长城久泰沪深300指数证券投资基金招募说明书更新（2023年第1号）

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二〇二三年三月

长城久泰沪深300指数证券投资基金经中国证监会2004年4月2日证监基金字【2004】51号文批准发起设立。基金合同于2004年5月21日正式生效。

重要提示

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

（二）投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书、基金产品资料概要和基金合同；

（三）基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益；

（四）本招募说明书所载内容截止日为2023年2月15日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年12月31日，财务数据未经审计。

目录

一、绪言.....3
二、释义.....4
三、基金管理人.....11
四、基金托管人.....20
五、相关服务机构.....25
六、基金的募集与基金合同的生效.....27
七、基金份额的申购与赎回.....28
八、基金的投资管理.....34
九、基金的业绩.....45
十、基金的财产.....48
十一、基金资产估值.....49
十二、基金的收益分配.....54
十三、基金的费用与税收.....55
十四、基金的会计与审计.....61
十五、基金的信息披露.....62
十六、风险揭示.....67
十七、基金的终止与清算.....70
十八、基金合同的内容摘要.....72
十九、基金托管协议的内容摘要.....83
二十、对基金份额持有人的服务.....92
二十一、其他应披露的事项.....93
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....95
二十三、备查文件.....96

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信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作管理办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售管理办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称《流动性风险规定》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”））等有关法律法规及《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他规定享有权利、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。

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

二、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指长城久泰沪深 300 指数证券投资基金
基金合同或本基金合同：	指《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何修订和补充，根据最新法律法规，原基金契约均改称为基金合同
招募说明书：	指《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》及其更新
基金产品资料概要：	指《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
托管协议：	指《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
发行公告：	指《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金发行公告》
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并公布，自 2004 年 6 月 1 日起施行，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
《证券法》	指 1998 年 12 月 29 日经中华人民共和国第

	九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订
《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
《运作管理办法》	指2014年7月7日由中国证监会发布并于2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售管理办法》	指2013年3月15日由中国证监会发布并于同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《流动性风险规定》	指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
《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

中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人：	指长城基金管理有限公司
基金托管人：	指招商银行股份有限公司
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括持有人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记人：	指办理基金注册与登记过户业务的机构。本基金的基金注册登记人为长城基金管理有限公司
基金销售机构：	指基金管理人的直销机构及代销机构
直销机构：	指长城基金管理有限公司
代销机构：	指接受长城基金管理有限公司委托代为办理本基金销售业务的机构
个人投资者：	指依据有关法律法规规定可投资于证券投

	资基金的自然人
机构投资者：	指在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续、依法可投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织以及中国证监会批准的合格境外机构投资者
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
基金募集期：	指自招募说明书公告之日起到基金认购截止日的时间段，最长不超过 3 个月
基金合同生效日：	指本基金达到法定成立条件后，基金管理人宣布基金成立的日期
存续期：	指基金合同生效后的不定期之期限
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所及其他相关证券交易场所的正常交易日
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回或其他业务申请的日期

T 日：	指申购、赎回或其他交易的申请日
T＋n 日：	指 T 日起（不包括 T 日）第 n 个工作日
认购：	指投资者在本基金募集期内购买本基金份额的行为
申购：	指投资者在本基金存续期间提出申请购买本基金份额的行为
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金份额的行为
基金账户：	指基金注册登记人为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户
基金交易账户：	指基金销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖基金份额、基金份额变动及资金结余情况的账户
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合法收入
基金资产总值：	是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收申购款以及其它资产的价值总和

基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
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
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
基金份额类别:	指根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值
A 类基金份额：	指在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根

	据持有期限收取赎回费用的基金份额类别
C 类基金份额:	指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别
销售服务费：	指从 C 类基金份额的基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用
指定媒体：	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）等媒介

三、基金管理人

（一） 基金管理人概况

1.名称：长城基金管理有限公司

2.住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

3.办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38层、39层

4.法定代表人：王军

5.组织形式：有限责任公司

6.设立日期：2001年12月27日

7.电话：0755-29279188　　传真：0755-29279000

8.联系人：崔金宝

9.客户服务电话：400-8868-666

10.注册资本：壹亿伍仟万元

11.股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券股份有限公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

（二） 基金管理人主要人员情况

1、董事、监事及高管人员介绍

（1） 董事

王军先生，董事长，学士。1999 年加入中国华能集团有限公司，历任财务部主管、副处长、处长、副主任等职务。2018年11月出任长城基金管理有限公司董事长。

邱春杨先生，董事、总经理、首席信息官、投资决策委员会主任，博士。2001 年 3 月至2002年10月任职于南方证券资产管理部；2002年11月至2020年7月任职于广发基金

管理有限公司（含广发基金筹备期），历任研究发展部产品设计小组组长、机构理财部副总经理、金融工程部总经理、产品总监、公司副总经理和督察长职务。2020 年 7 月出任长城基金管理有限公司总经理。

曾贽先生，董事，硕士，现任长城证券股份有限公司副总裁。曾任职于深圳市汇凯进出口有限公司、深圳市华新股份有限公司。1999 年 3 月加入长城证券，历任债券业务部总经理助理、固定收益部总经理助理（主持工作）、固定收益部销售交易部总经理（主持固定收益部工作）、固定收益部总经理、公司固定收益总监、公司总裁助理等职务，2019 年 3 月至今任公司党委委员，2019 年 6 月至今任公司副总裁。

曾晓玲女士，董事，硕士，现任长城证券股份有限公司总裁助理兼人力资源部总经理。曾任职于深圳义达会计师事务所、蛇口集装箱码头有限公司、富鼎投资管理有限公司、上海东方威球货运代理有限公司深圳分公司。2003 年 5 月加入长城证券，历任风险管理部总经理助理、副总经理，风控合规管理部总经理，风险管理部总经理等职务，2019 年 3 月至今任公司总裁助理，2021 年 3 月至今任人力资源部总经理。

姬宏俊先生，董事，硕士，现任中原信托有限公司副总裁。曾任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。

朱静女士，董事，硕士，现任东方证券股份有限公司职工董事、战略发展总部总经理、工会办事机构主任，东方金融控股（香港）有限公司董事、总经理，上海东证期货有限公司董事，东证国际金融集团有限公司董事，诚泰融资租赁（上海）有限公司董事。自 1992 年 7 月至 1995 年 5 月任西安矿山机械厂职员，1995 年 5 月至 1999 年 2 月任上海财通国际投资管理有限公司证券管理部经理、副总经理，1999 年 3 月至 2015 年 2 月历任东方证券股份有限公司经纪业务总部职员、业务规划董事、运行资深主管、总经理助理，营运管理总部总经理助理、副总经理，董事会办公室副主任，自 2015 年 2 月起担任东方证券股份有限公司战略发展总部总经理，2019 年 4 月起兼任东方金融控股（香港）有限公司总经理，2021 年 9 月起兼任东方证券股份有限公司工会办事机构主任。

张文栋先生，董事，硕士，现任北方国际信托股份有限公司副总经理。曾任职于深圳新产业投资股份有限公司，2003 年 10 月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务二部总经理、北方国际信托股份有限公司业务总监、运营总监、副总经理。

万建华先生，独立董事，博士，高级经济师，现任上海市互联网金融行业协会会长，通联支付网络服务股份有限公司董事长。曾任中国人民银行资金管理司宏观分析处处长；招商银行总行常务副行长；长城证券董事长；招商证券董事长；中国银联首任董事长、总裁；上海国际集团总裁；国泰君安证券董事长等职务。

唐纹女士，独立董事，学士，现已退休。曾任电力部科学研究院系统所工程师，中国国际贸易促进委员会经济信息部副处长、处长，中国华能集团香港公司副总经理、党委书

记。

徐英女士，独立董事，学士，现已退休。曾任北京财贸学院金融系助教、讲师，海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理，长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记，景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事，新华资产管理股份有限公司副董事长。

