

本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。

本基金标的指数为标普中国全债指数。

标的指数样本选取方法：1) 上市地点：上海证券交易所、深圳证券交易所及中国银行间市场；2) 债券币种：人民币；3) 债券剩余期限：剩余到期日必须自重新调整日期起超过或等于一年；4) 发行人：证券必须是中国中央政府发行的主权债券，或中国三家政策性银行（国家开发银行股份有限公司、中国农业发展银行和中国进出口银行）之一发行的政府机构债券及企业实体发行的企业债券；5) 票息类型：固定利率、零息、递增、固定利率转浮动利率及浮动利率；6) 除外情况：通胀挂钩证券、具有嵌入期权的证券（例如可赎回债券、可偿债债券、可延长债券或可卖回债券）、可转换债券；7) 规模：主权债券200亿以上，机构债券150亿以上，企业债券20亿以上；8) 信用评级质量：新发行的企业债券必须至少得到下列中国本土评级机构之一的评级，以便在下次重新调整时予以考虑。主权债券或机构债券并无评级标准。中诚信国际信用评级有限责任公司、联合资信评估股份有限公司、大公国际资信评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、鹏元资信评估股份有限公司、东方金诚国际信用评级有限公司、中

诚信证券评估有限公司、上海远东资信评估有限公司、中债资信评估有限责任公司；发行评级企业债券最低信用评级为AA。未评级和违约债券，不再获得评级或已违约的证券将在下次重新调整时被移除。

有关标的指数具体编制方案及成份券等指数信息详见标准普尔公司网站，网址：<https://chinese.spindices.com/indices/fixed-income/sp-china-composite-bond-index>。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本招募说明书“风险提示”章节的具体内容。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，投资者不得办理侧袋账户份额的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本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。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2022年2月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2021年12月31日（财务数据未经审计）。

目 录

重要提示	1
目 录	3
一、绪言	4
二、释义	5
三、基金管理人	8
四、基金托管人	17
五、相关服务机构	20
六、基金的历史沿革	61
七、基金的募集	63
八、基金合同的生效	64
九、基金份额的申购与赎回.....	65
十、基金的侧袋机制	73
十一、基金的投资管理.....	76
十二、基金的业绩	88
十三、基金的资产	90
十四、基金资产估值	91
十五、基金的收益与分配.....	98
十六、基金的费用与税收.....	100
十七、基金的会计与审计.....	104
十八、基金的信息披露.....	105
十九、风险揭示	111
二十、基金的终止与清算.....	117
二十一、基金合同的内容摘要.....	119
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	132
二十三、对基金份额持有人的服务.....	137
二十四、其他应披露事项.....	138
二十五、招募说明书的存放及查阅方式.....	140
二十六、备查文件	141

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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“《流动性风险管理规定》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《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》”）等有关法规以及《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

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：

- 1、《基金合同》：指《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》
- 2、《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》
- 3、《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》
- 4、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 5、《信息披露办法》：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》及颁布机关对其不时做出的修订
- 6、《指数基金指引》：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》及颁布机关对其不时做出的修订
- 7、元：指人民币元
- 8、基金或本基金：指依据本《基金合同》所设立的长盛全债指数增强型债券投资基金
- 9、招募说明书或本招募说明书：指《长盛全债指数增强型债券投资基金招募说明书》及其更新
- 10、基金产品资料概要：指《长盛全债指数增强型债券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 11、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 12、基金管理人：指长盛基金管理有限公司
- 13、基金发起人：指长盛基金管理有限公司
- 14、基金托管人：指中国农业银行
- 15、基金销售代理人：指依据有关代理销售协议办理本基金申购、赎回和其他基金业务的代理机构

- 16、 基金登记注册人:指中国证券登记结算有限责任公司
- 17、 基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体
- 18、 个人投资人:指具有中国国籍的,有完全民事行为能力的自然人
- 19、 机构投资者:指经有关政府部门批准设立并在中国境内合法注册的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 20、 基金成立日:指自招募说明书公告之日起三个月内,在基金净销售额超过人民币 2 亿元,且认购户数达到或超过 100 户的条件下,基金发起人可以依据《试点办法》和实际发行情况停止发行,并宣告基金成立的日期
- 21、 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
- 22、 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
- 23、 T 日:指日常申购、赎回或其他交易的申请日
- 24、 日常申购:指基金投资人根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人提出购买基金单位的请求。基金的日常申购从基金成立后不超过 30 个工作日开始办理
- 25、 日常赎回:指基金投资人根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人提出卖出基金单位的请求。基金的日常赎回从基金成立后不超过 30 个工作日开始办理
- 26、 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、银行存款利息以及其他收益
- 27、 基金资产总值:基金资产总值是指基金所拥有的各类证券价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其它投资等所形成的资产总和
- 28、 基金资产净值:指基金资产总值减去负债后的价值。
- 29、 基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金单位净值的过程
- 30、 基金销售网点:指基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点
- 31、 指定媒体: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）等媒体

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

33、 摆动定价机制：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

34、 侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

35、 特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

三、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：深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3 层

法定代表人：高民和

电话：（010）86497888

传真：（010）86497666

联系人：张利宁

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 26 日成立，注册资本为人民币 20600 万元。截至目前，基金管理人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 2022 年 2 月 24 日，基金管理人共管理六十八只开放式基金和六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、董事会成员

高民和先生，董事长，高级工商管理硕士，审计师，资深注册会计师。曾任安徽省审计厅科员、副主任科员、主任科员，香港黄山有限公司财务部副经理，国元证券有限责任公司综合办公室主任、计划财务部经理、总会计师，国元股权投资有限公司董事长(法定代表人)，国元证券股份有限公司总会计师（财务负责人）。现任长盛基金管理有限公司董事长(法定代表人)，兼任安徽英科智控股份有限公司监事会主席。

周兵先生，董事，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，历任公司副总经理、总经理、董事长。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。

俞仕新先生，董事，中共党员，硕士研究生，经济师。曾任安徽省国际信托投资公司证券部副经理、经理、合肥分公司总经理（兼任研究发展中心主任、国信投资顾问咨询公司董事长），安徽国元信托投资有限责任公司副总裁、常务副总裁，安徽国元信托有限责任公司总裁、党委副书记，国元证券股份有限公司总裁、党委副书记。现任国元证券股份有限公司党委书记、董事长；兼任国元国际控股有限公司董事、安徽安元投资基金有限公司董事长、安徽安元创新风险投资基金有限公司董事长、安徽省股权服务有限责任公司董事。

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。

钟德兴先生，董事，学士，注册会计师。曾任职多个金融机构，包括新加坡安永会计师事务所、新加坡金融管理局、淡马锡控股私人有限公司和新加坡政府投资公司。现任新加坡星展银行有限公司策略规划部及生态系统部主管。

何昌顺先生，董事，经济学硕士。曾任安徽省计委综合处副主任科员、主任科员，安徽省国际信托投资公司证券经营部副经理（主持工作）、国投证券投资咨询公司副经理兼证券发行部副经理、投行部副总经理、投行部总经理，中银国际控股有限公司（北京代表处）投行部副总裁，中国证监会合肥特派办上市公司监管处副处长，中国证监会安徽监管局上市公司监管处副处长、处长，安徽省政府金融工作办公室副主任、主任、党组书记，省地方金融监管局（省政府金融工作办公室）局长（主任）、党组书记。现任安徽省投资集团控股有限公司董事长、党委书记。

江娅女士，董事，博士。曾任蚌埠市粮贸公司办公室副主任，蚌埠市政府办公室副主任科员、秘书三室副主任，共青团蚌埠市委副书记、党组成员，共青团蚌埠市委书记、党组书记，蚌埠市蚌山区委副书记、区长，蚌埠市委常委、宣传部长、政府副市长，铜陵市委常委、市政府副市长、党组副书记。现任安徽省信用担保集团党委委员、副总经理。

张仁良先生，独立董事，博士。现任香港教育大学校长、公共政策讲座教授，兼任香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席、香港永隆银行

独立董事及第十三届中国全国政协委员，同时亦为复旦大学顾问教授和上海交通大学兼任教授。曾任香港社会创新及创业发展基金专责小组主席，太平洋经济合作香港委员会主席、香港浸会大学工商管理学院院长。2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章、2007 年被委任为太平绅士，并于 2017 年获法国政府颁发棕榈教育军官荣誉勋章、2019 年获香港特区政府颁发银紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，学士。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、博士生导师、安徽大学经济与社会发展高等研究院执行院长、校学术委员会委员，安徽省政府决策咨询专家委员会委员，全国资本论研究会常务理事，全国马经史学会理事，安徽省经济学会副会长。

毕功兵先生，独立董事，博士研究生，曾任中国科学技术大学管理科学系主任、管理学院院长助理。现任中国科学技术大学教授，博士生导师，中国优选法统筹法与经济数学研究会常务理事，中国运筹学会随机服务与运作管理分会理事、秘书长，国风塑业股份有限公司独立董事。

杜愚先生，独立董事，法律硕士。先后任职鞍山冶金设计研究院技术经济工程师、北京融融担保投资有限公司副总经理、国咨资产投资经营有限责任公司总经理、世纪投资有限公司（BVI）执行董事，北京仁杜律师事务所主任、首席合伙人，担任多家公司法律顾问。

2、监事会成员

齐智洲先生，监事会主席，大学本科，高级会计师。历任安徽省信用担保集团担保三部总经理、综合计划部总经理。现任安徽省信用担保集团园区资产管理部（投资管理部）总经理。

李冷女士，监事，博士。曾任国网英大国际控股集团有限公司人力资源经理，安邦保险集团股份有限公司人力资源高级经理，北京普哲管理咨询有限公司合伙人。2018 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，历任人力资源部总监助理、副总监等职务。现任长盛基金管理有限公司人力资源部行政负责人。

魏斯诺先生，监事，英国雷丁大学硕士。曾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行政负责人，社保组合组合经理。

3、管理层成员

高民和先生，董事长，高级工商管理硕士，审计师，资深注册会计师。同上
周兵先生，总经理，经济学硕士。同上。

蔡宾先生，硕士，特许金融分析师 CFA。曾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，历任研究员、社保组合助理，投资经理，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，基金经理，兼任长盛创富资产管理有限公司董事长(法定代表人)。

郭堃先生，硕士。曾任上海浦东发展银行北京分行客户经理，阳光资产管理股份有限公司行业研究员、制造业研究组组长，泓德基金管理有限公司基金经理。2019 年 12 月加入长盛基金管理有限公司，历任基金经理，研究部总监等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，基金经理。

吴达先生，博士，特许金融分析师 CFA。曾任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、专户投资组合经理，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，历任基金经理，长盛创富资产管理有限公司总经理、国际业务部总监等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理、基金经理，兼任长盛基金（香港）有限公司副总经理。

张利宁女士，学士，注册会计师。曾任职于华北计算技术研究所财务部，太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司。1999 年 1 月起加入长盛基金管理有限公司，历任公司研究部业务秘书，业务运营部基金会计、总监，财务会计部总监，监察稽核部副总监、总监等职务。现任长盛基金管理有限公司督察长。

