

长信量化先锋混合型证券投资基金

更新的招募说明书

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇二三年八月

重要提示

长信量化先锋混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2010 年 7 月 14 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】962 号文核准募集。本基金基金合同于 2010 年 11 月 18 日正式生效。2017 年 1 月 9 日, 本基金在原基金份额基础之上对基金份额进行分类, 原有长信量化先锋混合型证券投资基金基金份额归为 A 类份额（以下简称“量化先锋 A 类”），并增设 C 类份额（以下简称“量化先锋 C 类”）。

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。

本基金投资于证券市场, 基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险, 投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书, 全面认识本基金产品的风险收益特征, 充分考虑投资者自身的风险承受能力, 并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险, 包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险, 个别证券特有的非系统性风险, 由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险, 基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险, 以及本基金投资策略所特有的风险等。

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。

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本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, 并不办理侧袋账户的申购赎回。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。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

2015年8月7日起本基金更名为长信量化先锋混合型证券投资基金，关于基金更名的事宜，我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

本更新的招募说明书仅降低管理费率、托管费率，其余所载的内容截止日为2023年3月31日（其中基金管理人章节的信息截止日为2023年8月25日）。有关财务数据和净值截止日为2022年12月31日（财务数据经审计）。本基金托管人交通银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

目 录

一、绪言	5
二、释义	6
三、基金管理人	10
四、基金托管人	23
五、相关服务机构	28
六、基金的募集	56
七、基金合同的生效	57
八、基金份额的申购、赎回与转换.....	58
九、基金的投资	75
十、基金投资组合报告.....	86
十一、基金的业绩	96
十二、基金的财产	98
十三、基金资产的估值.....	100
十四、基金收益与分配.....	106
十五、基金费用与税收.....	108
十六、基金的会计与审计.....	111
十七、基金的信息披露.....	112
十八、侧袋机制	119
十九、风险揭示	123
二十、基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	128
二十一、基金合同的内容摘要.....	120
二十二、基金托管协议的内容摘要.....	160
二十三、基金份额持有人服务.....	170
二十四、其他应披露事项.....	185
二十五、招募说明书存放及查阅方式.....	188
二十六、备查文件	189

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》”）、《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了长信量化先锋混合型证券投资基金的投资目标、投资理念、投资策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。本招募说明书由本基金管理人解释。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，或对本招募说明书做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、义务关系的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

释义	
基金或本基金	指长信量化先锋混合型证券投资基金
基金管理人	指长信基金管理有限责任公司
基金托管人	指交通银行股份有限公司
基金合同	指《长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长信量化先锋混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
招募说明书	指《长信量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
发售公告	指《长信量化先锋股票型证券投资基金基金份额发售公告》
法律法规	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对其做出的不时修改和补充
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其不时做出的修订
《销售办法》	指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布，同年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》
《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 日起实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
《运作办法》	指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订”
《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
中国	指中华人民共和国（仅为基金合同目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
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
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于开放式证券投资基金的自然人
机构投资者	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
合格境外机构投资者	指符合法律法规规定，经中国证监会批准可以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的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者
基金份额持有人	指依照法律法规、招募说明书和基金合同合法取得基金份额的投资者

基金销售业务	指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
销售机构	指基金管理人直销机构、本基金代销机构以及上海证券交易所的会员单位
会员单位	指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员单位
直销机构	指长信基金管理有限责任公司
代销机构	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构
基金销售网点	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算和交收、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构	指办理基金注册登记业务的机构，本基金各类基金份额的注册登记机构分别为长信基金管理有限责任公司和长信基金管理有限责任公司委托代为办理基金注册登记业务的机构
基金账户	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户
交易账户	指销售机构为基金投资者开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户
基金合同生效日	指基金募集达到法律法规规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日
基金合同终止日	指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
基金募集期	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指销售机构在规定时间内受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期
T+n 日	指 T 日起（不包括 T 日）的第 n 个工作日
开放日	指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期
交易时间	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
业务规则	指《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》
发售	指在基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为
认购	指在基金募集期内，投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为
申购	指在基金存续期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为
赎回	指基金存续期内，基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人将其持有的本基金基金份额兑换为现金的行为
场内	指通过上海证券交易所内的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所
场外	指通过基金管理人或本基金代销机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所
基金转换	指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效的业务规