温子健先生，独立董事，硕士，现已退休。曾任内蒙古广播事业局技术员,南京物资学校教师,人民日报记者,深圳证券时报社有限公司社长兼总编辑。

（2） 监事

吴礼信先生，监事会主席，硕士，现任长城证券股份有限公司董事会秘书。曾任职于安徽省地矿局三二六地质队、深圳中达信会计师事务所、大鹏证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司。2003 年 4 月加入长城证券，历任会计核算部总经理、财务管理中心副总经理、财务部总经理、公司财务总监等职务，2015 年 3 月至今任公司董事会秘书。

曾广炜先生，监事，学士，现任北方国际信托股份有限公司风险总监。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司，2003 年 1 月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理、北方国际信托股份有限公司风险总监。

丁艳女士，监事，硕士，现任东方证券股份有限公司职工监事、稽核总部总经理，上海东方证券资本投资有限公司董事，东方证券承销保荐有限公司监事。曾任职于中国人民银行上海分行/总部，2017 年 1 月起历任东方证券股份有限公司稽核总部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）、总经理。

黄魁粉女士，监事，硕士，现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002 年 7 月进入中原信托有限公司，曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

赵永强先生，职工监事，学士，现任长城基金管理有限公司运行保障部总经理。2004 年 7 月加入华润（深圳）有限公司任职财务会计；2008 年 4 月加入中国平安保险（集团）股份有限公司，任职于资金部、财务部；2010 年 4 月加入长城基金管理有限公司，任职于运行保障部。

崔金宝先生，职工监事，学士，现任长城基金管理有限公司综合管理部副总经理(主持工作）。2002 年 8 月至 2013 年 9 月任职于华能临沂发电有限公司财务部，2013 年 9 月至 2019 年 10 月任职于华能山东发电有限公司财务部。2019 年 10 月加入长城基金管理有限公司，任综合管理部副总经理；2021 年 9 月起主持综合管理部工作。

张静女士，职工监事，硕士，现任长城基金管理有限公司监察稽核部业务主管。2005 年 7 月至 2007 年 5 月任职于摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部，2007 年 5 月加入长城基金管理有限公司。

侯涛先生，职工监事，本科，现任长城基金管理有限公司综合管理部副总经理。1994年9月至1998年7月任职于安徽省电力建设第一工程公司，1998年7月至2001年7月任职于安徽省芜湖市供电局，2001年7月至2012年9月任职于深圳证券通信有限公司，2012年9月加入长城基金管理有限公司。

（3） 高级管理人员

王军先生，董事长，简历同上。

邱春杨先生，董事、总经理，简历同上。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼权益投资部总经理、投资决策委员会委员、基金经理，硕士。曾任职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。2001年10月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、研究部总经理、公司总经理助理。

张勇先生，副总经理、固定收益投资总监、债券投资部总经理、投资决策委员会委员、基金经理，硕士。2001年起历任南京银行股份有限公司信贷员、交易员；2003年起历任博时基金管理有限公司交易员、基金经理助理、基金经理、固定收益部副总经理；2015 年起任九泰基金管理有限公司绝对收益部总经理兼执行投资总监；2019 年 5 月加入长城基金管理有限公司，历任固定收益部总经理、公司总经理助理。

车君女士，督察长，硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993 年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。2011 年 12 月加入长城基金管理有限公司。

2、本基金基金经理简历

雷俊先生,硕士。2008年7月-2017年11月曾就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2017年11月加入长城基金管理有限公司，现任公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、基金经理兼投资经理。自2019年5月至2021年10月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2018年11月至今任“长城中证500指数增强型证券投资基金”、“长城久泰沪深300指数证券投资基金”基金经理，自2019年1月至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”基金经理，自2019年5月至今任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理，自2020年1月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至今任“长城基金-量化1号单一资产管理计划”投资经理，自2022年6月至今任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理。

杨建华先生,硕士，注册会计师（CPA）。1991年7月-1996年8月曾就职于大庆石油管理局，1998年6月-1999年10月曾就职于华为技术有限公司，1999年10月-2000年5月曾就职于深圳市和君创业投资公司，2000年5月-2001年9月曾就职于长城证券有限责任公司

投资银行部。2001年10月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、总经理助理、研究部总经理，现任公司副总经理、投资总监、权益投资部总经理、投委会委员兼基金经理。自2007年9月至2009年1月任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自2011年1月至2013年6月任“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理，自2009年9月至2016年9月任“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”基金经理，自2017年6月至2018年8月任“长城久兆中小板300指数分级证券投资基金”基金经理，自2018年8月至2018年11月任“长城中证500指数增强型证券投资基金”基金经理，自2017年8月至2019年2月任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2019年4月至2022年10任“长城核心优势混合型证券投资基金”基金经理。自2004年5月至今任“长城久泰沪深300指数证券投资基金”基金经理，自2013年6月至今任“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理，自2020年3月至今任“长城价值优选混合型证券投资基金”基金经理，自2021年5月至今任“长城消费30股票型证券投资基金”基金经理，自2021年10月至今任“长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金”基金经理，自2021年12月至今任“长城价值领航混合型证券投资基金”基金经理，自2022年4月至今任“长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自2023年2月至今任“长城品质成长混合型证券投资基金”基金经理。

3、本基金管理人公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

邱春杨先生，投资决策委员会主任，公司总经理、首席信息官。

杨建华先生，投资决策委员会委员，公司副总经理、投资总监兼权益投资部总经理、基金经理。

张勇先生，投资决策委员会委员，公司副总经理、固定收益投资总监、债券投资部总经理、基金经理。

马强先生，投资决策委员会委员，公司总经理助理、多元资产投资部总经理、基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三） 基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者聘请经中国证监会认定的中介机构办理与基金份额的发售、申购、赎回和登记有关的事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金资产分别管理、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、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息；

8、办理与基金资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、保存基金资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. 基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》和《中华人民共和国证券投资基金法》行为的发生；

2. 基金管理人承诺不从事违反《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法规的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止违反以上法规行为的发生；

3. 基金管理人承诺严格遵守《基金合同》，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金合同》行为的发生；

4. 基金管理人承诺不从事其他证券法规规定禁止从事的行为。

（五） 基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎勤勉的原则，充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不得利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何第三者谋取不当利益；

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、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（六） 基金管理人的内部控制制度

健全、完善的内部风险控制制度是规范公司行为，有效防范经营风险，实现公司持续、稳健发展的主要保证，也是公司经营管理水平的重要标志。为此，公司建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度。

1、风险控制的目标

公司风险控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理实体。具体目标是：

（1）确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行；

（2）建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；

（3）不断提高基金管理的效率和效益，在有效控制风险的前提下，努力实现基金份额持有人利益最大化；

（4）努力将各种风险控制在规定的范围内，保障公司发展战略和经营目标的全面实施，维护公司股东的合法权益；

（5）建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

2、建立风险控制制度的原则

公司按照合法、合规、稳健的要求，制定明确的经营方针，建立合理的经营机制。在建立风险控制制度时应严格遵循以下原则：

（1）全面性原则：风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

（2）审慎性原则：内部风险控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（3）独立性原则：公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行部门；风险控制与审计委员会、督察长和监察稽核部、风险管理部应保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查；

（4）有效性原则：风险控制制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行风险控制制度不能存在任何例外，公司任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力；

（5）适时性原则：内部风险控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

（6）防火墙原则：公司基金投资、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序。

3、风险控制的主要内容

（1）确立加强内部风险控制的指导思想，确定风险控制的目标和原则；

（2）建立层次分明、权责明确的风险控制体系；

（3）建立公司风险控制程序；

（4）对公司内部风险进行全面、系统的评估，制定风险控制计划；

（5）确定公司风险控制的路径和措施；

（6）保障风险控制制度的持续性和有效性，制定可行的风险控制制度的评价和检查机制。

4、风险控制体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构，并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系：

（1）一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险控制与审计委员会，负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。对公司内部控制制度的有效性进行评价，对公司经营管理和基金业务运作的合法合规性进行监督检查，协助董事会建立并有效维持公司内部控制系统，对公司经营中的风险进行研究、分析和评估，并提出风险防范措施和建议，保证公司的规范健康发展。风险控制与审计委员会的基本职能为：

① 协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。

② 审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。

③ 检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况，并出具评估意见或改正方案；

④ 定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报；

⑤ 检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见；

⑥ 评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险，检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性，并提出改进意见；