张壬午先生，硕士。曾任深圳市远望城多媒体电脑公司软件网络部软件开发员，深圳计量质量检测研究院技术部软件开发员。2000 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，历任信息技术部系统运营主管、信息技术部副总监等职务。现任长盛基金管理有限公司首席信息官，兼信息技术部行政负责人。

4、本基金基金经理

杨哲先生，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评级委员会委员。2013 年 9 月加入长盛基金管理有限公司。自 2018 年 6 月 11 日

起任长盛可转债债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 6 月 29 日兼任长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 2 日兼任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

王贵君先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师，上投摩根基金管理有限公司债券研究员，2017 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任投资经理助理、投资经理、专户理财部副总监，自 2020 年 12 月 17 日起任长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 13 日起兼任长盛安逸纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 9 日起兼任长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 25 日起兼任长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 9 月 23 日起兼任长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 2 日起兼任长盛稳鑫 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

王茜女士，自 2003 年 10 月 25 日至 2008 年 11 月 6 日任本基金（更名前）基金经理；刘静女士，自 2008 年 8 月 11 日至 2011 年 2 月 15 日任本基金（更名前）基金经理；梁婷女士，自 2011 年 2 月 15 日至 2013 年 3 月 21 日任本基金（更名前）基金经理；贾志敏先生，自 2013 年 3 月 21 日至 2014 年 10 月 24 日任本基金（更名前）基金经理；马文祥先生，自 2014 年 9 月 10 日至 2016 年 4 月 14 日任本基金（更名前）基金经理；马文祥先生，自 2016 年 4 月 15 日至 2018 年 6 月 29 日任本基金（更名后）基金经理；李琪先生，2018 年 6 月 29 日至 2019 年 9 月 6 日任本基金（更名后）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，总经理，硕士。同上。

郭堃先生，副总经理，硕士。同上。

蔡宾先生，副总经理，硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

魏斯诺先生，监事，硕士。同上。

赵楠先生，MBA。历任安信证券研究中心研究员，光大永明资产管理股份有

限公司权益投资部高级股票投资经理、资深股票投资经理、权益创新业务负责人、投行总部执行董事等职务。2015年2月加入长盛基金管理有限公司，现任权益投资部行政负责人，长盛新兴成长主题混合型证券投资基金基金经理，长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同锦研究精选混合型证券投资基金基金经理。

张谊然女士，硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础研究员分析员。2012年9月加入长盛基金管理有限公司，现任研究部行政负责人，长盛同益成长回报灵活配置混合型投资基金（LOF）基金经理，长盛同享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理。

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，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制基金季度报告、中期和年度基金报告；

7、计算基金资产净值并公告基金份额资产净值和基金份额累计净值，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、基本管理制度和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、岗位职责、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业务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

本公司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本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司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公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007

年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISA3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖;2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号;2020年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近310名,其中具有高级职称的专家60名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2021年12月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共691只。

(二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

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

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

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

五、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心3层

法定代表人：高民和

邮政编码：100029

电话：(010) 86497908、(010) 86497909

传真：(010) 86497997、(010) 86497998

联系人：张晓丽、吕雪飞

2、代销机构

(1) 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：谷澍

联系人：王震

电话：010-85108753

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(2) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：王凯

联系人：陈泾渭

电话：020-38321497

传真：020-87310955

客户服务电话：400-830-8003

公司网址：www.cgbchina.com.cn

(3) 河北银行股份有限公司

注册地址：河北省石家庄市平安北大街 28 号

办公地址：河北省石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人：梅爱斌

联系人：李博

电话：0311-88627587

传真：0311-88627027

客户服务电话：400-612-9999/0311-96368

公司网址：www.hebbank.com

(4) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

联系人：陈珊

电话：010-85237712 传真：010-85238680

客户服务电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

(5) 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：任德奇

联系人：王勇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(6) 平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：赵杨

电话：0755-22166574

传真：021-50979507

客户服务电话：95511-3

公司网址：bank.pingan.com

(7) 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：郑杨

联系人：周志杰

电话：021-61614934

传真：021-63604199

客户服务电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(8) 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：上海市浦东新区银城路 167 号

法定代表人：吕家进

联系人：李玮琳

电话：021—52629999

传真：021—62569070

客户服务电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

(9) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：缪建民

联系人：刘闯

电话：0755—83198888

传真：0755—83195050

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(10) 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：陈四清

联系人：王迪睿

电话：010-66104848

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(11) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

联系人：卢子琦

电话：010-67596233

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(12) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

联系人：穆婷

电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(13) 中国银行股份有限公司

注册地址：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：刘连舸

联系人：史辰方

电话：010-66594633

传真：010-66594791

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(14) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：张金良

联系人：李雪萍

电话：010-68858097

传真：010-68858057

客户服务电话：95580

公司网址：www.psbc.com

(15) 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 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：朱鹤新

联系人：王晓琳

电话：010-89937325

传真：010-85230049

客户服务电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

(16) 安信证券股份有限公司

安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：黄炎勋

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

客户服务电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

(17) 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

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：安志勇

联系人：王星

电话：022-28451922

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：www.ewww.com.cn

(18) 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

(19) 长城证券股份有限公司

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

(20) 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

办公地址：上海市世纪大道 1198 号一座世纪汇广场 29 楼

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579/400-8888-999

公司网址：www.95579.com

(21) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

(22) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

联系人：单晶

电话：0755-23838750

传真：0755-23838701

客户服务电话：95358

公司网址：www.firstcapital.com.cn

(23) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客户服务电话：95360

公司网址：www.nesc.cn

(24) 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：钱俊文

联系人：王一彦

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户服务电话：95531/400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn

(25) 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：夏锐

电话：010-66559079

传真：010-66555246

客户服务电话：400-888-8993

公司网址：www.dxzq.net

(26) 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

法定代表人：陈照星

联系人：陈士锐

电话：0769-22112151

传真：0769-22112151

客户服务电话：95328

公司网址：www.dgzq.com.cn

(27) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路华侨国际大厦 24 楼

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 16-19 层

法定代表人：施华

联系人：丁敏

电话：010-59355997

传真：010-57398130

客户服务电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

(28) 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：刘秋明

联系人：郁疆

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(29) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：95575 或致电各地营业网点

客户服务电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

(30) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(31) 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

(32) 国金证券有限公司

注册地址: 四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址: 四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人: 冉云

联系人: 陈瑀琦、赵海帆

电话: 028-86692603/028-86690152

传真: 028-86690126

客户服务电话: 95310

公司网址: www.gjzq.com.cn

(33) 国联证券股份有限公司

注册地址: 江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层

办公地址: 江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法定代表人: 雷建辉

联系人: 沈刚

电话: (0510) 82831662

传真: (0510) 82830162

客户服务电话: 4008885288 或 95570

公司网址: www.glsc.com.cn

(34) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人: 贺青

联系人: 黄博铭

电话: 021-38676666

传真: 021-38670666

客户服务电话: 95521/400-8888-666

公司网址: www.gtja.com

(35) 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 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(36) 国元证券股份有限公司

注册地址：中国安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人：俞仕新

联系人：米硕

电话：0551-62207323

传真：0551-62207322

客户服务电话：95578

公司网址：www.gyzq.com.cn

(37) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号 33 楼

法定代表人：周杰

联系人：李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021-53858549

客户服务电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(38) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-4972675

传真：0471-4972675

客户服务电话：956088

公司网址：www.cnht.com.cn

(39) 红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

联系人：高国泽

电话：0871-3577946

客户服务电话：0871-3577930

公司网址：www.hongtastock.com

(40) 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：章宏韬

联系人：范超

电话：0551-65161821

传真：0551-65161672

客户服务电话：95318

公司网址：www.hazq.com

(41) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：楼斯佳

电话：021-50122107

客户服务电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

(42) 华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招行上海大厦 18 层、19 层、
29 层

法定代表人：黄金琳

联系人：王虹

电话：021-20655183

传真：021-20655196

客户服务电话：95547

公司网址：www.hfzq.com.cn

(43) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼

法定代表人：陈牧原

联系人：周鑫

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

客户服务电话：95368

公司网址：www.hlzq.com

(44) 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：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层

法定代表人：张海文

联系人：孙燕波

电话：010-85556048

传真：010-85556088

客户服务电话：95390

公司网址：www.hrsec.com.cn

(45) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

联系人：郭力铭

电话：010-57617065

传真：010-57617065

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(46) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

电话：010-58124967

传真：028-86150040

客户服务电话：95584

公司网址：www.hx168.com.cn

(47) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

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：刘熠

电话：021-54967387

传真：021-54967387

客户服务电话：95323/400-1099-918

公司网址：www.cfsc.com.cn

(48) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人：赵洪波

联系人：王金娇

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

客户服务电话：956007

公司网址：www.jhzq.com.cn

(49) 民生证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A
室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A
室

法定代表人：冯鹤年

联系人：张玉蕊

电话：010-85127627

传真：010-85128641

客户服务电话：95376

公司网址：www.msza.com

(50) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25
层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25
层

法定代表人：何之江

联系人：王阳

电话：021-38632136

传真：021-38637436

客户服务电话：95511-8

公司网址：stock.pingan.com

(51) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

联系人：牟冲

电话：010-5832-8112

客户服务电话：400-887-8827

公司网址：www.ubssecurities.com

(52) 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

(53) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：何伟

联系人：邵珍珍

电话：021-53686888

传真：021-53686100-7008

客户服务电话：400-8918-918

公司网址：www.shzq.com

(54) 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

法定代表人：杨玉成

联系人：余洁

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523/400-8895-523

公司网址：www.swhysc.com

(55) 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楼 47 层 01 单元

办公地址：深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道 3165 号五矿金融大厦（18-25 层）

法定代表人：黄海洲

联系人：戴佳璐

电话：0755-23375492

传真：0755-82545500

客户服务电话：400-1840-028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(56) 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：高振营

联系人：江恩前

电话：021-38784580-8920

传真：021-68865680

客户服务电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

(57) 信达证券有限公司

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：祝瑞敏

联系人：王薇安

电话：010-83252170

传真：010-63081344

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

(58) 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：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话：021-38565547

传真：021-38565955

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(59) 粤开证券股份有限公司

注册地址：广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区控股中心 21、22、23

层

办公地址：深圳市福田区深南大道 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

传真：0752-2119369

客户服务电话：95564

公司网址：www.ykzq.com

(60) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：0755-82943666

传真：0755-83437373

客户服务电话：95565/400-8888-111

公司网址：www.newone.com.cn

(61) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：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

(62) 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 2-6 层

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：010-80928123

传真：010-80928123

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

(63) 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21

层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

法定代表人：高涛

联系人：胡芷境

电话：0755-88320851

传真：0755-82026942

客户服务电话：95532/400-600-8008

公司网址：www.ciccwm.com

(64) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦

A 栋 41 层

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号 中航资本大厦 35 层

法定代表人：王晓峰

联系人：王紫雯

电话：010-59562468

客户服务电话：95335

公司网址：www.avicsec.com

(65) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：吴小静

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：95329

公司网址：www.zszq.com

(66) 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：许曼华

电话：021-20315290

传真：021-20315137

客户服务电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(67) 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：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