转托管	则进行的本基金份额与基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金份额间的转换行为 指基金份额持有人将其基金账户内的同一基金的基金份额从一个销售机构转入另一销售机构的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
巨额赎回	指在本基金单个开放日内,基金净赎回申请份额(基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额)与净转出申请份额(基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额)之和超过上一开放日本基金总份额 10% 的情形
元	指人民币元
基金收益	指基金管理人运用基金资产投资所得股票红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息和其他合法收入以及因运用基金财产带来的成本或费用的节约
基金资产总值	基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值	指估值日基金资产净值除以估值日基金份额余额总数后得出的基金份额的资产净值
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
基金份额类别	指本基金根据注册登记机构、申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值
A 类基金份额、A 类份额	指收取申购费用而不计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,此类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
C 类基金份额、C 类份额	指在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,此类基金份额的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司
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
指定媒介	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
基金产品资料概要	指《长信量化先锋混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行
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
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
不可抗力	指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用和没收、法律法规变化、突发停电、恐怖袭击、传染病传播、证券交易所非正常暂停或停止交易以及其他突发事件

三、基金管理人

(一) 基金管理人基本情况

基金管理人概况			
名称	长信基金管理有限责任公司		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼		
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼		
邮政编码	200120		
批准设立机关	中国证券监督管理委员会		
批准设立文号	中国证监会证监基金字[2003]63 号		
注册资本	壹亿陆仟伍佰万元人民币		
成立日期	2003 年 5 月 9 日		
组织形式	有限责任公司		
法定代表人	刘元瑞		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	魏明东		
存续期间	持续经营		
经营范围	基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】		
股权结构	股东名称	出资额	出资比例
	长江证券股份有限公司	7350 万元	44.55%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5 万元	31.21%
	武汉钢铁有限公司	2500.5 万元	15.15%
	上海彤胜投资管理中心（有限合伙）	751 万元	4.55%
	上海彤骏投资管理中心（有限合伙）	749 万元	4.54%
	总计	16500 万元	100%

(二) 主要人员情况

1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历
刘元瑞	董事长	男	中共党员，硕士，现任长信基金管理有限责任公司董事长、长江证券股份有限公司党委副书记、总裁、董事。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管，长江证券承销保荐有限公司总裁助理，长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。
任晓威	非独立董事	男	中共党员，学士，现任上海海欣集团股份有限公司总裁兼董秘，上海金欣联合发展有限公司董事长，上海东华海欣纺织科技发展有限公司董事