⑦ 检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序，与外部审计机构进行交流；

⑧ 对公司内部控制和风险管理工作进行考核；

⑨ 董事会安排的其他事项。

公司设督察长。督察长作为风险控制与审计委员会的执行机构，对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制与审计委员会的授权进行工作。

（2）二级风险防范

二级风险防范是指在公司投资决策委员会和监察稽核部、风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。

投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。其在风险控制中主要职责为：

① 研究并确立公司的基金投资理念和投资方向；

② 决定基金资产在现金、债券和股票中的分配比例；

③ 审核基金经理提出的投资组合方案，对其运作过程中的风险进行评估和控制；

④ 批准基金经理拟订的投资原则，对基金经理做出投资授权；

⑤ 对超出投资决策委员会执行委员及基金经理权限的投资项目作出决定。

监察稽核部、风险管理部在总经理的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。其在风险控制中主要职责是：

① 根据各项风险的产生环节，和相关的业务部门一起，共同制定对风险的事前防范和事后审查方案；

② 就各部门内部风险控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告及建议职能；

③ 调查公司内部的违规案件，协助监管机构处理相关事宜；

④ 对基金运作和公司内部管理进行日常监督与稽核，并向总经理汇报。

（3）三级风险防范

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：

① 一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；

② 相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各部门和岗位分别在自己的授权范围内承担各自的职责，将风险控制在最小范围内。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部风险控制制度。

四、基金托管人

一、基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：王良

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码：3968)，10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2022年9月30日，本集团总资产97,071.11亿元人民币，高级法下资本充足率17.17%，权重法下资本充足率14.36%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、基金券商产品团队、银保信托产品团队、养老金团队、交易与清算团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、系统与数据团队 9个职能团队，现有员工150人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(QDII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使

命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017 年 6 月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12 月荣获 2019 东方财富风云榜“2019 年度最佳托管银行”奖。2020 年 1 月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2019 年度优秀资产托管机构”奖项；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；10 月荣获《中国基金报》“2019 年度最佳基金托管银行”奖。2021 年 1 月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2020 年度优秀资产托管机构”奖项；1 月荣获 2020 东方财富风云榜“2020年度最受欢迎托管银行”奖项；2021年10月，荣获国新投资有限公司“2021 年度优秀托管银行奖”和《证券时报》“2021 年度杰出资产托管银行天玑奖”；2021 年 12 月，荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖“2020 年度最佳基金托管银行”；2022 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2021 年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构”；9 月荣获《财资》“中国最佳托管银行”“最佳公募基金托管银行”“最佳理财托管银行”三项大奖。

二、主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020 年 9 月起担任本行董事、董事长。中央

财经大学经济学博士，高级经济师。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险 集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王良先生，本公司执行董事、党委书记、行长，兼任财务负责人、董事会秘书。中国人民大学硕士研究生学历，高级经济师。1995 年 6 月加入本公司北京分行，自 2001 年 10 月起历任本公司北京分行行长助理、副行长、行长，2012 年 6 月任本公司行长助理兼任北京分行行长，2013 年 11 月不再兼任本公司北京分行行长，2015 年 1 月任本公司副行长，2016年11月至2019年4月兼任本公司董事会秘书，2019年4月起兼任本公司财务负责人，2021 年 8 月起任本公司常务副行长兼任董事会秘书、公司秘书及香港上市相关事宜之授权代表，2022 年 4 月 18 日起全面主持本公司工作，2022 年 5 月 19 日起任本公司党委书记，2022年6月15日起任本公司行长。兼任中国支付清算协会副会长、中国银保监会数据治理高层指导协调委员会委员、中国银行业协会中间业务专业委员会第四届主任、中国金融会计学会第六届常务理事。

汪建中先生，本行副行长。1991年加入本行；2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016 年 10 月至 2017 年 4 月任本行业务总监兼北京分行行长；2017 年 4 月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019 年 4 月起任本行副行长。

孙乐女士，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，2001 年 8 月加入招商银行至今，历任招商银行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长，具有 20 余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至 2022 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 1129 只证券投资基金。

四、托管人的内部控制制度

1、 内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，坚持守法经营、规范运作的经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消

除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、 内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；总行风险管理部、法律合规部、审计部独立对资产托管业务进行评估监督，并提出内控提升管理建议。

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立风险合规管理相关团队，负责部门内部风险预防和控制，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况，并直接向部门总经理室报告。

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3、 内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险，且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格有效执行。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与我行其他业务场地隔离，办公网和业务网物理分离，部门业务网和全行业务网防火墙策略分离，以达到风险防范的目的。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务重要事项和高风险环节。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置、权责分配及业务流程等方面相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

4、 内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，建立了三层制度体系，即：基本规定、业务管理办法和业务操作规程。制度结构层次清晰、管理要求明确，满足风险管理全覆盖的要求，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（3）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中获取的客户资料严格保密，除法律法规和其他有关规定、监管机构及审计要求外，不向任何机构、部门或个人泄露。

（4）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统机房、权限管理实行双人双岗双责，电脑机房 24 小时值班并设置门禁，所有电脑设置密码及相应权限。业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

（5）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效地进行人力资源管理。

五、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

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》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

五、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构

（1）长城基金管理有限公司直销中心

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

法定代表人：王军

电话：0755-29279128

传真：0755-29279124

联系人：余伟维

客户服务电话：400-8868-666

网址：www.ccfund.com.cn

（2）长城基金管理有限公司网上直销系统

网上直销系统包括基金管理人网上交易平台（https://etrade.ccfund.com.cn/etrading/）、长城基金管家（手机APP）和基金管理人指定的电子交易平台。个人投资者可以登录基金管理人网上交易平台、长城基金管家(手机APP）和基金管理人指定的电子交易平台，在与基金管理人达成网上交易相关协议、接受基金管理人相关服务条款、了解基金网上交易业务规则后，通过基金管理人网上直销系统办理开户、申购、赎回等业务。

2、代销机构

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时在网站上公示。

本基金销售机构及联系方式请查阅本基金管理人网站上的公示信息。

（二）基金注册登记人

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

法定代表人：王军

电话：0755-29279188

传真：0755-29279000

联系人：阳雄

客户服务电话：400-8868-666

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京市中伦律师事务所

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 36-37 层

负责人：张学兵

电话：0755-33256666

传真：0755-33206888

联系人：李伟健

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所（办公地址）：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁

电话：0755-25028023

传真：0755-25026023

联系人：昌华

六、基金的募集与基金合同的生效

（一）基金的募集

本基金经中国证监会证监基金字【2004】51 号文批准发起设立，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募集，募集期从 2004 年 4 月 12 日起到 2004 年 5 月 19 日止，共募集 1,512,020,891.32 份基金份额，募集户数为 14,519 户。

（二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2004 年 5 月 21 日正式生效。

（三）基金类型与运作方式

基金类型：指数股票型

运作方式：契约型开放式

（四）基金存续期限

不定期。

（五）销售对象

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

（六）基金存续期内的基金持有人数量和资金额

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

七、基金份额的申购与赎回

（一）基金投资者范围

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

（二）申购与赎回场所

1、本基金管理人直销网点及网站；

2、受本基金管理人委托、具有销售本基金资格的代销机构的营业网点；

3、有网上交易功能的代售机构的网站。

具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或者基金管理人网站披露并不时更新的销售机构名录中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构。

（三）申购和赎回办理的时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间。

本基金已于 2004 年 7 月 7 日开放申购业务，于 2004 年 7 月 27 日开放赎回业务。

开放日的具体业务办理时间即开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间，具体为上午 9：30-11：30 和下午 1：00-3：00。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日、开放时间及具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

（四）申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的该类基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、申购费用按单笔申购申请金额对应的费率计算；

4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间（现定为 15：00）以前撤销；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前 3 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登公告。

（五）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的手续，向基金销售机构提出申购或赎回的申请。投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以收到申购或赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），并在收到申请后的 1 个工作日内（T+1 日）对该交易的有效性进行确认。投资者可在 2 个工作日之后（T+2 日，包括该日）向基金销售机构查询申购与赎回的成交情况。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。投资者赎回申请成功后，基金管理人应在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 5 个工作日(T+5)的时间内，支付赎回款项。