电话：010-85156310

传真：010-65182261

客户服务电话：400-888-8108

公司网址：www.csc108.com

(68) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层
1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层
1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：010-60833754

传真：010-57762999

客户服务电话：400-990-8826

公司网址：www.citicsf.com

(69) 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 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座

法定代表人：冯恩新

联系人：董巨川

电话：0532- 68722197

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：sd.citics.com

(70) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：杜杰

电话：010-60838888

传真：010-60836029

客户服务电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(71) 中信证券华南股份有限公司

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

法定代表人：胡伏云

联系人：陈靖

电话：020-88836999

传真：020-88836984

客户服务电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

(72) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室

办公地址：浙江省杭州市西湖区学院路28号德力西大厦1号楼19楼

法人姓名：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：0571-81137494

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(73) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 26 楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 26 楼

法定代表人：其实

联系人：屠彦洋

联系电话：010-65980380

传真：010-65980408

客服电话：400-1818-188

公司网站：<http://www.1234567.com.cn>

(74) 腾安基金销售（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（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15层

法定代表人：刘明军

联系人：谭广锋

联系电话：0755—86013388

传真：0755-86013399

客服电话：95017(拨通后转1再转6)

公司网址：<http://www.tenganxinxi.com>

(75) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼

法人姓名：凌顺平

联系人：吴强

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

公司网址: www.5ifund.com

(76) 京东肯特瑞基金销售有限公司

住所: 北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

办公地址: 北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

A座

法定代表人: 王苏宁

联系人: 姜云

联系电话: 18612439949

传真: 010-89188000

个人业务: 95118 , 4000988511

企业业务: 4000888816

公司网址: <http://fund.jd.com>

(77) 北京雪球基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

法定代表人: 钟斐斐

联系人: 秦艳琴

联系电话: 010-61840688

传真: 010-61840699

客服电话: 400-0618-518

公司网址: <https://danjuanapp.com>

(78) 东方财富证券股份有限公司

注册地址: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人: 戴彦

联系人: 陈亚男

联系电话: 021-23586583

客服电话: 95357

公司网站: <http://www.18.cn>

(79) 北京格上富信基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：李悦章

联系人：王梦

电话：010-85594745

传真：010-85932427

客户服务电话：400-066-8586

公司网址：www.igesafe.com

(80) 北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层

法定代表人：齐剑辉

联系人：杨家明

传真：010-82055860

客户服务电话：4006236060

公司网址：www.niuniufund.com

(81) 北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区大望路金地中心A座28层

法定代表人：武建华

电话：(010) 59313555

传真：(010) 56642623

联系人：孙玉

客户服务电话：400-8980-618

网址：<https://www.chtfund.com>

(82) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：郑毓栋

联系人：王重阳

电话：010-65951887

传真：010-65951887

客户服务电话：400-618-0707

公司网址：<http://www.hongdianfund.com>

(83) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层A座1108

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座401

法定代表人：王伟刚

联系人：熊小满

电话：010-56251471

传真：010-62680827

客户服务电话：400-619-9059

公司网址：www.hcjjjin.com

(84) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：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：王利刚

联系人：白皓

电话：010-56200948

传真：010-57569671

客户服务电话：400-678-5095

公司网址：www.qianjing.com

(85) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路113号3层342室

办公地址：北京市石景山区古城西路113号3层342室

法定代表人：季长军

联系人：何鹏

电话：010-52609656

传真：010-51957430

客户服务电话：400-188-5687

公司网址：www.buyforyou.com.cn

(86) 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1号楼1208

办公地址：北京市西城区南礼士路66号1号楼1208

法定代表人：罗细安

联系人：闫丽敏

电话：15210998306

传真：67000988-6000

客户服务电话：67000988-8004

公司网址：www.zcvc.com.cn

(87) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：李晓芳

电话：010-59601366转7167

传真：0351-4110714

客户服务电话：400-818-8000

公司网址：www.myfund.com

(88) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼

法人姓名：于龙

联系人：张喆

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客服电话：4006-802-123

公司网址：www.zhixin-inv.com

(89) 凤凰金信（海口）基金销售有限公司

注册地址：海南省海口市滨海大道32号复兴城互联网创新创业园E区4层

办公地址：北京市朝阳区建国路93号院万达广场6号楼2705

法定代表人：张旭

联系人：汪莹

电话：010-58160168

传真：010-58160173

客户服务电话：400-810-5919

公司网址：www.fengfd.com

(90) 和讯信息科技有限公司

注册地址：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：陈慧慧

电话：010-85657353

传真：010-65884788

客户服务电话：400-920-0022

公司网址：licaike.hexun.com

(91) 济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

客户服务电话：400-673-7010

公司网址：www.jianfortune.com

(92) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心酒店B座(2#楼)27楼2714室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼11层

法定代表人：张峰

联系人：闫欢

电话：010-85097302

客户服务电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

(93) 浦领基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

电话：010-59497361

传真：010-64788016

客户服务电话：400-876-9988

公司网址：www.zscffund.com

(94) 星展银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号1301, 1801单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号1301, 1801单元

法人姓名：葛甘牛

联系人：吴欣莹/王文岩

电话：021-38968358/021-20610828

传真：021-38968995

客服电话：400-820-8988

公司网址：www.dbs.com.cn

(95) 深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海

商务秘书有限公司)

办公地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼

法定代表人：顾敏

联系人：凌云

联系电话：0755-89462721

传真：0755-86700688

客服电话：400-999-8800

公司网址：<http://www.webank.com>

(96) 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：高皓辉

电话：021-63333389-239

传真：021-63333390

客户服务电话：4006-433-389

公司网址：www.vstonewealth.com

(97) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客户服务电话：400-166-6788

公司网址：www.66zichan.com

(98) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层

法定代表人：马勇

联系人：文雯

电话：010-83363101

传真：010-83363072

客户服务电话：4008-166-1188

公司网址：<http://8.jrj.com.cn>

(99) 泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路甲92号-4至24层内10层1012

办公地址：北京市朝阳区建国路乙118号京汇大厦1206

法定代表人：张虎

联系人：郑雅婷

客户服务电话：400-004-8821

公司网址：www.taixincf.com

(100) 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谔

联系人：卢亚博

电话：13752528013

传真：021-50701053

客户服务电话：400-080-8208

公司网址：www.xyinsure.com

(101) 一路财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层

法定代表人：吴雪秀

联系人：董宣

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

(102) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：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C1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

传真：010-85800047

客户服务电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

(103) 珠海盈米基金销售有限公司

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1201-1203室

法定代表人：肖雯

联系人：邱湘湘

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(104) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

法定代表人：葛新

联系人：林天赐

传真：010—59403027

客户服务电话：010—59403028

公司网址：www.duxiaomanfund.com

(105) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区金融大街16号

办公地址：中国北京市西城区金融大街16号

法定代表人：王滨

联系人：杨子彤

电话：010-63631752

传真：010-66222276

官网：www.e-chinalife.com

(106) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

法定代表人：李科

联系人：王超

传真：010-85632773

客户服务电话：95510

公司网址：<http://fund.sinosig.com>

(107) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦7楼

办公地址：上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦7楼

法人姓名：陈祎彬

联系人：郑理

邮箱：ZHENGLI806@lufunds.com

传真：021-22066653

客服电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

(108) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海浦东新区张扬路500号华润时代广场10F

法人姓名：杨文斌

联系人：王诗琦

电话：021-20613999

传真：021-68596919

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(109) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

(110) 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：上海虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18楼

法人姓名：李兴春

联系人：陈洁

电话：021-60195121；18901780806

传真：021-61101630

客服电话：400-921-7755

公司网址：www.leadfund.com.cn

(111) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋

法人姓名：汪静波

联系人：余翼飞

电话：021-80358749

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网址：<https://www.noah-fund.com/>

(112) 中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法人姓名：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336539

传真：010-59336500

客服电话：4008-909-998

公司网址：www.jnlc.com

(113) 上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法人姓名：张跃伟

联系人：吴艳秋

电话：021-2069-1831

传真：021-2069-1861

客服电话：4008202899

公司网址：www.erichfund.com

(114) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

法人姓名：申健

联系人：张蜓

电话：021-20219988

传真：021-20219923

客服电话：021-20292031

公司网址：www.wg.com.cn

(115) 奕丰基金销售有限公司

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)

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法人姓名：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

(116) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块
新浪总部科研楼5层518室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块
新浪总部科研楼

法人姓名：穆飞虎

联系人：穆飞虎

电话：010-5898 2465

传真：8610-62676582

客服电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

(117) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

法人姓名：卜勇

联系人：于舒

电话：0411-39027828 18640801075

传真：0411-39027835

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

(118) 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：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法人姓名：王翔

联系人：王雨晴

电话：021-6537-0077

传真：021-5508-5991

客服电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(119) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

法人姓名：祝中村

联系人：曾瑶敏

电话：0755-83999907

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

公司网址：www.fujifund.cn

(120) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址（公司地址）：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

联系人：仲秋玥

电话：010-88066632

传真：010-63136184

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

(121) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室

法人姓名：吴言林

联系人：林伊灵

电话：025-66046166-810

传真：025-56663409

客服电话：025-66046166

公司网址：www.huilinbd.com

(122) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185

传真：021-50710161

客服电话：400-821-0203

公司网址：<http://www.520fund.com.cn>

(123) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7层

法定代表人：沈丹义

联系人：杨徐霆

联系电话：021-60818249

传真：021-60818187

客服电话：400-101-9301

公司网址：<https://www.tonghuafund.com>

(124) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元

法定代表人：吕柳霞

联系人：毛善波

联系电话：021-50810687

传真：021-58300279

客服电话：021-50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

(125) 青岛意才基金销售有限公司

注册地址：山东省青岛市市南区延安三路234号海航万邦中心18层

法定代表人：Giamberto Giraldo

联系人：牟冲

传真：0532-87071099

客户服务电话：400-612-3303

公司网址：www.yitsai.com

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：戴文华

电话：（010）59378888

传真：（010）66210938

联系人：赵亦清

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所

注册地址：上海市华阳路112号2号楼东虹桥法律服务园区302室

办公地址：上海市东方路69号裕景国际商务广场A座15层

负责人：冯加庆

电话：（021）58773177

传真：（021）58773268

联系人：张兰

经办律师：梁丽金、张兰

（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号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：张勇、叶尔甸

联系人：叶尔甸

六、基金的历史沿革

长盛全债指数增强型债券投资基金由长盛中信全债指数增强型债券投资基金转型而来。

长盛中信全债指数增强型债券投资基金经中国证监会证监基金字[2003]90号文批准募集，基金合同于2003年10月25日生效，业绩比较基准为“中信标普全债指数收益率 \times 92%+中信标普A股综合指数收益率 \times 8%”。