			长，苏中药业集团股份有限公司董事，泰州苏中企业管理有限公司董事，长信基金管理有限责任公司董事。曾任国开曹妃甸投资有限公司助理总经理及营运总监、国开吉林投资有限公司副总经理兼财务总监，中国新城镇发展有限公司（HK1278）执行董事、副总裁兼上海公司（上海金罗店开发有限公司）董事长，上海海欣集团股份有限公司副总裁（代为履行总裁职责）等职。
李 钊	非独立董事	男	硕士，现任中国宝武钢铁集团有限公司产业金融运营管理总监，历任上海宝钢集团公司财务部协理及管理师、宝山钢铁股份有限公司财务部主任管理师、宝钢集团有限公司经营财务部经理及高级经理、宝钢集团有限公司首席会计师、中国宝武钢铁集团有限公司首席会计师。兼任华宝证券股份有限公司监事、华宝资本有限公司监事、央企信用保障基金理事。
覃 波	非独立董事	男	中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。
徐志刚	独立董事	男	中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业（集团）有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询（上海）有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。
刘 斐	独立董事	女	中共党员，工商管理硕士。曾任上海国际集团旗下私募股权投资基金管理公司—上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理、创始合伙人，浦银安盛基金管理有限公司总经理、董事（浦银安盛创始人），上海东新国际投资管理有限公司总经理、董事（浦发银行与新鸿基合资组建的养老金投资管理公司），浦发银行办公室负责人。
闫立	独立董事	男	中共党员，博士研究生。曾任吉林省长春市公安局民警，中共吉林省委政法委主任科员，吉林省青少年犯罪研究所所长、研究员，上海政法管理干部学院、上海大学法学院副院长、二级教授、博士研究生导师，上海政法学院副院长、二级教授、博士研究生导师，上海政法学院终身教授、二级教授、博士研究生导师。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
赵雍	监事会主席	男	中共党员，管理学学士，国际注册内部审计师、审计师、管理咨询师，现任中国宝武钢铁集团有限公司巡视办、审计部 巡视工作（综合管理）处长。历任宝钢集团有限公司综合审计管理员、宝钢集团有限公司经营审计管理师、宝钢集团有限公司经营审计专员、宝钢集团有限公司经营审计高级专员、中国宝武钢铁集团有限公司经营审计高级专员、中国宝武钢铁集团有限公司派出子公司监事管理处长。目前兼任宁波宝新不锈钢有限公司监事会主席、宝钢德盛不锈钢有限公司监事、中联先进钢铁材料技术有限责任公司监事。
李世英	监事	女	民革党员，硕士。现任长江证券股份有限公司财务总部总经理；兼任长江证券承销保荐有限公司、长江证券(上海)资产管理有限公司、长江成长资本投资有限公司、长江证券创新投资(湖北)有限公司、长江期货股份有限公司和长江证券国际金融集团有限公司董事、湖北省武汉市江汉区第十六届人大代表，中南财经政法大学工商管理学院 MBA 教育中心硕士研究生合作导师。曾任长江三峡实业开发公司财务部出纳、会计；长江证券股份有限公司国际业务总部会计兼行政岗，投资银行总部财务部经理、财务总部核算部副经理，大鹏证券托管工作组财务管理岗，重庆营业部财务经理岗，财务总部财务管理岗、核算管理岗、副总经理，资本市场部副总经理，长江成长资本投资有限公司首席财务官。
王鹏	监事	男	工学博士，中共党员，高级经济师，金融风险管理师（FRM），湖南省湖湘青年英才。现任湖南财信金融控股集团有限公司机关第一党支部书记、集团风控合规部副总经理。兼任湖南省征信有限公司监事、湖南财信商业保理有限公司监事。历任中国人民财产保险股份有限公司信用保证保险事业部主管，吉祥人寿保险股份有限公司资产管理部信用评估室经理助理，财信吉祥人寿保险股份有限公司资产管理部信用评估室副经理、资产管理部总经理助理兼信用评估室经理等职。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼综合行政部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监、零售服务部总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证

			券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司人力资源部副总监。曾任上海市徐汇区文化局（现为上海市徐汇区文化和旅游局）科员、华夏证券股份有限公司人事主管，国泰基金管理有限公司人力资源副经理、长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
覃波	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任长江证券有限责任公司（现长江证券股份有限公司）武汉自治街营业部总经理，中南证券营业部副总经理，深圳燕南路证券营业部副总经理，彭刘杨路营业部总经理兼自治街证券营业部总经理，经纪事业部副总经理，北方总部副总经理兼北京展览路证券营业部总经理，北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，经纪业务总部副总经理，经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任，经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、经纪业务总部产品推广部经理，经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
邓挺	副总经理	男	经济学、法学双学士，毕业于中南财经政法大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理。曾任富国基金管理有限公司渠道经理、高级渠道经理、华东营销中心渠道总监、华中营销中心总经理，长信基金管理有限责任公司机构业务部总监、保险业务部总监、总经理助理。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历