在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照本基金合同的有关条款处理。

（六）申购和赎回的数额限制

1、本基金管理人规定，本基金单笔最低申购金额为 1 元，投资人通过销售机构申购本基金时，当销售机构设定的最低申购金额高于该申购金额限制时，除需满足基金管理人规定的最低申购金额限制外，还应遵循销售机构的业务规定；

2、本基金每次赎回最低份额为 100 份基金份额，全额赎回时不受该限制；

3、基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须于调整前的 3 个工作日在中国证监会指定媒体上刊登公告；

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

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

6、申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；

7、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

8、申购份额、赎回金额的计算公式见本招募说明书第十三章基金的费用与税收。

9、基金份额净值计算公式

由于基金费用的不同，本基金A类和C类基金份额分别计算和公告基金份额净值，计算

公式为：

T 日各类基金份额净值＝T 日收市后的该类基金份额的基金资产净值／T 日该类基金份额的余额数量

本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（七）申购和赎回的注册登记

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

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

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

（八）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请(有效赎回申请总数扣除有效申购申请总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

（1）巨额赎回发生时，本公司可选择下面两种方式进行处理：

① 全额赎回：当本公司认为有能力兑付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

② 部分延期赎回：当本公司认为兑付投资者的赎回申请可能导致基金份额持有人的利益受损或无法实现时，本公司在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10％的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个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下一个开放日办理。转入第二个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的该类基金份额净值为依据计算赎回支付金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

③若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。具体见相关公告。

（2）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒体上刊登公告。

（3）本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在中国证监会指定媒体公告。

（九）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

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

（2）基金管理人、基金托管人、基金销售机构或基金注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；

（3）由于不可抗力而导致基金无法正常运作；

（4）证券交易所交易时间非正常停市；

（5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的其他申购；

（6）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时，基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请；

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

（8）法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资者的赎回申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市；

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

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

（5）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可兑付部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未兑付部分由基金管

理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的各类基金份额净值为依据计算赎回支付金额。同时在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

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

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在中国证监会指定媒体公告。

（十）重新开放申购或赎回的公告

暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应予公告。如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个开放日的各类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日在中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的各类基金份额净值。

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

投资者可通过本管理人网站(www.ccfund.com.cn)、中国证券报、上海证券报以及证券时报了解相关公告。

（十一）基金的转换

基金转换是指基金份额持有人可按规定申请将所持有的本基金份额转换为本基金管理人管理并在同一注册登记人登记的其它开放式基金份额。

（十二）基金的非交易过户与转托管

1、非交易过户

基金注册登记人受理继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。其中继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理，并按基金注册登记人规定的标准收取过户费用。

2、转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，转入到直销机构需符合有关最低金额的规定。投资者在进行转托管时，可以将一个销售机构的基金份额全部或部分转出。办理转托管业务的基金份额持有人需在原销售机构办理转托管转出手续，然后在拟转托管转入的销售机构办理转托管转入手续，基金份额将在注册登记确认后自动转入持有人指定的销售机构。转托管业务收取一定的固定手续费。

八、基金的投资管理

（一）投资目标

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

（二）目标指数

本基金为增强型指数基金，自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日以中信标普 300 指数为跟踪标的指数，自 2011 年 4 月 1 日起，本基金所跟踪的标的指数变更为沪深 300 指数。

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

（三）投资对象

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

本基金债券投资部分主要投资于国债、政策性金融债。

（四）投资理念

以指数化投资为主，辅以适度的积极管理，分享中国经济增长的长期收益。

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

（五）投资策略

1、资产配置策略

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

在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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

后及时对相关成份股进行调整。

2、股票（含存托凭证）投资策略

（1）指数化投资

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

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

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

（2）增强性投资

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

① 流动性优化

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

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

② 基本面优化

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

A. 上市公司基本面较好，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力；

B. 中长期估值水平明显高于目前股价水平，在同行业中，股票相对价格偏低；

C. 预期将纳入指数的个股；

D. 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成份股。

本基金将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重（极端情况下可降低至零）：

A. 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑；

B. 中长期估值水平明显低于目前股价水平；在同行业中，股票相对价格偏高；

C. 短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调；

D. 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

3、债券投资策略

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

（六）投资范围

在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90～95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

（七）业绩比较基准

1、95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日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，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。

2、标的指数编制方法

（1）指数样本空间

指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：

科创板证券：上市时间超过一年。

创业板证券：上市时间超过三年。

其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。

（2）指数选样方法

沪深 300 指数样本是按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、证券价格无明显异常波动或市场操纵的公司：

对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 50%的证券；

对样本空间内剩余证券，按照过去一年的日均总市值由高到低排名，选取前 300 名的证券作为指数样本。

3、标的指数查询途径

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

（八）投资管理基本程序

1、投资决策程序

（1）投资决策委员会定期召开会议，评价基金净值与比较基准的跟踪误差，并对基金管理小组关于控制跟踪误差的提案做出决议；

（2）基金管理部基金管理小组利用数量模型，对总体累积偏差和行业偏差进行测算；研究部各行业研究员从基本面对行业、个股和市场走势提出研究报告；运行保障部提供基金申购、赎回的动态情况，供基金管理小组参考；

（3）基金管理小组根据信息汇总情况对组合进行适度调整，对于需调整的个股，基金经理必须提供充分的理由；

（4）研究部金融工程小组对基金投资组合跟踪误差进行评估，并作出跟踪误差的归因分析报告，在投资组合的年化总体累积偏差超过 2%时提出预警；

（5）监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

2、投资操作程序

（1）基金管理小组根据沪深 300 指数的行业构成比例，在设定的偏差范围内定出组合中个股的比例关系，输入交易系统；

（2）买入股票时，交易员启动组合交易系统，系统按事先设定的个股权重统一下单买入；卖出股票时，系统按事先设定的个股权重统一下单卖出；

（3）对于需个别调整或组合交易出现困难的个股，基金经理可独立发出指令，交易员可在交易时间内人工操作；

（4）基金管理小组每日对投资组合的总体累积偏差进行跟踪。若总体累积偏差超过允许范围，通过纠正行业偏差、证券选择偏差，以减少跟踪误差；

（5）本基金在沪深 300 指数成份股调整信息公告后，研究部金融工程小组将对调整后的沪深 300 指数的行业配置比例进行评估，如行业配置比例调整幅度超出允许的范围，本基金将在信息公布后一个月内，对投资组合进行调整；

（6）当发生新股申购和组合品种的增发时，研究部提供拟发行新股企业和增发企业的调研报告；基金管理小组根据调研报告进行新股和增发申购。

（九）投资组合

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

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

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

4、本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放

基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

6、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

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

8、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

（十）投资限制

1、本基金不得投资于其他基金；

2、本基金不得将基金资产用于抵押、担保；

3、本基金不得从事证券信用交易；

4、本基金不得进行房地产投资；

5、本基金不得从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

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

7、本基金不得从事法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

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

（十一）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对所投资企业的控股或者进行直接管理；

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

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，切实保护基金份额持有人的利益。

（十二）投资组合报告

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

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月15日复核了本投资组合报告内容，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截至2022年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,101,565,423.85	94.52
	其中：股票	1,101,565,423.85	94.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,575,358.02	2.11
	其中：债券	24,575,358.02	2.11
	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	38,732,029.12	3.32
8	其他资产	587,147.44	0.05
9	合计	1,165,459,958.43	100.00

2、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

2.1报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,020,882.54	0.26
B	采矿业	24,346,092.26	2.09
C	制造业	577,618,408.59	49.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,331.14	0.00
E	建筑业	8,910,222.48	0.77

F	批发和零售业	21,652,300.80	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	37,398,224.93	3.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,875,010.17	3.26
J	金融业	211,853,290.35	18.22
K	房地产业	2,733,846.21	0.24
L	租赁和商务服务业	23,088.36	0.00
M	科学研究和技术服务业	32,126.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,245.55	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,101.40	0.00
S	综合	-	-
	合计	925,502,171.18	79.58