鉴于标普道琼斯指数有限公司已经停止更新本基金业绩比较基准中的“中信标普全债指数”，并发布“标普中国全债指数”作为替代指数；此外，标普道琼斯指数有限公司已于2015年11月2日将“中信标普A股综合指数”名称变更为“标普中国A股综合指数”。经基金管理人审慎评估，变更后的两条指数在编制方法上与原指数无实质性区别，将对应修改本基金的业绩比较基准。综上，我司拟据此变更本基金的业绩比较基准为“标普中国全债指数收益率 \times 92%+标普中国A股综合指数收益率 \times 8%”。

此外，由于本基金是跟踪标的指数的指数增强型基金，且基金名称中含有“中信全债指数”字样，所以在本基金业绩比较基准进行变更之际，基金管理人根据《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》《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》的规定，拟将本基金更名为“长盛全债指数增强型债券投资基金”。同时修改本基金合同、托管协议、招募说明书的相关内容。

按照《基金合同》的约定，本次基金更名和变更业绩比较基准对基金持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，不需要召开持有人大会。基金管理人已与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。上述变更于2016年4月15日生效。

由于标普道琼斯指数有限公司停止计算标普中国A股综合指数行情数据，经基金管理人审慎评估决定自2020年9月14日起，变更本基金的业绩比较基准为“标普中国全债指数收益率 \times 92%+沪深300指数收益率 \times 8%”。按照《基金合同》的约定，本次基金更名和变更业绩比较基准对基金持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，不需要召开持有人大会。基金管理人

已与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，符合相关法律法规及《基金合同》的规定。

七、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》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2003年7月30日证监基金字[2003]90号文批准募集。募集期为自2003年8月18日到2003年10月20日。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，设立募集期共募集925,088,683.98份基金份额，有效认购户数为31,379户。

八、基金合同的生效

（一）基金合同生效

基金合同于2003年10月25日生效。

（二）基金存续期内基金份额持有人数量和资金量的限制

基金合同生效后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续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5000万元的，基金管理人应当及时向中国证监会说明原因和报送解决方案。法律、法规或证券监管部门另有规定的，从其规定。

九、基金份额的申购与赎回

（一）日常申购与赎回的场所

- 1、基金管理人的直销网点；
- 2、基金管理人委托的代销机构的营业网点；

本公司直销中心及代销机构信息由招募说明书具体规定。基金管理人有权增加符合条件的销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化增加其销售城市（网点），并另行公示。条件成熟时，投资者可通过基金管理人或者指定的基金销售代理人以电话、传真或互联网等形式进行申购与赎回。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、申购、赎回的开放日

申购开始日：2003年12月5日

赎回开始日：2003年12月5日

2、基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。

3、营业时间：

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，并在实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

（三）申购与赎回的原则

1、未知价原则，即本基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金单位净值为基准进行计算；

2、本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、基金份额持有人赎回时，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销，在当日的交易

时间结束后不得撤销；

5、申购费用按单笔申购申请金额对应的费率乘以单笔确认的申购金额计算；

6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但基金管理人必须在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7、本基金暂不采用摆动定价机制。

（四）申购与赎回的数额限制

1、单笔最低申购金额为1元人民币（含申购费）。

投资者选择当期分配的基金收益自动转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。但法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、申请赎回基金的份额

赎回按份额进行，申请赎回的份额为大于0的任意份额。

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

4、基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的程序和数额限制，但基金管理人必须在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（五）日常申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售代理人规定，在开放日的交易时间段内提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。基金份额持有人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）及登记注册机构必须有足够的基金份额余额。否则会因所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 工作日及之后到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询; T 日申购成功的基金份额 T+2 个工作日后可以赎回。

3、申购和赎回款项支付

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

基金管理人应当自接受投资人有效赎回申请之日起 7 个工作日内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照《基金合同》有关条款处理。

(五) 日常申购与赎回的数额和价格

1、申购数额、余额的处理方式

(1) 本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;

(2) 基金份额持有人赎回时,基金管理人按先进先出的原则,对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理,即先确认的份额先赎回,后确认的份额后赎回;

(3) 基金份额份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。赎回金额和支付金额四舍五入,保留小数点后两位。

2、申购份数的计算

如果投资者选择交纳前端申购费用,则申购份数的计算方法如下:

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率})$$

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

如果投资者选择交纳后端申购费用,则申购份数的计算方法如下:

$$\text{申购份数} = \text{申购金额} / \text{T日基金份额净值}$$

3、赎回金额的计算

如果投资者在申购时选择交纳前端申购费用,则赎回金额的计算方法如下:

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T日基金份额净值}$$

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

如果投资者在申购时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

后端申购费用=赎回份数×申购日基金份额净值×后端申购费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端申购费用-赎回费用

4、份额资产净值的计算

基金份额资产净值=当日基金资产净值/当日基金总份额

T日基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。

（六）基金的申购费、赎回费及转换费

1、投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。申购费用由申购人承担，不列入基金资产。

养老金特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户，包括基本养老保险基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金基金份额的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2、投资者选择交纳前端申购费用时，申购费率按照单笔申购金额递减，具体费率如下：

申购金额	申购费率	养老金特定申购费率
100 万以内	1.0%	0.30%
满 100 万不满 500 万	0.8%	0.24%

满 500 万不满 1000 万	0.6%	0.18%
满 1000 万以上	按笔收取, 1000 元/笔	按笔收取, 1000 元/笔

3、投资者选择交纳后端申购费用时, 申购费率按持有期递减, 具体费率如下:

持有期	后端申购费率	养老金特定后端申购费率
一年以内	1.2%	0.36%
满一年不满二年	1.0%	0.30%
满二年不满三年	0.5%	0.15%
满三年以后	0	0.00%

4、本基金赎回费率按持有期递减, 最高不超过赎回金额的1.5%, 赎回费率表如下:

持有期 (Y)	赎回费率
Y<7日	1.5%
7日≤Y<一年	0.3%
一年≤Y<两年	0.2%
两年≤Y<三年	0.1%
Y≥三年	0%

注: 一年为365日

本基金的赎回费用由赎回人承担, 其中, 对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产; 对于持续持有期长于7日(含)的投资者收取赎回费的25%归入基金财产, 余额为注册登记费和其他手续费。

5、基金管理人对部分基金投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

6、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式, 最新的申购费率、赎回费率和收费方式在更新的招募说明书中列示。如调整费率或收费方式, 基金管理人最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

7、基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务, 基金转换可以收取一定的转换费, 相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告, 并及时告知基金托管人与相关机构。

(七) 拒绝或暂停申购与赎回的情况

1、拒绝或暂停申购的情形与处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请：

（1）基金资产规模过大，使基金管理人认为继续扩大基金规模会影响基金投资业绩，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（2）证券交易场所在交易时间非正常停市，或因不可抗力导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）基金管理人、基金托管人、基金销售代理人和登记注册人的一方或多方技术系统出现故障或其它原因导致无法正常进行工作；

（4）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的申购；

（5）因不可抗力事件造成基金的申购事实上无法办理；

（6）接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50% 以上时；

（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）经中国证监会同意的其它情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人立即在指定媒体上刊登暂停公告。

2、拒绝或暂停赎回的情形及处理方式

除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资人的赎回申请：

（1）证券交易场所交易时间非正常停市；

（2）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时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；

（3）基金管理人、基金托管人、基金销售代理人和登记注册人的一方或多方技术系统出现故障导致无法正常进行工作；

（4）因不可抗力事件导致基金无法正常运作或基金的赎回无法进行；

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

（6）法律、法规、规章允许的其它情形或其它在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

除上述情形外，发生基金合同或招募说明书中未予载明的的事项，但基金管理人

人有正当理由认为需要暂停基金赎回时，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停公告。

（八）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的情形及处理方式

（1）巨额赎回的认定

若一个工作日内的基金份额净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额）超过上一日基金份额总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

（2）巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人将根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分赎回。

①全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的赎回申请时，将按正常赎回程序处理投资人赎回申请。

②部分延期赎回：当基金管理人认为没有能力全部兑付投资人的赎回申请或全部兑付投资人的赎回申请可能对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在不低于上一日基金总份额的10%，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至第二开放日办理，并以第二开放日的基金份额资产净值为依据计算赎回金额，直至将申请赎回份额全部赎回为止。投资人在申请赎回时有权对当日未获受理部分份额选择延迟赎回或放弃延迟赎回。

③若本基金发生巨额赎回的，且存在单个基金份额持有人单日的赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的部分进行自动延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日，并与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权且以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如基

金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作延期赎回处理。

④巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点在 3 个证券交易所交易日内刊登公告，并说明有关处理方法。

2、连续巨额赎回成立的条件及处理方式

(1) 连续巨额赎回的认定

本基金连续三个开放日发生巨额赎回，为连续巨额赎回。

(2) 连续巨额赎回的处理方式

①发生连续巨额赎回时，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，但延迟支付时间不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

②重新开放申购或赎回的公告：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至少一种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工作日的基金份额资产净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种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基金份额资产净值。

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；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种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工作日的基金份额资产净值。

(九) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“十、基金的侧袋机制”或相关公告。

十、基金的侧袋机制

（一）侧袋机制的实施条件

为有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人依照法律法规及基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并咨询符合《证券法》规定的会计师事务所意见后，可以启用侧袋机制。

（二）侧袋机制的特定资产范围

本基金的特定资产由基金管理人充分审慎严格评估后确定。特定资产包括：

- 1、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的资产；
- 2、按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；
- 3、其他资产价值存在重大不确定性的资产。

（三）侧袋机制的实施程序

基金管理人认为可以启用侧袋机制的，应符合法律法规及《基金合同》约定，并按如下程序具体实施：

- 1、基金管理人对本基金是否符合侧袋机制的实施条件进行评估，制作合规性评估报告，并经内部程序决策通过。
- 2、基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询符合《证券法》规定的会计师事务所意见后，决定启用侧袋机制。
- 3、启用侧袋机制当日，基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。启用侧袋机制后，基金管理人应聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。
- 4、基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案，并于启用侧袋机制后 5 个工作日内提交相关材料。
- 5、基金管理人应在启用侧袋机制的次日发布临时公告，在实施侧袋机制期间处置特定资产或发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。基金管理人应及时向基金销售机构提示侧袋机制启用的相关事宜。
- 6、在实施侧袋机制期间，基金管理人应当与基金销售机构共同及时向侧袋

实施期间申购或赎回基金的相关投资者传递信息，做好相应的风险揭示。

7、当侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（四）侧袋机制的运作安排

1、特定资产处置清算

特定资产的处置清算由基金管理人审慎决定。特定资产恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

2、对基金申购赎回的影响

(1)基金管理人应当依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购政策。

(2)启用侧袋机制当日，基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。基金管理人应依法向投资者进行充分披露。

(3)侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户申购赎回。同时，基金管理人按照基金合同和本招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

(4)基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10% 认定。

3、信息披露

(1)基金管理人应当暂停披露侧袋账户份额净值，对基金简称进行特殊标识。

(2)在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后按规定发布临时公告。

(3)基金管理人应当在基金定期报告中单独披露报告期内侧袋账户相关信息及特定资产处置进展情况等可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关