左金保	总经理助理、 量化投资部总 监、基金经理	自 2015 年 3 月 14 日起至 今	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、量化研究部总监、先后于 2015 年 3 月至 2015 年 7 月担任长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、2015 年 7 月至 2018 年 2 月担任长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、2015 年 8 月至 2018 年 2 月担任长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理、2017 年 4 月至 2017 年 9 月担任长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理、2017 年 9 月至 2018 年 8 月担任长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）的基金经理、2016 年 4 月至 2018 年 9 月担任长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、2017 年 1 月至 2018 年 12 月担任长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、2016 年 7 月至 2019 年 3 月担任长信利发债券型证券投资基金的基金经理、2016 年 6 月至 2019 年 5 月担任长信先锐债券型证券投资基金的基金经理、2018 年 4 月至 2019 年 5 月担任长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理、2018 年 2 月至 2019 年 8 月担任长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、2016 年 9 月至 2019 年 9 月担任长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理、2019 年 5 月至 2020 年 4 月担任长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理、2018 年 3 月至 2022 年 1 月担任长信消费精选行业量化股票型证券投资基金的基金经理、2018 年 8 月至 2022 年 1 月担任长信量化价值驱动混合型证券投资基金的基金经理、2015 年 7 月至 2023 年 7 月担任长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。现任总经理助理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、2015 年 3 月至今担任长信量化先锋混合型证券投资基金的基金经理、2015 年 3 月至今担任长信量化中小盘股票型证券投资基金的基金经理、2016 年 7 月至今担任长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、2017 年 11 月至今担任长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理、2018 年 8 月至今担任长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、2022 年
-----	----------------------------	-----------------------------	--

			12 月至今担任长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金的基金经理、2023 年 4 月至今担任长信中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。
胡倩	基金经理	自 2011 年 4 月 15 日起至 2015 年 3 月 14 日	曾任本基金的基金经理。
叶琦	基金经理	自 2011 年 11 月 1 日起至 2012 年 3 月 7 日	曾任本基金的基金经理。
卢曼	基金经理	自基金合同生效之日起至 2011 年 9 月 21 日	曾任本基金的基金经理。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理、投资决策委员会主任委员
李家春	公司总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金和长信稳健成长混合型证券投资基金的基金经理
高远	研究发展部总监、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金和长信均衡优选混合型证券投资基金的基金经理
易利红	股票交易部总监
张文琍	固收多策略部副总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理
陆莹	现金理财部副总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理
叶松	总经理助理、绝对收益部总监兼权益投资部总监兼养老 FOF 投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金和长信先锐混合型证券投资基金的基金经理
左金保	总经理助理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行

	业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金和长信中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理
涂世涛	量化专户投资部总监兼投资经理
蔡军华	固收研究部总监
陈言午	专户投资部总监兼投资经理
宋海岸	量化研究部总监、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
冯彬	固收多策略部总监、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金和长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理
崔飞燕	固收专户投资部总监兼投资经理
注：上述人员之间均不存在近亲属关系	

(三) 内部组织结构及员工情况

内部组织结构及员工情况	
股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。	
公司经营管理层下设的委员会	内部控制委员会、投资决策委员会
公司内部组织结构	量化投资部、权益投资部、研究发展部、股票交易部、债券交易部、基金事务部、营销管理部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、人力资源部、国际业务部、战略与产品研发部、电子商务部、财务管理部、专户投资部、固收专户投资部、量化专户投资部、绝对收益部、养老 FOF 投资部、券商业务部、培训部、固收多策略部、现金理财部、集团业务部、量化研究部、固收研究部、营销服务部、资产配置研究部、机构服务部
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉分公司、沈阳分公司
员工总数	246 人（截至 2023 年 8 月 25 日）

(四) 基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

- 4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- 6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12、编制中期报告和年度报告；
- 13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 15、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；
- 16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 17、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 15 年以上；
- 18、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；
- 19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变

现和分配；

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

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

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

24、执行生效的基金份额持有人大会决议；

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

（五）基金管理人的承诺

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）依照法律法规有关规定，由中国证监会禁止的其他行为。

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、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(六) 基金管理人的风险管理和内部控制制度

基金管理人高度重视内部风险控制，建立了完善的风险管理体系和控制体系，从制度上保障本基金的规范运作。

1、公司内部控制的总体目标

- (1) 保证公司经营管理活动的合法合规性；
- (2) 保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- (3) 实现公司稳健、持续发展、维护股东权益；
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

2、内部控制制度遵循的原则

(1) 合法合规性原则：公司内部控制制度应当符合国家法律法规和各项规定。

(2) 全面性原则：内部控制制度应当覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工。

(3) 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，内部控制制度应当具有高度的权威性，任何员工不得拥有超越制度约束的权利。

(4) 独立性原则：公司在精简的基础上设立能够充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立。公司固有财产、基金财产和其他财产的运作应当分离。