2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,462,976.98	1.33
C	制造业	95,453,922.21	8.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,186,924.80	1.39
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,274,168.84	2.52
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,933,385.49	1.37
J	金融业	246.60	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,676,095.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	12,833.40	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	62,699.35	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	176,063,252.67	15.14

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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

3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	50,322	86,906,094.00	7.47
2	300750	宁德时代	133,200	52,403,544.00	4.51
3	002594	比亚迪	123,700	31,787,189.00	2.73
4	300760	迈瑞医疗	87,868	27,763,651.96	2.39
5	601628	中国人寿	743,814	27,610,375.68	2.37
6	601319	中国人保	5,169,083	26,982,613.26	2.32
7	601318	中国平安	512,893	24,105,971.00	2.07
8	600438	通威股份	587,100	22,650,318.00	1.95
9	600919	江苏银行	3,085,261	22,491,552.69	1.93
10	601601	中国太保	908,434	22,274,801.68	1.92

3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603605	珀莱雅	105,660	17,695,936.80	1.52
2	688122	西部超导	183,411	17,367,187.59	1.49
3	600160	巨化股份	1,081,900	16,780,269.00	1.44
4	600236	桂冠电力	2,810,230	16,186,924.80	1.39
5	600153	建发股份	1,184,100	16,162,965.00	1.39

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	24,575,358.02	2.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,575,358.02	2.11

5、 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	019674	22 国债 09	162,000	16,412,881.31	1.41
2	019666	22 国债 01	80,000	8,162,476.71	0.70

6、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资产支持证券投资明细

注：无。

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：无。

8、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权证投资明细

注：无。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

11、投资组合报告附注

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

本报告期本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	263,283.69
2	应收证券清算款	124,371.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	199,492.34
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	587,147.44

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无 。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

11.6 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。

九、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

（截止 2022 年 12 月 31 日）

长城久泰沪深 300A

时间段	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
基金合同生效日至 2004 年 12 月 31 日	-9.20%	0.95%	-11.29%	1.00%	2.09%	-0.05%
2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日	-3.61%	1.23%	-8.25%	1.26%	4.64%	-0.03%
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日	135.48%	1.30%	114.36%	1.33%	21.12%	-0.03%
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	145.02%	2.15%	150.06%	2.17%	-5.04%	-0.02%
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	-63.44%	2.88%	-62.58%	2.85%	-0.86%	0.03%
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	92.40%	1.94%	89.12%	1.94%	3.28%	0.00%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	-11.05%	1.50%	-10.40%	1.49%	-0.65%	0.01%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	-24.12%	1.23%	-24.37%	1.23%	0.25%	0.00%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	7.92%	1.20%	7.30%	1.22%	0.62%	-0.02%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	-6.18%	1.33%	-7.14%	1.32%	0.96%	0.01%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	49.12%	1.15%	48.72%	1.15%	0.40%	0.00%
2015 年 1 月 1	5.83%	2.40%	5.72%	2.36%	0.11%	0.04%

日至 2015 年 12 月 31 日						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-7.07%	1.36%	-10.61%	1.33%	3.54%	0.03%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	24.58%	0.61%	20.66%	0.60%	3.92%	0.01%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-20.71%	1.25%	-24.10%	1.27%	3.39%	-0.02%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	38.22%	1.16%	34.16%	1.18%	4.06%	-0.02%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	33.25%	1.33%	25.88%	1.36%	7.37%	-0.03%
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	-1.62%	1.17%	-4.85%	1.11%	3.23%	0.06%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	-21.60%	1.20%	-20.58%	1.22%	-1.02%	-0.02%
基金合同生效日至 2022 年 12 月 31 日	399.58%	1.55%	242.36%	1.55%	157.22%	0.00%

长城久泰沪深 300C

时间段	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
基金合同生效日至 2019 年 12 月 31 日	32.79%	1.17%	30.02%	1.19%	2.77%	-0.02%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	32.85%	1.33%	25.88%	1.36%	6.97%	-0.03%
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	-2.05%	1.17%	-4.85%	1.11%	2.80%	0.06%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	-21.93%	1.20%	-20.58%	1.22%	-1.35%	-0.02%

基金合同生效日至 2022 年 12 月 31 日	34.91%	1.22%	23.68%	1.23%	11.23%	-0.01%

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

十、基金的财产

（一）基金财产的构成

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

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（二）基金财产的账户

本基金以托管人和基金联名的方式开设证券账户、以基金名义开设的银行账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记人自有的资产账户以及其它基金资产账户相独立。

（三）基金财产的保管及处分

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

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

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

4、非因本基金财产本身承担的债务，不得对本基金财产强制执行。

十一、基金资产估值

（一）估值目的

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

（二）估值日

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

（三）估值对象

基金依法拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（四）估值方法

1、股票估值方法：

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

(2)未上市股票的估值：

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

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

3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

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

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

(4)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法：

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交

易市价，确定公允价格；

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

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

(6)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

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

(8)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值方法：

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

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

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

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

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

（五）估值程序

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

月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；

4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；

6、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）基金份额净值估值错误的确认及处理方式

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金单位资产估值的准确性和及时性。各类基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。当基金资产的估值导致某一类基金份额净值小数点后四位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由

于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

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

2、差错处理原则

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

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

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

(4)差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

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

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1)某一类基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

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

(4)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（八）特殊情形的处理

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

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

十二、基金的收益分配

（一）基金收益的构成

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

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

2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

3、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；

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

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

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

8、法律法规以及中国证监会的其他规定。

（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，经基金托管人核实后确定，在 2 日内在指定媒体公告。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）C 类基金份额的销售服务费；

（4）证券交易费用；

（5）基金法定信息披露费用；

（6）基金持有人大会费用；

（7）与基金相关的会计师费和律师费；

（8）按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.98%年费率计算。计算方法如下：

H=E×0.98%÷当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

（2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 2‰的年费率计提。计算方法如下：

H=E×2‰÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

（3）C 类基金份额的销售服务费

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

H=E×0.3%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

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

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

3、不列入基金费用的项目

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

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

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

申购费用由基金申购人承担，不列入基金资产，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，A 类基金份额申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 C 类基金份额不收取申购费用。

本基金自 2015 年 3 月 13 日起对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率（仅限前端收费模式）。本基金 A 类基金份额申购费率如下表所示：

（1）A 类基金份额前端申购费

申购金额（元）	申购费率
1000 元≤M＜100 万元	1.5%
100 万元≤M＜500 万元	1.2%
500 万元≤M＜1000 万元	0.6%
1000 万元≤M	每笔收取固定费用 1000 元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

（2）A 类基金份额特定申购费

申购金额（元）	申购费率
1000 元≤M＜100 万元	0.3%
100 万元≤M＜500 万元	0.24%
500 万元≤M＜1000 万元	0.12%
1000 万元≤M	每笔收取固定费用 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老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。

申购份额的计算方式：

本基金C类基金份额不收取申购费。本基金A类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率），对于 1000 万元（含）以上的申购，净申购金额＝申购金额－固定申购费金额

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额/T 日 A 类基金份额基金份额净值

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

例：某投资者投资 5,000 元申购本基金 A 类基金份额，对应费率为 1.5%，假设申购当日本基金 A 类基金份额净值为 1.0660 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额＝5,000/（1＋1.5%）＝4,926.11 元

申购费用＝5,000－4,926.11＝73.89 元

申购份额＝4,926.11/1.0660＝4,621.12 份

即：投资者投资 5,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日本基金 A 类基金份额净值为 1.0660 元，则可得到 4,621.12 份基金单位。

例：某投资者投资 100 万元申购本基金 A 类基金份额，若对应费率为 1.2%，假设申购当日本基金 A 类基金份额净值仍为 1.0660 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额＝1,000,000/（1＋1.2%）＝988,142.29 元

申购费用＝1,000,000－988,142.29＝11,857.71 元

申购份额＝988,142.29/1.0660＝926,962.75 份

即：投资者投资 100 万元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日本基金 A 类基金份额净值也是 1.0660 元，则可得到 926,962.75 份基金单位。

（3）A 类基金份额后端申购费

持有基金时间	后端申购费率
1 年以内	1.6%
满 1 年不满 2 年	1.3%
满 2 年不满 3 年	1.0%
满 3 年不满 4 年	0.7%
满 4 年不满 5 年	0.4%
满 5 年后	0