风险提示，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，应同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

4、实施侧袋账户期间的基金费用

(1)本基金实施侧袋机制的，主袋账户的管理费和托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

(2)与处置侧袋账户资产相关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，且不得收取管理费。

(3)因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

(五) 主袋账户的投资安排

1、基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

2、基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

3、本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

(六) 基金托管人的职责

基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定，加强对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面的复核和监督。

(七) 相关风险提示

实施侧袋机制期间，侧袋账户份额不办理申购、赎回，基金管理人暂停披露侧袋账户份额净值，侧袋账户份额对应的特定资产不得进行除变现以外的其他投资操作，因此，持有侧袋账户份额的基金份额持有人将面临上述流动性风险。

十一、基金的投资管理

（一）投资目标

本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产的当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市或拟上市的各种债券、股票及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金，本基金主要投资于各类债券品种，品种主要包括：国债、金融债、企业债与可转换债券。本基金对目标指数的投资在资产配置中的比例最低为64%，股票投资在资产配置中的比例不超过16%。

（三）投资理念

基于对债券市场参与者长期利率预期能力和现有市场结构的认识，本基金管理人的投资理念是“以指数化投资为基础，通过一定程度低风险的积极性投资，结合对投资组合的动态管理，实现基金资产的长期增值”。

1、以指数化投资方式为基础是基于对市场参与者难以长期对利率趋势做出准确预测的认识。

大量事实证明，任何债券市场参与者均难以具有超常的利率预测能力，都不可能长期对利率走势做出足够肯定和精确预测，从而获取超常的投资收益。另外，我们认为随着我国债券市场的发展与完善，现存的市场分割局面及结构性失衡问题将得以改善与解决，市场效率将不断提高。因此，为了确保基金长期稳定增值，我们将运用紧盯目标指数久期的指数化投资方式进行组合投资管理。

2、标普中国全债指数能够直接、比较真实地刻画债券市场走势。标普中国全债指数是一个全面反映整个债券市场的综合性权威债券指数。

3、基于债券市场现存的结构性问题，我们将采用指数化的增强性投资。

现阶段的债券市场作为一个新兴市场，存在一些结构性问题，主要表现在利率期限结构难以体现风险补偿、相似期限债券品种存在较大的收益率差异和不同市场收益率水平的差异。债券市场现存的结构性问题，既对基金管理人提出了在指数化投资的基础上进行低风险的积极性管理的要求，也为基金管理人提供了一定程度积极性管理的机会。

本基金的指数化增强性投资主要体现在债券资产一定程度上的主动性管理和在限定比例内的股票资产配置上。随着债券市场的发展和市场有效性的提高，本基金指数化的增强性程度将相应降低。

4、动态资产组合管理是确保投资目标实现的关键。

本基金管理人将基于对未来一定时期内宏观经济和市场形势的分析，兼顾投资者对基金份额的申购、赎回需求，高度重视动态资产配置，及时调整投资组合中债券、股票和现金等资产类别间的比例分布，以实现在流动性约束下资产配置效率的最佳状态。同时，对债券投资组合久期与目标指数久期偏离度的动态跟踪与监控，适时相应调整类属资产及个券，有效控制风险，并获得超越目标指数收益。

（四）标的指数

本基金标的指数为标普中国全债指数。

标的指数编制方法具体见本招募说明书的规定。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券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 10 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。

本基金运作过程中，标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份券的违约风险及其在指数中的权重，据此制定成份券替代策略，及时对标的指数成份券的投资比例进行调整。

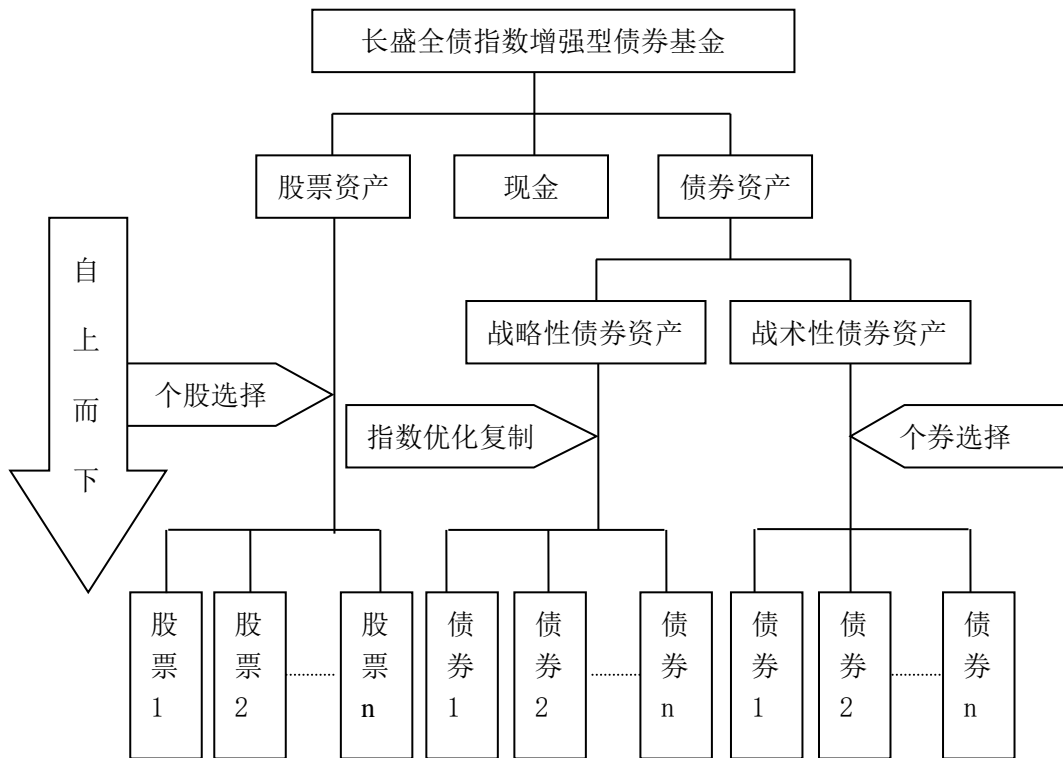
（五）投资策略

本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资

策略来提高债券投资组合的收益。

1、在对宏观经济形势和证券市场走势进行科学分析的基础上，自上而下进行资产配置。

本基金将重点关注经济增长率、工业总产值增长率、产品产销率、外贸进出口额、物价指数等宏观经济指标，通过对宏观经济形势、财政政策及货币政策的深入分析，对未来经济走势、投资环境变化及利率走势做出科学、合理地判断，并在此基础上采用“自上而下”的资产配置策略，首先确定基金资产在债券、股票和现金资产之间的配置，再确定债券资产中战略性与战术性债券资产间的配置比例，最后按照不同方法具体构建债券、股票投资组合。



2、运用指数化的增强性投资策略，获得超过目标指数的收益水平。

在指数化投资的基础上，针对债券市场当前存在的结构性失衡，通过控制债券投资组合久期与指数久期有限度偏离，运用收益率差异策略、资产选择策略等积极资产组合管理策略，依据总收益分析实现对各类属资产的合理配置。

同时，遵循稳健投资原则，积极参与股票增发，并运用投资组合保险策略适当进行股票投资，提高组合的整体收益。

3、充分利用市场无风险套利机会，适当运用杠杆原理，有效提高投资组合的收益水平。

本基金还将充分利用以下无风险套利机会提高资产盈利水平：

(1) 利用同一债券品种在不同债券市场上的价格差异，通过无风险套利操作获得由于市场分割带来的超额收益；

(2) 利用同期限债券回购品种在不同市场上的利率差异，通过开展无风险套利操作，提高投资组合的盈利能力；

(3) 利用同期限债券品种在一、二级市场上的收益率差异，通过投资品种的转换获得一、二级市场的差价收入；

(4) 通过债券回购所获得的资金参与新股申购和新股配售，获得稳定的股票一级市场收益；

(5) 随着未来利率期货、利率期权、利率互换等可以有效规避利率风险金融衍生产品的推出，在主管机关批准后积极开展套利操作。

此外，多层次的风险监控体系和组合动态调整机制将确保各种积极投资策略和无风险套利操作的有效实施和执行。

(六) 投资决策与流程

1、研究过程

研究部门通过对宏观经济形势及证券市场走势的研究与分析，向投资决策委员会提交资产配置研究报告；

2、决策机制与决策过程

(1) 决策依据

国家有关法律、法规和基金合同的有关规定是本基金进行投资的前提；宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势是本基金投资决策的基础；投资对象收益和风险的科学合理配比是本基金维护投资者利益的重要保障。

(2) 决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的报告对基金的资产配置及指数化的增强性投资下达指导性意见，基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责；

3、投资组合的构建

投资组合的构建是“自上而下”进行债券、股票、现金配置与“自下而上”进行

个券、个股选择相结合的过程。

①债券投资组合的构建

在债券投资方面，本基金将债券资产配置分为战略性资产和战术性资产两部分。

战略性资产配置体现指数化投资原则，将以标普中国全债指数样本券为基础，通过保持投资组合久期与目标指数久期有限度的偏离（偏离度5%），实现对目标指数的优化复制。战略性债券资产配置的最低比例为基金净资产的64%。随着债券市场有效性的提高，战略性债券资产配置的比重可适度增加。

战术性资产配置体现指数化的增强性投资，其投资品种不受指数样本库的限制，组合久期管理不受目标指数的限制，但受整个组合久期的限制。战术性资产投资于因投资主体偏好、流动性需求差别及市场分割而凸显投资价值的流动性较好的债券，是一个“自下而上”进行个券选择的过程。战术性债券资产最多可通过回购放大1倍操作。

	久期偏离下限	久期偏离上限
战略性债券资产	目标指数久期的 95%	目标指数久期的 105%
战术性债券资产	/	/
债券资产组合	目标指数久期的 80%	目标指数久期的 130%

本基金对战略性债券资产和战术性债券资产实行“分户经营，统一管理”。

②股票投资组合的构建

本基金的股票投资作为债券投资的有益补充，可以提高投资组合收益并适当分散风险。本基金主要参与新股认购和股票增发，并将适当投资于行业地位领先、业绩优良、有持续分红记录的大盘价值股。其中：通过新股认购所获的不符合个股选择标准的股票，本基金将在该股票上市后1个月内卖出；本基金投资的大盘价值股全部来自于公司建立的股票池。

股票投资组合的构建过程是自下而上进行个股选择的过程。

4、交易过程

基金经理通过投资管理系统向交易部下达投资指令。交易部负责交易执行和一线监控。

5、投资组合调整过程

基金经理密切关注宏观经济及市场形势，结合基金申购赎回情况和指数组合

调整情况等，对投资组合进行动态监控和调整。

6、业绩与风险评估过程：基金经理小组和公司专职投资评估员按照投资决策委员会指导性方针和投资实施方案对投资业绩进行评估。

（七）证券选择标准

1、个券选择标准

本基金在进行指数化的增强性投资时，其个券选择主要标准如下：

- （1）类似信用等级和期限的债券中选择到期收益率较高的债券；
- （2）类似信用等级、久期及到期收益率水平的债券中选择凸性较大的债券；
- （3）流动性较高的债券；
- （4）可获得较好当期收益的债券；
- （5）其他价值被低估、有增值潜力的债券。