(5) 相互制约原则：公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(6) 防火墙原则：公司基金投资、交易、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，应当制定严格的审批程序和监管措施。

(7) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为

出发点。

(8) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

(9) 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。

(10) 保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上。

(11) 定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

3、内部风险控制体系结构

公司内控体系由不同层面的构成。公司董事会、经营管理层（包括督察长）、内部控制委员会、监察稽核部及公司其他部门、各岗位在各自职责范围内承担风险控制责任。

(1) 董事会：全面负责公司的风险控制工作，对建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；

(2) 经营管理层：负责日常经营管理中的风险控制工作，对内部控制制度的有效执行承担责任；督察长：负责对公司内部管理、资产运作以及经营管理层、内部各部门、各岗位执行制度及遵纪守法情况进行监督和检查，并对公司内部风险控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价；

(3) 内部控制委员会：协助经营管理层负责公司风险控制工作，主要负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制定相应的控制制度，协调处理突发性重大事件或危机事件。内部控制委员会由公司总经理、副总经理、监察稽核部总监、基金事务部总监、市场开发部总监和部分从事内部控制方面的业务骨干组成；

(4) 监察稽核部：负责检查评价公司内部控制制度的合法性、合规性、完备性、有效性以及执行情况；对公司经营业务和基金运作情况进行日常稽核；对各部门、各岗位、各项业务的风险控制情况实施全面的监督检查，并及时报告检查结果。监察稽核部独立行使检查权并对经营管理层负责；

(5) 业务部门和公司各岗位：公司业务部门根据公司各项基本管理制度，结合部门具体情况制定本部门的管理办法和实施细则，加强对各项业务和各业务环节的风险控制；公司各岗位：根据岗位职责和业务操作流程，按业务授权规范操作，严格控制操作风险。

4、内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的内部风险控制制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成，按照其效力大小分为四个层面：

第一个层面是公司章程。

第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司自定各项规章制度的基础和依据，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

第三个层面是公司基本管理制度，它包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源制度、业绩评估考核制度和危机处理制度等等。

第四个层面是公司各部门业务规章、实施细则等。部门业务规章、实施细则是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

5、内部风险管理体系

基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险以及不可抗力风险。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理程序，具体包括以下内容：

- (1) 投资风险的管理；
- (2) 交易风险管理；
- (3) 巨额赎回风险管理；
- (4) 基金注册登记风险管理；
- (5) 基金核算风险管理；

- (6) 市场开发风险管理；
- (7) 信息披露风险管理；
- (8) 不可抗力风险管理。

6、风险管理和内部控制的措施

(1) 建立内控结构，完善内控制度：建立、健全了行之有效的内控制度，确保各项业务活动都有适当的授权和明确的分工，确保监察稽核活动的独立性、权威性；

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立了明确的岗位分离制度，做到研究、决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，同时进行空间隔离，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密，从制度上降低和防范风险；

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每位员工都明确自己的任务、职责，及时上报各自工作领域中发现的风险隐患，以防范和化解风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了内部控制委员会，使用适合的程序和方法，确认和评估公司经营管理和基金运作中的风险；建立自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策，减少风险造成的损失；

(5) 建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如计算机预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，不断提高员工素质和职业技能，防范和化解风险。

7、基金管理人关于内部合规控制声明书

- (1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制。

四、基金托管人

一、基金托管人基本情况

(一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 13 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 137 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 11 位。

截至 2022 年 12 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 12.99 万亿元。2022 年四季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 921.5 亿元。

交通银行总行设资产托管部（下文简称“托管部”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长； 2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生 2020 年 7 月起担任本行行长；2016 年 11 月至 2020 年 5 月任中国投资有限责任公司副总经理；2014 年 12 月至 2016 年 11 月任中国光大集团股份公司副总经理；2014 年 6 月至 2014 年 12 月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014 年 6 月至 2016 年 11 月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009 年 9 月至 2014 年 6 月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993 年 7 月至 2009 年 9 月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生 2003 年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生 2022 年 4 月起任本行资产托管部总经理；2014 年 12 月至 2022 年