注： 以上的持有基金的起始时间为投资者申购确认之日。

后端申购费的计算基数为本次要赎回的基金份额在当初购买时所需的申购金额，计算方法为：当初购买本次赎回份额的申购资金总额－申购资金总额/（1＋后端申购费率）。

2、赎回费

本基金的赎回费率按持有时间的增加而递减，本基金对A类基金份额和C类基金份额分别采用不同的赎回费率结构，费率如下：

（1）A类基金份额赎回费率：

持续持有期	赎回费率
1－6天	1.5%
7天及以上	0.5%

（2）C类基金份额赎回费率：

持续持有期（T）	赎回费率
T＜7天	1.5%
T≥7天	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。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；对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金赎回支付金额的计算方式：

本基金的赎回支付金额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回金额 = 赎回当日该类基金份额净值×赎回份额

赎回费用 = 赎回当日该类基金份额净值×赎回份额×赎回费率

赎回支付金额 = 赎回金额－赎回费

例：某投资者赎回本基金A类基金份额1万份，持续持有期30天，赎回费率为0.5%，假设赎回当日本基金A类基金份额净值是1.0660元，则可得到的赎回支付金额为：

赎回金额 = 1.0660×10,000 = 10,660

赎回费用 = 1.0660×10,000×0.5% = 53.30元

赎回支付金额 = 10660－53.30= 10,606.70元

即：投资者赎回本基金A类基金份额1万份，假设赎回当日本基金A类基金份额净值是1.0660元，则其可得到的赎回支付金额为10,606.70元。

3、转换费

(1)基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财

产所有。

①如转入基金的申购费率>转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额＝转出金额－转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率＝转入基金适用申购费率－转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差＝转入总金额－转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额＝转入总金额－转入基金申购费补差

转入份额＝转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费＝转出基金赎回费＋转入基金申购费补差

例：某投资者持有长城稳健增利债券型证券投资基金 10 万份基金份额，持有期为 100 天，决定转换为本基金 A 类基金份额，假设转换当日转出基金（长城稳健增利债券型证券投资基金）份额净值是 1.2000 元，转入基金（本基金 A 类基金份额）份额净值是 1.5800 元，转出基金对应赎回费率为 0.1%，申购补差费率为 0.7%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额＝100,000×1.2000＝120,000 元

转出基金赎回费＝120,000×0.1%＝120 元

转入总金额＝120,000－120＝119,880 元

转入基金申购费补差费率＝1.5%－0.8%＝0.7%

转入基金申购费补差＝119,880－119,880/(1+0.7%)＝833.33 元

转入净金额＝119,880－833.33＝119,046.67 元

转入份额＝119,046.67/1.5800＝75,345.99 份

基金转换费＝120＋833.33＝953.33 元

②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

基金转换费用＝转出金额×转出基金赎回费率

例：某投资者持有本基金 A 类基金份额 10 万份，持有期为 100 天，决定转换为长城稳健增利债券型证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金 A 类基金份额）份额净值是 1.5800 元，转入基金（长城稳健增利债券型证券投资基金）份额净值是 1.2000 元，转出基金对应赎回费率为 0.5%，申购补差费率为 0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额＝100,000×1.5800＝158,000 元

转出基金赎回费＝158,000×0.5%＝790 元

转入总金额＝158,000－790＝157,210 元

转入基金申购费补差＝0

转入净金额＝157,210－0＝157,210 元

转入份额＝157,210/1.2000＝131,008.33 份

基金转换费＝790＋0＝790 元

(2)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金)，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为 0。

(3)转出基金赎回费计入转出基金基金资产的标准参见各基金招募说明书的约定。

(4)计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下,调整上述收费方式和费率水平,但最迟应于新收费办法开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（三）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的会计责任人；

2、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金成立少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关的会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、本基金管理人和基金托管人各自保留完整的基金会计账目、凭证（原始凭证由基金托管人保管）并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

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

（二）基金审计

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

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

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

十五、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

（二）信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

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

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人

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

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

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

2、发行公告

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

3、基金净值信息

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

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

4、基金份额申购、赎回价格

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

5、基金定期报告，包括基金年度报告、中期报告和基金季度报告

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

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

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

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障

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

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

6、临时报告

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

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

（1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2）《基金合同》终止、基金清算；

（3）转换基金运作方式、基金合并；

（4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

（5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（8）基金募集期延长或提前结束募集；

（9）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

（10）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

（11）涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

（12)基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

（13)基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

（14）基金收益分配事项；

（15）管理费、托管费、销售服务费、 申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（16）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

（17）本基金开始办理申购、赎回；

（18）本基金发生巨额赎回并延期办理；

（19）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

（20）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（21）发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

（22）基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

（23)基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和基金合同约定的其他事项。

7、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

8、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

9、中国证监会规定的其他信息。

（六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

（七）信息披露文件的存放与查阅

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

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

十六、风险揭示

（一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、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。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。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、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

（二）管理风险

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

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购和赎回。由于开放式基金在国内刚刚试点，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

（四）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产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

（五）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金管理人、基金销售机构等机构无法正常工作，

从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

（六）科创板投资风险

本基金资产有可能投资于科创板股票。科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块存在差异，基金投资科创板股票的风险包括但不限于：

1、 科创板企业退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快，退市情形更多，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节。一旦所投资的科创板股票进入退市流程，将面临退出难度较大、成本较高的风险。

2、市场风险

科创板企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域，大多数企业为初创型公司，上市门槛略低于 A 股其他板块，企业未来盈利、现金流、估值等均存在不确定性，个股投资风险加大。此外，科创板企业普遍具有前景不确定、业绩波动大、风险高的特征，市场可比公司较少，估值与发行定价难度较大。

同时，科创板竞价交易较主板设置了更宽的涨跌幅限制(上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%）、科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

3、流动性风险

科创板投资门槛较高，由此可能导致整体流动性相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

4、集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

5、监管规则变化的风险

科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，导致基金投资运作产生相应调整变化。

（七）存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因

多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（八）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，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日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，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

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并实施前，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，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（九）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

1、基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

2、在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股，根据基金合同约定基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险或者无法及时获得赎回款项的风险。

（十）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金以增强指数化投资方法跟踪目标指数，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差扩大，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

十七、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、存续期内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元，基金管理人将宣布本基金终止；

2、基金经持有人大会表决终止的；

3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；

5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的托管机构承受其原有权利及义务；

6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

7、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

8、中国证监会允许的其他情况。

（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，清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算；

（2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘请必要的工作人员；

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

2、基金清算程序

（1）基金终止后，发布基金清算公告；

（2）由基金清算小组统一接管基金资产；（3）对基金资产和负债进行清理和确认；（4）对基金资产进行估值和变现；（5）将基金清算结果报告中国证监会；

（6）公布基金清算结果公告；

（7）进行基金剩余资产的分配。

3、清算费用

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

4、基金资产按下列顺序清偿

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿基金债务；

（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金清算的公告

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

6、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。

十八、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》

（一）基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

（1）自本基金成立之日起，依据本基金合同及有关法律规定运用本基金资产；

（2）依照《基金法》、《试点办法》、《运作管理办法》及其它有关规定，代表基金对被投资的上市公司行使股东权利；

（3）依据本基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定对基金资产或基金持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，必要时应采取措施保护基金投资者的利益；

（4）选择、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；

（5）提议召开基金持有人大会；

（6）担任注册登记人或委托其他机构担任注册登记人或更换注册登记人；

（7）直接销售基金单位，获取认购（申购）费用；

（8）依据基金合同的规定获得基金管理费收入及其他法定或约定的收入；

（9）依据本基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（10)在法律法规规定和基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理基金单位的申购和赎回；

（11)基金终止时，组建或参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

（12）法律法规及基金合同规定的其它权利。

2、基金管理人的义务

（1）自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

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

（3）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购、赎回和其他业务或委托其它机构代理这些业务；

（4）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与登记过户工作或委托其他机构代理该项业务；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和管理人的自有资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