2、个股选择标准

- （1）公司发展战略清晰，管理科学稳健，处于行业领先地位；
- （2）业绩优良，有持续分红记录；
- （3）流通市值大于市场平均水平且市净率较低的股票
- （4）其他价值被低估的股票。

（八）业绩比较基准

本基金为增强性指数化债券型投资基金，对目标指数的投资在资产配置中最低比例为 64%，股票资产配置最高比例为 16%，现金持有最低比例为 3%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。由于本基金主要投资于债券，股票投资是作为增强型投资提高收益的一种手段，预计股票投资比例的平均值为 8%，因此将基金业绩比较设定为：

基金业绩比较基准=标普中国全债指数收益率*92%+沪深 300 指数收益率*8%。

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，或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经基金托管人同意，并按照监管部门要求履行适当程序后根据实际情况调整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审议。

（九）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

（十）投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。

本基金投资组合的构建应遵循以下限制：

- 1、本基金投资于债券、股票的比例，不低于本基金资产总值的80%；
- 2、本基金投资于目标指数的比例不低于本基金资产净值的64%，其中投资于国债的比例不低于本基金资产净值的20%；
- 3、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%。
- 4、本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- 5、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，且债券回购融入的资金余额不得超过基金净资产的40%；
- 6、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- 7、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- 8、本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证不得超过该权证的10%；
- 9、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%；
- 10、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；
- 11、本基金与本基金管理人管理的其他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%；
- 12、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；
- 13、本基金投资的资产支持证券的信用评级，不低于国内信用评级机构评定的BBB级或相当于BBB级的信用级别。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。

14、本基金管理人管理的全部开放式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%；

15、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券市场波动、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本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

16、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；

17、中国证监会规定的其它比例限制。

在本基金成立六个月内，应达到上述比例限制。除上述第13、15、16项外，因基金规模或市场剧烈变动导致投资组合不符合上述规定时，管理人应在合理期限内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

（十一）禁止行为

禁止用本基金资产从事以下行为：

- 1、投资于其它证券投资基金；
- 2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、动用银行信贷资金从事基金投资；
- 4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、以基金资产进行房地产投资；
- 7、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 8、将基金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；
- 9、《基金法》及相关法律法规禁止从事的其它行为。

（十二）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全和增值；

- 3、 独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- 4、 基金管理人按照有关规定代表基金行使股东权利。

（十三）侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书相关章节的规定。

（十四）基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国农业银行根据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《长盛全债指数增强型债券投资基金 2021 年第 4 季度报告》，报告截至日：2021 年 12 月 31 日，本报告财务资料未经会计师事务所审计。

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	570,138,327.80	93.17
	其中：债券	570,138,327.80	93.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,772,472.74	4.21
8	其他资产	16,053,987.47	2.62

9	合计	611,964,788.01	100.00
---	----	----------------	--------

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	139,561,000.00	30.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	135,023,000.00	29.30
	其中：政策性金融债	135,023,000.00	29.30
4	企业债券	65,813,427.80	14.28
5	企业短期融资券	4,999,000.00	1.08
6	中期票据	224,248,900.00	48.67
7	可转债（可交换债）	493,000.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	570,138,327.80	123.73

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	200006	20 付息国债 06	800,000	78,800,000.00	17.10
2	180210	18 国开 10	400,000	42,496,000.00	9.22
3	170210	17 国开 10	300,000	31,677,000.00	6.87
4	210007	21 付息国债 07	300,000	30,444,000.00	6.61
5	101900194	19 河钢集 MTN002B	200,000	20,524,000.00	4.45

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明。

①、18 国开 10/17 国开 10/16 国开 10:

2021 年 1 月 8 日，银保监会银保监罚决字（2020）67 号显示，国家开发银行存在为违规的政府购买服务项目提供融资等 24 项违法违规事实，对其处以罚款 4880 万元。对以上事件，本基金判断，国家开发银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

②、16 进出 03:

2021 年 7 月 13 日，中国银保监会银保监罚决字（2021）31 号显示，中国进出口银行存在违规投资企业股权等 24 项违法违规事实，被处罚没 7345.6 万元。对以上事件，本基金判断，进出口银行经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的

股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	317,818.19
2	应收证券清算款	3,408,921.69
3	应收股利	-
4	应收利息	9,555,538.74
5	应收申购款	2,771,708.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,053,987.47

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

(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。

十二、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准收 益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
2003年10月25日 (基金合同生效 日)至2003年12 月31日	4.12%	0.25%	1.40%	0.13%	2.72%	0.12%
2004年1月1日至 2004年12月31日	0.18%	0.32%	-3.04%	0.17%	3.22%	0.15%
2005年1月1日至 2005年12月31日	10.59%	0.26%	10.30%	0.14%	0.29%	0.12%
2006年1月1日至 2006年12月31日	32.71%	0.38%	7.99%	0.13%	24.72%	0.25%
2007年1月1日至 2007年12月31日	42.43%	0.46%	7.76%	0.20%	34.67%	0.26%
2008年1月1日至 2008年12月31日	-2.08%	0.39%	1.39%	0.26%	-3.47%	0.13%
2009年1月1日至 2009年12月31日	7.79%	0.34%	6.63%	0.17%	1.16%	0.17%
2010年1月1日至 2010年12月31日	4.63%	0.31%	1.77%	0.14%	2.86%	0.17%
2011年1月1日至 2011年12月31日	-6.28%	0.25%	0.94%	0.13%	-7.22%	0.12%
2012年1月1日至 2012年12月31日	-0.43%	0.22%	4.31%	0.12%	-4.74%	0.10%
2013年1月1日至 2013年12月31日	1.16%	0.19%	2.01%	0.13%	-0.85%	0.06%

2014年1月1日至 2014年12月31日	32.84%	0.51%	12.22%	0.19%	20.62%	0.32%
2015年1月1日至 2015年12月31日	4.42%	0.60%	7.08%	0.22%	-2.66%	0.38%
2016年1月1日至 2016年12月31日	-0.06%	0.13%	0.73%	0.20%	-0.79%	-0.07%
2017年1月1日至 2017年12月31日	3.25%	0.09%	-0.48%	0.13%	3.73%	-0.04%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-2.52%	0.26%	5.87%	0.15%	-8.39%	0.11%
2019年1月1日至 2019年12月31日	11.05%	0.33%	6.44%	0.13%	4.61%	0.20%
2020年1月1日至 2020年12月31日	13.83%	0.71%	5.11%	0.16%	8.72%	0.55%
2021年1月1日至 2021年12月31日	8.72%	0.48%	4.83%	0.12%	3.89%	0.36%
2003年10月25日 (基金合同生效 日)至2021年12 月31日	335.86%	0.38%	123.00%	0.17%	212.86%	0.21%

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。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。

十三、基金的资产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金所拥有的各类证券价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其它投资等所形成的资产总和。

（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）基金资产的账户

本基金资产以“长盛全债指数增强型债券投资基金”的名义开立基金专用资金账户、证券账户，与基金管理人、基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户严格分开、相互独立。

（四）基金资产的保管和处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 登记注册人的资产，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。基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、登记注册人以其自有的资产承担其自身的法律责任，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》、《基金合同》及其它有关规定处分外，基金资产不得被处分。

十四、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

（二）估值日

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

（三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

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

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

（3）交易所上市交易或挂牌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) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

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

对方，共同查明原因，双方协商解决。

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

（六）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（七）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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，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者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人和托管人之外的第三方造成基金财产损失，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有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其它原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确

定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

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

4、基金份额净值差错处理的原则和方法

当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

(1) 基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

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

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基

基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

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

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

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

(八) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(九) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。

基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。

基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。

国家另有规定的，从其规定。

（十）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（十一）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

十五、基金的收益与分配

（一）基金收益的构成

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

因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

（二）基金净收益

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

（三）收益分配原则

1、本基金的收益以现金形式进行分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金单位净值自动转为基金单位再投资于本基金。红利再投资免收手续费，并不受最低申购金额限制；除非基金份额持有人成功办理了选择取得红利再投资，否则其持有本基金基金单位的默认分红方式为现金红利。

- 2、每一基金单位享有同等分配权；
- 3、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 4、基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
- 7、基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值；
- 8、法律法规以及中国证监会的其它规定。

（四）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、支付方式等内容。

（五）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，由基金托管人复核后确定后五个工作日内公告。

（六）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收申购费用；

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。若投资者的现金红利不足以支付银行转帐或其它费用，基金登记注册人将投资者的现金红利按分红实施日的基金单位净值自动转为基金单位，不足 0.01 份基金单位的，四舍五入。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书相关章节的规定。

十六、基金的费用与税收

(一) 与基金运营有关的费用

1、费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金分红手续费；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、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0.75%年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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，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两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。

为充分维护持有人利益，本管理人承诺，在本基金成立满一年后，经基金托管人核对，如当日累计单位资产净值低于基金单位面值，基金管理人将从下一日开始暂停收取基金管理费，直至累计单位资产净值不低于基金单位面值。在当日累计单位资产净值低于基金单位面值期间，如遇法定节假日，同样暂停收取本基金管理费。

(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0.20%的年费率计算。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，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托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 上述(一)项1中(3)至(8)项费用由基金托管人根据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。基金成立前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

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，经中国证监会核准公告后，无需召开基金份额持有人大会决议通过。

(二) 基金的申购费、赎回费及转换费

1、投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。申购费用由申购人承担，不列入基金资产。

养老金特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户，包括基本养老保险基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金基金份额的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

2、投资者选择交纳前端申购费用时，申购费率按照单笔申购金额递减，具体费率如下：

申购金额	申购费率	养老金特定申购费率
100 万以内	1.0%	0.30%
满 100 万不满 500 万	0.8%	0.24%
满 500 万不满 1000 万	0.6%	0.18%
满 1000 万以上	按笔收取，1000 元/笔	按笔收取，1000 元/笔

3、投资者选择交纳后端申购费用时，申购费率按持有期递减，具体费率如下：

持有期	后端申购费率	养老金特定后端申购费率
一年以内	1.2%	0.36%
满一年不满二年	1.0%	0.30%
满二年不满三年	0.5%	0.15%
满三年以后	0	0.00%

4、本基金赎回费率按持有期递减，最高不超过赎回金额的1.5%，赎回费率表如下：

持有期 (Y)	赎回费率
Y<7日	1.5%
7日≤Y<一年	0.3%
一年≤Y<两年	0.2%
两年≤Y<三年	0.1%
Y≥三年	0%

注：一年为365日

本基金的赎回费用由赎回人承担，其中，对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对于持续持有期长于7日（含）的投资者收取赎回费的25%归入基金财产，余额为注册登记费和其他手续费。