（6）除依据《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他法律法规的规定外，不为自

己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）负责基金注册与登记过户。基金管理人应严格按照《基金法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定，为基金投资者办理基金注册与登记过户，并接受基金托管人的监督；

（9）按规定计算并公告基金净值信息；

（10）编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

（11）严格按照《基金法》、《试点办法》和本基金合同及其它有关规定履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《试点办法》和本基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（13）按规定向基金持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回、分红款项；

（15）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（16）依据《基金法》、《试点办法》和本基金合同及其它有关规定召集基金持有人大会；

（17）保存基金的会计帐册、报表、记录15年以上；

（18)确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出；并且保证投资者能够按照招募说明书公告的时间和方式查阅与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

（19）参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

（21)因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，采取适当、合理的方式向基金投资者进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

（22)监督基金托管人按基金合同规定履行自己的义务，基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿；

（23）不从事任何有损基金及其它基金当事人利益的活动；

（24）遵守基金合同

（25）法律法规及基金合同规定的其它义务。

（二）基金托管人的权利和义务

1、基金托管人的权利

（1）依法持有并保管基金资产；

（2）依据本基金合同约定获得基金托管费；

（3）监督本基金的投资运作，发现基金管理人的指令违法、违规的，有权不予执行，并向中国证监会报告；

（4）监督基金管理人的注册与登记过户服务；

（5）法律法规及基金合同规定的其它权利。

2、基金托管人的义务

（1）遵守基金合同；

（2）依据本基金合同以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产；

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

（4）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的本基金资产与基金托管人自有资产以及其它基金的资产相互独立；对不同的基金分别设置帐户，独立核算，分帐管理，保证不同基金之间在名册登记保管、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立；

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

（6）保管基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同和有关凭证、资料；

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

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

（9）复核基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值；

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

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

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

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

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

（15）负责建立并保存基金持有人名册；

（16）按有关规定，保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上；

（17）按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；

（18）依据基金管理人的指令或有关规定向基金持有人支付基金收益和赎回款项；

（19）参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20)面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

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

（22）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（23）基金管理人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（24）法律法规及基金合同规定的其它义务。

（三）基金持有人的权利和义务

1、同一类别每份基金单位代表同等的权利和义务。

2、基金持有人的权利

（1）出席或者委派代表出席基金持有人大会，并对审议事项行使表决权；

（2）分享基金收益；

（3）按基金合同的规定查询或者获取公开的基金业务和基金财务状况资料；

（4)申购、赎回及其它对基金单位处分的权利， 并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金单位；

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

（6）获取基金清算后的剩余资产；

（7）法律法规及基金合同规定的其它权利。

3、基金持有人的义务

（1）遵守基金合同；

（2）缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；

（3）在所持有的基金单位范围内承担基金亏损或者终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动；

（5）法律法规及基金合同规定的其它义务。

（四）基金份额持有人大会

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

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

2、基金份额持有人大会召开事由

有以下情形之一的,应召开基金份额持有人大会：

(1)变更基金合同(因相应的法律、法规发生变动导致必须对基金合同进行修改的情况除外)；

(2)决定终止基金合同；

(3)更换基金管理人；

(4)更换基金托管人；

(5)变更基金类型或转换基金运作方式；

(6)与其他基金合并；

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(8)基金管理人和基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(9)代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会；

(10)中国证监会规定的其它情形以及法律法规及基金合同规定的其它事项。

3、基金份额持有人大会召集方式

(1)在正常情况下,基金份额持有人大会由基金管理人召集；

(2)基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

(3)基金托管人发起召集基金份额持有人大会的，按照《证券投资基金运作管理办法》第三十八条执行；

(4)代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集或在规定时间内未能做出书面答复,代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；

基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起六十日内召开。如果基金托管人也决定不召集或在规定时间内未能做出书面答复,代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集,并应当至少提前三十日向中国证监会备案。基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。

基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

4、基金份额持有人大会的通知

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

(1) 会议召开的时间、地点和方式；

(2) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

(3) 代理投票授权委托书(内容要求包括但不限于委托人身份、代理人身份、代理权限、代理有效期限等)送达时间和地点；

(4) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(5) 会议拟审议的主要事项和议事日程；

(6) 会议的议事程序和表决方式；

(7) 会务常设联系人姓名、电话；

(8) 召集人需要通知的其他事项。

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

5、基金份额持有人大会的召开方式

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开,也可以采取通讯等方式召开。

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

基金份额持有人大会应当有代表百分之五十以上基金份额的持有人参加,方可召开。

(1)现场方式召开

由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席并行使表决权。现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。

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

如果出席会议的持有人代表的基金份额未达到百分之五十以上,或有其他情况未达到现场开会的条件,则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为15天,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。再次开会仍然必须达到上述所有相关条件,才能视为有效。

(2)通讯方式召开

通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效：

A.召集人按本基金合同的规定公告会议通知后,在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

B.召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

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

D.会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

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

6、基金份额持有人大会的议事内容与程序

(1)议事内容

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额百分之十以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日前 15 天提交召集人。召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案应当在大会召开日前 10 天公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日前 10 天公告,否则会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

召集人应按照以下原则对提案进行审核：

A、关联性：召集人负责对提案进行审议,如果提案所涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律、法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,则可以提交大会审议；对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

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

行审议。

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

(2)议事程序

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(8)款规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人未能主持大会的情况下,由基金托管人授权出席会议的代表主持;如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额百分之五十以上多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

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

7、基金份额持有人大会的表决

(1)基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权;

(2)基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

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

(3)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4)采取通讯方式进行表决时,符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

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

未经公告的事项不得表决。

8、计票

(1)现场开会

A.如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

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

D.记票过程应当由公证机关予以公证。

(2)通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

9、生效与公告

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

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人均具有法律约束力。

基金份额持有人大会决议应在生效之日起2日内在中国证监会指定媒体公告。

（五）争议的处理和适用法律

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商或调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

本基金合同受中国法律管辖。

（六）基金合同的效力

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

2、本基金合同自生效之日起对本基金合同的各方当事人具有同等的法律约束力。

3、本基金合同正本一式十份，除上报中国证监会和中国银监会各二份外，基金发起人、

基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律约束力。

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

（七）基金合同的修改和终止

1、基金合同的修改

（1）本基金合同的修改应经基金发起人、基金管理人和基金托管人同意；

（2）修改本基金合同应召开基金持有人大会，基金合同修改的内容应经基金持有人大会决议通过；

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

1）因相应的法律、法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形；

2）基金合同的修改并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；

3）因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

2、基金合同的终止

（1）出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

1）存续期间内，基金持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，基金管理人将依照法律法规规定的程序宣布本基金终止；

2）基金持有人大会表决终止的；

3）因重大违法行为，基金被中国证监会责令终止的；

4）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其它适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；

5）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它适当的托管机构承受其原有权利及义务；

6）由于投资方向变更引起的基金合并、撤消；

7）出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

8）中国证监会允许的其它情形。

（2）基金合同的终止

本基金终止后，应当依照有关法律法规和本基金合同的规定对基金进行清算。本基金

合同于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

十九、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《长城久泰沪深300指数证券投资基金托管协议》

（一）托管协议当事人

1、基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

邮政编码：518026

法定代表人：王军

成立日期：2001年12月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

行长：王良

成立日期：1987年4月8日

批准设立文号：人总行银复（1986）175号

资产托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83号

组织形式：股份有限公司

注册资本：252.20亿元

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；

基金托管业务。代办开放式基金的认购、申购、赎回业务；受托投资管理托管业务及经中国银监会和中国人民银行批准的其他业务。

（二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（1）基金托管人根据《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，对本基金的投资范围、基金资产的投资组合、所托管的基金管理人的所有基金的投资比例、基金资产净值的计算、基金管理费和基金托管费的计提和支付、基金收益分配等事项进行监督和核查。其中对基金的投资比例监督和核查自本基金成立之日起6个月后开始。

（2）基金托管人发现上述事项中基金管理人的行为违反《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

（3）基金托管人发现基金管理人上述事项有重大违规行为，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。

2、基金管理人对基金托管人的业务监督、核查

（1）根据《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算帐户、对基金资产实行分帐管理、擅自动用基金资产等行为进行监督和核查。