5、基金管理人对部分基金投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

6、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率和收费方式在更新的招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

7、基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金

与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机构。

（三）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见本招募说明书相关章节的规定。

（四）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。

十七、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；基金募集的会计年度按如下原则处理：如果基金成立少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、凭证（原始凭证由托管行保管）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、本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）具有证券从业资格的注册会计师对基金进行年度审计；
- 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，并报中国证监会备案；
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。更换会计师事务所需在5个工作日内公告。

十八、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《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。

（一）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应当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。指定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。

（二）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。

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。

（三）公开披露的信息

1、招募说明书、基金产品资料概要

本基金合同生效后，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3个工作日内更新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。

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。本基金合同生效后，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、成立公告书

在募集期间内，若基金募集满足第六项中第（一）项所述的成立条件时，管理人应于基金成立日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上刊登基金成立公告书。

3、年度报告、中期报告、季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载于指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。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2个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在指定网站上，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网站上，将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金持续运作过程中，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。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例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基金定期报告“影响投

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。

4、基金份额净值公告

每开放日的次日披露该开放日本基金的基金份额净值和基金份额累计净值。

5、临时公告

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) 终止《基金合同》、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) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- 9) 基金管理人高级管理人员、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者仲裁；

- 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，中国证监会另有规定的情形除外；
- 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) 本基金在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) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22) 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的其他事项。

6、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的，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。

7、清算报告

《基金合同》终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。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。

8、实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书相关章节的规定。

9、中国证监会规定的其他信息。

（四）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。

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和更新的招募说明书、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者电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊，单只基金只需选择一家报刊。

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。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息，基金销售机构应当按照中国证监会规定做好信息传递工作。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，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介披露信息，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。

（五）基金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公司住所，供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十九、风险揭示

本基金面临与其他开放式基金相同的风险（例如市场风险、管理风险、流动性风险、技术风险等），但由于本基金是实行指数化增强性投资的开放式基金，上述风险在本基金中存在一定的特殊性。

（一）跟踪指数的被动投资风险

被动跟踪指数的风险主要表现在三个方面：指数下跌风险，即在市场下跌的情况下由于本基金被动地跟踪指数而对基金净值造成损失的不确定性；跟踪偏离风险，即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与目标指数表现之间产生差异的不确定性；目标指数风险，即目标指数因为编制方法的不同或自身的不合理性等原因，可能导致目标指数表现与市场的综合指数表现之间产生差异的不确定性，以及目标指数调整给基金投资带来的管理成本和投资成本提高的风险。比较而言，指数下跌风险和目标指数风险是指数基金本身固有的风险，而跟踪偏离风险是相对可控的风险，它主要受到交易成本、市场流动性风险和基金管理人的管理能力、样本券调整等因素的影响，具体表述如下：

1、本基金在跟踪指数过程中，由于买入和卖出证券时均存在交易成本，例如交易佣金、经手费、证管费、过户费等，导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离。

2、受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的样本债券，或在面临投资者赎回时，无法以赎回价格将债券及时地转化为现金。这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险。

3、在本基金实行指数化投资过程中，管理人对指数基金的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对目标指数的跟踪程度。

4、在跟踪标普中国全债指数的过程中，由于标普中国全债指数样本券可能出现调整，本基金在被动调整过程中也可能产生一定的跟踪偏离风险。

5、标普中国全债指数本身的合理性有待市场检验。标普中国全债指数可能存在的不合理性会导致其不能很好地代表市场整体。随着中国市场的进一步发展和完善，未来如果有更合理、更能代表中国债券市场走势的债券指数推出时，本

基金可能会通过召开基金份额持有人大会的方式，决定是否更换标的指数。

（二）根据基金合同的约定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

（三）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来若出现标的指数不符合要求（因成份券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 10 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。

本基金运作过程中，标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份券的违约风险及其在指数中的权重，据此制定成份券替代策略，及时对标的指数成份券的投资比例进行调整。

（四）成份券停牌或违约的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌或违约，发生成份券停牌或违约时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度扩大。

（五）增强性投资的积极投资风险

增强性积极投资的风险主要体现为基金经理为了获得超越指数的投资回报而通过采用积极投资的手段增加投资组合的风险度。但由于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，既可能高于指数收益，

也可能低于指数收益：在债券投资组合久期偏离指数久期的情况下，基金管理人对利率走势的判断与市场真实走势会出现差异，可能造成基金收益低于指数收益；即使债券投资组合久期与指数久期基本一致，如果基金对长、中、短期债券的持有结构与指数存在差异，当债券收益率曲线出现非平行移动时，则由于长、中、短期债券的相对价格变化幅度不同，可能造成基金收益低于指数收益；如果债券投资组合中不同类属资产的权重与指数存在差异，则当类属资产间的收益率差异发生变化，可能造成基金收益低于指数收益；基金管理人调整债券整体投资比例，如通过回购进行杠杆操作时，可能由于自身判断与市场走势存在差异，而造成基金收益低于指数收益；此外，股票投资作为指数化投资的增强性体现，当股票投资收益低于目标指数收益时，也会造成基金收益低于指数收益。

因此，本基金的积极投资风险具体可能由下列投资方式产生：对一些指数样本券的投资权重进行适当调整，选择其它债券对指数样本券进行替代，调节债券投资的仓位以及进行比例限制内的股票投资等。

（六）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，主要存在以下几种风险：

1、政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致证券市场波动而影响基金收益，产生风险。

2、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

3、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，各个行业及上市公司的盈利水平也呈周期性变化，从而影响到个股乃至整个行业板块的二级市场走势。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术更新、新产品研究开发、高级专业人才流动等风险。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、国际竞争风险。随着中国开放程度的提高，上市公司的发展必然也受到发达国家同类技术及同类产品进入中国市场的影响。尤其是中国加入 WTO（世界贸易组织），市场开放程度加大之后，中国境内公司必然面临国际竞争风险。

6、购买力风险。基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

7、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

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

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

（七）流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，流动性风险管理的目标则是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

1、基金申购、赎回安排

参见本招募说明书“九、基金份额的申购与赎回”的相关规定。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

本基金出现巨额赎回情形下，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。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，

基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，经过内部审批程序并与基金托管人协商确认。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

5、指数中样本券之间流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于样本券的流动性高低存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些样本券的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得本基金在以指数权重为基础进行操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对债券价格产生比较大的影响，增加建仓成本或变现成本。

5、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

（八）管理风险

本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等要素，而影响基金收益水平。

（九）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限计算并显示净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

（十）操作风险

在投资流程的各个环节中，由于制度建设、人员配备或内控机制的不完善或相关业务人员违反操作规程而产生的风险。如：交易差错、系统运行故障等。

（十一）其他风险

- 1、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险；
- 2、证券市场、基金管理人及基金销售代理人可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。
- 3、其他意外导致的风险。

二十、基金的终止与清算

（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.基金经持有人大会表决终止的；
- 2.因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
- 3.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，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；
- 4.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，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；
- 5.由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 6.出现标的指数不符合要求（因成份券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；
- 7.中国证监会允许的其他情况。

（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，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

（3）基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

2、清算程序

- （1）基金终止后，由基金清算小组统一接管基金；
- （2）对基金资产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金资产进行估值；
- （4）对基金资产进行变现；

(5)将清算结果报告中国证监会；

(6)公布基金清算公告；

(7)对基金资产进行分配。

3、清算费用

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

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) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、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。

6、清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

二十一、基金合同的内容摘要

（一）基金合同当事人的权利义务

1、基金发起人的权利与义务

本基金的基金发起人为长盛基金管理有限公司。

（1）基金发起人的权利

- 1) 申请设立基金；
- 2) 法律、法规和《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) 公告招募说明书和发行公告；
- 3) 不从事任何有损基金及其它基金当事人利益的活动；
- 4) 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；
- 5) 法律法规及基金合同规定的其它义务。

2、基金管理人的权利与义务

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司。

（1）基金管理人的权利

- 1) 自本基金成立之日起，依据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基金合同或国家有关法律对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，必要时应采取保护措施保护基金投资者的利益；
- 4) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；
- 5) 直接销售基金单位，获取认购（申购）费用；
- 6) 依据基金合同及有关法律决定基金收益的分配方案；
- 7) 在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；
- 8) 依据基金合同的规定获得基金管理费收入；

9) 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) 配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购和赎回业务或委托其它机构代理该项业务;

4) 配备足够的专业人员进行基金的登记注册或委托其它机构代理该项业务;

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基金管理人的资产相互独立,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》及其他有关规定外,不为自己及任何第三人谋取利益,不委托第三人运作基金资产;

7) 接受基金托管人的监督;

8) 按规定计算并公告基金资产净值及基金单位资产净值;

9) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

10) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、《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;

11) 依据《基金合同》规定向基金份额持有人分配收益;

12) 按照法律法规和本《基金合同》的规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

13) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

14) 依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会;

15) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上;

16) 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;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,

并得到有关资料的复印件；

17) 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；

18) 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；

19) 因过错导致基金资产的损失时，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；

20) 因估值错误导致投资人的损失，属管理人责任的，应承担赔偿责任，并采取适当、合理的方式向投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

21) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

22) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

本基金的基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

(1) 基金托管人的权利

1) 依法持有并保管基金资产；

2) 依本《基金合同》约定获得基金托管费；

3) 监督本基金的投资运作；

4) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2) 基金托管人的义务

1) 依法持有并保管基金资产；

2) 依本《基金合同》约定获得基金托管费；

3) 监督本基金的投资运作；

4) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

1) 依法持有基金资产；

2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并保管基金资产；

3) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

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，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基

金资产相互独立；对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名册登记、账户设置、资金划拨、账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》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；

6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

7) 以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户，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；

8) 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》、《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；

9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值；

10) 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人民银行；

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

12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金单位认购、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；

13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定；

14) 在定期报告内出具基金托管人意见，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) 建立并保存基金份额持有人名册；

16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

17) 按规定制作相关账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份额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

中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；

21) 因过错导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

22) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金管理人追偿；

23) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

4、基金份额持有人的权利与义务

(1) 基金份额持有人的权利

1) 取得基金收益；

2) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；

3) 监督基金运作状况，获取基金业务及财务状况的资料；

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、托管人、销售机构、登记注册机构的错误导致基金份额持有人利益受损害的情况下，要求赔偿的权利；

6) 参与基金清算后的剩余资产的分配；

7) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

每份基金单位具有同等的合法权益。

(2) 基金份额持有人的义务

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) 以其持有的基金份额为限承担基金亏损或者终止的责任；

4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；

5) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10% 以上（不含 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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）提前终止基金合同；
- （2）基金扩募或延长基金合同期限；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；
- （5）基金管理人、基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）对基金当事人权利和义务产生重大影响的基金合同修改，但基金合同及法律、法规另有规定的除外；
- （8）《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）因相应的法律、法规（包括证券监督管理部门的要求，下同）发生变动必须对基金合同进行修改、变更；
- （3）对基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （4）对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （5）按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

3、会议召集方式

（1）除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定，在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；