（2）基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

（3）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，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。

3、基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

（三）基金资产保管

1、基金资产保管的原则

（1）基金托管人应安全、完整地保管基金的全部资产。

（2）基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的资产。基金托管人为基金设立独立

的帐户，本基金资产与基金托管人的其他资产或其他业务以及其他基金的资产实行严格的分帐管理。保证不同基金之间在名册登记、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立。

（3）基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（4）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到帐日期并通知托管人，到帐日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

（5）基金托管人应当设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

（6）除依据《中华人民共和国信托法》、《基金法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

2、基金设立募集期间及募集资金的验资

（1）基金设立募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管行的营业机构开立的“基金募集专户”。该帐户由基金管理人开立并管理。

（2）基金设立募集期满，由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，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

（3）基金管理人应将属于基金资产的全部资金划入基金托管人以基金名义开立的基金银行帐户中。验资报告出具后，基金成立。

（4）若基金因未达到规定的募集额度或其他原因不能成立，按规定办理退款事宜。

3、基金银行帐户的开立和管理

（1）基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行帐户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

（2）基金银行帐户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行帐户；亦不得使用基金的任何帐户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金银行帐户的开立和管理应符合《银行帐户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《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他规定。

4、基金证券帐户的开立和管理

（1）基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立托管人与基金联名的证券帐户，用于本基金证券投资的清算和存管。并对证券帐户业务发生情况进行如实记录。

（2）基金证券帐户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券帐户，亦不得使用基金的任何帐户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金证券帐户的开立和证券帐户卡的保管由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

5、债券托管专户的开设和管理

（1）基金成立后，由基金管理人负责代理基金向中国证监会和中国银行业监督管理委员会（以下简称中国银监会）申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。

（2）基金托管人以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算帐户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

（3）基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，正本由托管人保管，管理人保存副本。

6、其他帐户的开立和管理

（1）因业务发展而需要开立的其他帐户，可以根据基金合同或有关法律法规的规定，由基金托管人负责开立。新帐户按有关规则使用并管理。

（2）法律、法规等有关规定对相关帐户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

7、清算备付金帐户开立和管理

基金托管人应当按规定以其自身的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立清算备付金账户，并通过该账户完成本基金的证券资金清算。

8、证券帐户卡保管

证券帐户卡由基金托管人保管原件。

9、基金资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托管银行的保管库；也可以存入中国证券登记结算有限责任公司及其他有权保管机构的代保管库中。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。

10、与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。

（四）基金资产估值、基金资产净值计算与复核

1、基金资产估值

（1）估值对象

基金依法拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（2）估值方法

1）股票估值方法：

1.1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

1.2）未上市股票的估值：

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

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

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

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

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

1.4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2）债券估值方法：

①证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

②证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

③交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

④发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

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

⑥同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

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

⑧国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3）权证估值方法：

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

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

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

③国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4)本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

7)根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。

本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

（3）估值程序

基金的日常估值由基金管理人进行，基金托管人复核。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务章后以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照本基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

（4）特殊情形的处理

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

2、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数计算得到的每基金份额资产的价值。

每工作日计算基金资产净值及份额资产净值，并按规定公告。

（2）复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将资产净值结果发送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的方法、时间、程序进行复核；经基金托管人复核无误后，盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案。

（3）基金份额净值的确认及错误的处理方式

基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后 4 位。国家另有规定的，从其规定。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。

差错处理的原则和方法如下：

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

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

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

4）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

3、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

4、基金帐册的建立和基金帐册的定期核对

（1）基金帐册的建立

基金会计核算由基金管理人承担，基金托管人也应按国家有关规定，独立地设置、记录和保管本基金的全套帐册；双方管理或托管的不同基金的会计帐册，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托管人和基金管理人分别保管并据此建帐。

基金管理人按日编制基金估值表，与基金托管人核对，从而核对证券交易帐目。

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帐，每月附指令回执和单据复印件交基金管理人核实。

基金管理人与基金托管人对基金帐册每月核对一次。经对帐发现双方的帐目存在不符的，基金管理人和基金托管人应及时查明原因并纠正，保持双方的帐册记录完全相符。

5、基金财务报表与报告的编制和复核

（1）财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人和基金托管人按规定分别独立编制。

（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，应及时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公章，各留存一份。

（3）报表的编制与复核时间安排

《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。月度报表的编制，应于每月结束后 5 个工作日内完成；基金季度报告在季度结束之日起15个工作日内公告；中期报告在基金会计年度前六个月结束后两个月内公告；年度报告在基金会计年度结束后三个月内公告。

基金管理人应在报告内容截止日后的 3 个工作日内完成月度报表编制，加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人应在 2 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在中期报告内容截至日的30日内完成报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后20日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人应在年度报告内容截止日的50日内完成报告的编制，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后30日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金

管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，双方各留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

（五）基金持有人名册的登记与保管

注册登记人负责编制和保管基金份额持有人名册。基金成立日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日的持有人名册，由注册登记机构负责编制，并交由托管人保存。

基金托管人不得将所保存的基金持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

基金托管人和基金管理人对基金持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

（六）争议处理

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金持有人的合法权益。

（七）托管协议的修改与终止

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会备案后生效，须经证监会批准的，经其批准后生效。

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）基金或本基金基金合同终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生《基金法》、《试点办法》、基金合同或其他法律法规规定的终止事项。

二十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）账单服务

1、基金份额持有人可登录本基金管理人网站账户查询系统查阅对账单。

2、基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人定制对账单。基金管理人根据基金份额持有人的对账单定制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司旗下基金份额的持有人定期或不定期发送对账单，但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息（包括姓名、手机号码、电子邮箱、邮寄地址、邮政编码等）导致基金管理人无法送出的除外。

（二）红利再投资服务

若基金份额持有人选择本基金收益以基金份额形式进行分配（即红利再投资方式），则该基金份额持有人分配所得的红利将按照基金分红除息日的基金份额净值为基准计算自动转为基金份额。

（三）定期定额投资服务

“定期定额投资”是指投资者可通过本基金的销售机构提交申请，约定每月扣款时间、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

本基金管理人已通过本招募说明书“五、相关服务机构”中的“（一）销售机构”中列明的销售机构为投资者提供本基金的定期定额投资服务，具体业务开通情况及办理程序请查阅相关公告并遵循各销售机构的规定。

（四）客户服务中心（Call Center）电话服务

1、24 小时自动语音应答服务，为投资者提供基金净值查询、基金账户查询、基金信息查询等服务。

2、工作时间由专门客服人员为投资者提供全面业务咨询（包括公司信息、基金信息、基金投资指南等）及投诉受理等服务。

公司网站：www.ccfund.com.cn

客服邮箱：support@ccfund.com.cn

客服电话：400-8868-666

二十一、其他应披露的事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于上海分公司变更负责人的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-20
2	长城基金管理有限公司深圳分公司关于营业场所变更的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-21
3	长城基金管理有限公司关于营业场所变更的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-21
4	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定投业务的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-22
5	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金收益分配公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-23
6	长城基金管理有限公司关于北京分公司变更负责人的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-23
7	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定投业务的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-25
8	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-04-27
9	长城基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-05-18
10	长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-05-30
11	长城基金管理有限公司关于提醒投资者及	在证监会规定报刊和网站披露	2022-07-01

	时提供或更新身份信息资料的公告		
12	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-07-08
13	长城基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-07-14
14	长城久泰沪深 300 指数证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	在证监会规定报刊和网站披露	2022-11-03
15	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-11-07
16	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金收益分配公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-11-15
17	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金收益分配公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-11-29
18	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金收益分配公告	在证监会规定报刊和网站披露	2022-12-20
19	长城久泰沪深 300 指数证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	在证监会规定报刊和网站披露	2022-12-21
20	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	在证监会规定报刊和网站披露	2023-01-19
21	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2023-02-06
22	在本报告期内刊登的其他公告		

二十二、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、基金销售机构和基金登记机构的办公场所以及相关网站，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，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。

二十三、备查文件

（一）中国证监会批准本基金成立的文件

（二）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》

（三）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金发起人营业执照

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照

（八）中国证监会规定的其他文件

长城基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日