（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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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

行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

(3) 代表基金份额 10% 以上（不含 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，代表基金份额 10%（不含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起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；

(4) 代表基金份额 10% 以上（不含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10% 以上（不含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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

4、通知

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1) 会议召开时间、地点、方式；
- 2) 会议审议事项、议事程序、表决方式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 代理投票委托书送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名、电话；
- 6) 其他注意事项。

(2) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有

人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

5、会议的召开方式

(1) 会议方式

- 1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
- 3) 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；
- 4) 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事宜或转换基金运作方式必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2) 基金份额持有人大会召开条件

1) 现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

- a) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；
- b) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 15 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

2) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

- a) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- b) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；
- c) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人

所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上（不含 50%）；

d) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表, 同时提交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。

如表决截止日前（含当日）未达到上述要求, 则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 15 个工作日后）, 但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

6、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1) 议事内容仅限于基金合同“五、基金份额持有人大会（二）召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

2) 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；

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进行解释和说明；

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。

（2）议事程序

1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时, 由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会

时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上（不含 50%）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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。

2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 10 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

7、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

(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及代理人所持表决权的 50%（不含 50%）以上通过方为有效；除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、提前终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

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。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 对于通讯开会方式的表决，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无效表决。

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

8、计票

（1）现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名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和代理人中选举三名代表担任监票人；

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，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怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会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，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。

（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（若基金托管人担任召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

9、生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起五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。

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

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告。

10、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（三）基金合同的修改和终止

1、《基金合同》的修改

（1）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）修改基金合同应召开基金份额持有人大会，基金合同修改的内容应经基金份额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。但如因相应的法律法规发生变动并属基金合同必须遵照进行修改的情形或基金合同的修改事项对基金份额持有人的利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

2、《基金合同》的终止

(1) 出现下列情况之一的，基金合同经中国证监会批准后将终止：

- 1) 基金经持有人大会表决终止的；
- 2) 因重大违法行为，基金被中国证监会责令终止的。
- 3) 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，而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；
- 4) 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，而无其他适当的托管机构承受其原有权利及义务；
- 5) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 6) 出现标的指数不符合要求（因成份券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；
- 7) 中国证监会允许的其他情况。

(2) 《基金合同》的终止。本基金终止后，须依法和本《基金合同》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。

(四) 争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应由各方通过协商予以解决。协商自一方向其他各方发出书面协商通知之日开始。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权就该争议向有管辖权的人民法院提起诉讼。在争议处理期间，除争议事项外，《基金合同》的其他条款继续全面有效，各方当事人均应遵守、履行。

(五) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》及其修订本正本一式五份，除上报有关监管机构二份外，基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资人可免费查阅；也可按工本费购买本《基金合同》印制件或复印件，但应以《基金合同》正本为准。

二十二、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

本基金的基金发起人、基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的监督和核查

（1）监督和核查内容

基金托管人就基金资产的投资组合的比例、投资范围、基金管理人的报酬计提比例和支付方法、基金资产核算、基金资产净值的计算、收益分配、基金的申购和赎回等是否符合《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定，对基金管理人进行监督和核查。

（2）处理方式和程序

基金托管人发现基金管理人的违规行为，应以书面形式通知基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人再对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）。

基金管理人发生重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。

2、基金管理人对基金托管人的监督和核查

（1）监督和核查内容

基金管理人根据暂行办法、基金合同及其他有关规定，就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

（2）处理方式和程序

基金管理人发现基金托管人的违规行为，应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进行核对确认并回函；在限期内，基金管理人再对通知事项进行复查，如基金托管人未予纠正，基金管理人将报告中国证监会。

基金托管人有重大违规行为时，基金管理人应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

（三）基金资产的保管

1、基金资产保管的原则

基金托管人应安全、完整保管本基金的全部资产。基金资产与基金管理人和基金托管人的资产严格分开，并应对基金资产运作情况严格保密（中国证监会要求披露的除外）。

2、基金成立的验资

基金发行期结束后，基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，并由其出具验资报告。

3、基金资金账户的开设和管理

（1）基金的银行账户的开设和管理由基金托管人承担。基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金的基本账户，在中国证券登记结算有限责任公司——上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司——深圳分公司开设备付金账户（用于证券交易的资金清算）。

（2）除基金合同中另有规定以外，双方均不得以基金名义在其他银行或非银行金融机构开立任何基金银行账户。

（3）基金银行账户的管理要符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

（4）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付活动，均需通过本基金的银行账户进行。

4、基金证券账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的形式的名义在中国证券登记结算有限责任公司——上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司——深圳分公司开设一个证券账户。

5、基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于存管银行的保管库；也可以存入中央国债登记结算公司或中国证券登记结算有限责任公司——上海分公司、深圳分公司的代保

管库中。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

6、与基金财产有关的重大合同的保管

基金管理人代表基金签署与基金财产有关的重大合同，在签署前应通知基金托管人。与基金财产有关的重大合同全部由基金托管人保管。

（四）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

（1）基金资产净值计算

基金资产净值是指基金资产总值扣除按照国家有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

每份基金单位资产净值等于计算日基金资产净值除以计算日基金单位总份额后的价值。

基金资产净值每日计算，每个开放日的次日公告开放日基金单位资产净值。

（2）复核程序

基金管理人每日对基金资产进行估值后，将估值结果（估值表）通过加密传真传递给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行逐项复核；经基金托管人复核无误后，签字返回给基金管理人；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。

因基金资产净值计算错误造成损失，由基金管理人和基金托管人共同承担责任；各自承担责任的具体比例根据有关法律法规、行业规则和权责一致的原则确定。

（3）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

（4）基金账册的建立和基金账册的定期核对

①账册的建立：基金管理人和基金托管人应指定经办本基金财务的会计人员负责编制、保管基金的会计账册；双方管理或托管的不同基金的会计账册，应完全分开，单独编制和保管。

②凭证保管及核对：证券交易凭证由基金管理人与基金托管人分别保管并据

此建账。

基金托管人办理基金的资金收付、证券实物出入库所获得的凭证由基金托管人保管原件并记账，每月编制业务明细表并附指令回执和单据复印件交基金管理人记账。

（5）基金财务报表的编制、复核的时间和程序

①财务报表的编制：基金财务报表，包括资产负债表、收益及收益分配表、基金净值变动表、证券投资明细表、基金估值表以及主管部门规定的其他报表，由基金管理人和基金托管人按月分别编制。

②报表复核：基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。核对无误后，在核对过的基金财务报表上加盖基金托管人和基金管理人印章，各留存一份。

③基金财务报表的编制与复核时间安排：月度报表每月终了后 5 日内完成；年中报表为基金会计年度半年终了后 30 日内完成；年度报表为基金会计年度结束后 45 日内完成。

（五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册的登记由中国证券登记结算有限责任公司办理。基金管理人也可以委托商业银行和中国证监会认定的其它机构代为办理基金份额持有人名册的登记业务。基金份额持有人名册应当包括初次募集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、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册。

基金份额持有人名册由中国证券登记结算有限责任公司及由基金管理人委托的其它机构保管。

（六）争议解决方式

因本托管协议引起的或者与本托管协议有关的一切争议应由本托管协议双方当事人通过协商予以解决。协商自一方当事人向对方发出书面协商函件之日开始。如果协商开始后三十日内双方仍不能解决该争议，则任何一方当事人均有权向有管辖权的人民法院提起诉讼。

在争议处理期间，除争议事项外，本托管协议的其它条款仍继续全面有

效，双方当事人仍应遵守、履行。

(七) 托管协议的修改与终止

1、对本托管协议的任何修改或补充，须经本协议双方当事人一致书面同意，修改后的托管协议报中国证监会批准后生效，并通过适当方式通知基金份额持有人。

2、发生以下情形，托管协议将终止：

- ①基金合同终止；
- ②基金托管人解散、撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- ③基金管理人解散、撤销、破产或由其他基金管理人接管其基金管理权；
- ④发生《基金法》及其他法律法规规定的基金终止之事项。

二十三、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、基金销售机构提供。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）86497888、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

长盛基金管理有限公司客户服务电子信箱：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。

二十四、其他应披露事项

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	长盛全债指数增强型债券投资基金招募说明书（更新）	2021-5-31
4	长盛全债指数增强型债券投资基金基金产品资料概要（更新）	2021-5-31
5	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	2021-6-10
6	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	2021-6-18
7	长盛基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	2021-6-29
8	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	2021-7-2
9	长盛基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司销售旗下部分基金并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	2021-7-13
10	长盛基金管理有限公司关于董事变更的公告	2021-7-17
11	长盛全债指数增强型债券投资基金2021年第2季度报告	2021-7-21
12	长盛基金管理有限公司旗下全部基金2021年2季度报告提示性公告	2021-7-21
13	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	2021-7-22
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券费率优惠活动的公告	2021-7-26
15	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	2021-7-27
16	长盛基金管理有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司销售旗下部分基金并开通定投及参加费率优惠活动的公告	2021-8-17
17	长盛基金管理有限公司旗下全部基金2021年中期报告提示性公告	2021-8-28
18	长盛旗下基金2021年中期报告	2021-8-28
19	长盛全债指数增强型债券投资基金2021年中期报告	2021-8-28
20	长盛基金管理有限公司关于调整长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理的公告	2021-9-25
21	长盛全债指数增强型债券投资基金基金产品资料概要（更新）	2021-9-27
22	长盛全债指数增强型债券投资基金招募说明书（更新）	2021-9-27
23	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加意才基金为销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	2021-10-12
24	长盛基金管理有限公司关于暂停使用工行快捷服务办理直销网上交易部分业务的公告	2021-10-26
25	长盛基金管理有限公司旗下全部基金2021年3季度报告提示性公告	2021-10-27
26	长盛全债指数增强型债券投资基金2021年第3季度报告	2021-10-27
27	长盛旗下基金2021年第3季度报告	2021-10-27
28	长盛基金管理有限公司关于工商银行快捷支付渠道升级上线的公告	2021-11-26
29	长盛基金管理有限公司关于瑞银证券有限责任公司终止办理旗下基金相关销售业务的公告	2021-12-22

30	长盛基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	2022-1-1
31	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	2022-1-1
32	长盛全债指数增强型债券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	2022-1-11
33	长盛全债指数增强型债券投资基金收益分配公告	2022-1-13
34	长盛基金管理有限公司关于增加东方财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告	2022-1-14
35	长盛全债指数增强型债券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	2022-1-17
36	长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）2021 年第 4 季度报告	2022-1-22
37	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	2022-1-22
38	长盛全债指数增强型债券投资基金 2021 年第 4 季度报告	2022-1-22

二十五、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人和销售代理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十六、备查文件

- (一) 中国证监会批准长盛中信全债指数增强型债券投资基金设立的文件
- (二) 法律意见书
- (三) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (四) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (五) 《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》
- (六) 登记结算协议
- (七) 《长盛全债指数增强型债券投资基金托管协议》
- (八) 中国证监会规定的其它文件

长盛基金管理有限公司

2022年3月9日