4月任本行资产托管部副总经理；2000年7月至2014年12月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生2000年于复旦大学获经济学硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至2022年12月31日，交通银行共托管证券投资基金715只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产、QDIE资金、QDLP资金和QFLP资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、合法性原则：托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、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，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管部内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务运营档案管理办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公

开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

五、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

长信量化先锋混合型证券投资基金 A 类份额销售机构:

1	1、直销中心：长信基金管理有限责任公司	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼	
	法定代表人：刘元瑞	联系人：顾洵
	电话：021-61009916	传真：021-61009917
	客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
	2、场外代销机构	
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	联系人：林葛
	电话：010-66060069	传真：010-68121816
	客户服务电话：95599	网址：www.abchina.com
2	中国工商银行股份有限公司	
	注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号	
	办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号	
	法定代表人：陈四清	联系人：陈实
	电话：010-66105662	
	客户服务电话：95588	网址：www.icbc.com.cn
3	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：刘文霞
	电话：010-66596325	
	客户服务电话：95566	网址：www.boc.cn
4	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：张静
	电话：010-67596084	
	客户服务电话：95533	网址：www.ccb.com

5	交通银行股份有限公司	
	注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号	
	法定代表人：任德奇	联系人：高天
	电话：021-58781234	传真：021-58408483
	客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
6	招商银行股份有限公司	
	注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
	办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
	法定代表人：缪建民	联系人：季平伟
	电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
	客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.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：唐苑
	电话：021-61618888	传真：021-63604199
	客户服务电话：95528	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：福州市湖东路 154 号中山大厦	
	法定代表人：吕家进	联系人：蒋怡
	电话：0591-87839338	传真：0591-87841932
	客户服务电话：95561	网址：www.cib.com.cn
9	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：罗菲菲
	电话：010-58560666	传真：010-58560666
	客户服务电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
10	中信银行股份有限公司	
	注册地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座	
	办公地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座	
	法定代表人：李庆萍	联系人：方爽
	电话：010-65558888	
	客户服务电话：95558	网址：bank.ecitic.com

11	重庆银行股份有限公司	
	注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
	办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
	法定代表人：林军	联系人：孔文超
	电话：023-63799379	传真：023-63792412
	客户服务电话：956023	网址：www.cqcbank.com
12	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 号华夏银行大厦	
	办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
	法定代表人：李民吉	联系人：刘军祥
	电话：010-85238667	传真：010-85238680
	客户服务电话：010-95577	网址：www.hxb.com.cn
13	汉口银行股份有限公司	
	注册地址：江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
	办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
	法定代表人：陈新民	联系人：张晓欢
	电话：027-82656924	传真：027-82656099
	客户服务电话：96558（武汉）； 40060-96558（全国）	网址：www.hkbchina.com
14	杭州银行股份有限公司	
	注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
	办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
	法定代表人：陈震山	联系人：严峻
	电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
	客户服务电话：95398，400-8888-508	网址：www.hzbank.com.cn
15	平安银行股份有限公司	
	注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
	办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
	法定代表人：谢永林	联系人：赵杨
	电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
	客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
16	厦门银行股份有限公司	
	注册地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
	办公地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
	法定代表人：吴世群	联系人：林黎云
	电话：0592-5365735	传真：0592-5061952

	客户服务电话：400-858-8888	网址：www.xmbankonline.com
17	江苏银行股份有限公司	
	注册地址：南京市中华路 26 号	
	办公地址：南京市中华路 26 号	
	法定代表人：夏平	联系人：张洪玮
	电话：025-58587036	传真：025-58587820
	客户服务电话：95319	网址：www.jsbchina.cn
18	宁波银行股份有限公司	
	注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号	
	办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号	
	法定代表人：陆华裕	联系人：王靖余
	电话：021-23262712	传真：021-63586853
	客户服务电话：95574	网址：www.nbcb.com.cn
19	安信证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	
	办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	
	法定代表人：黄炎勋	联系人：陈剑虹
	电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
	客户服务电话：95517	网址：http://www.essence.com.cn/
20	长城证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层	
	办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层	
	法定代表人：张巍	联系人：高峰
	电话：0755-83516289	传真：0755-83515567
	客户服务电话：400-6666-888	网址：www.cgws.com
21	长江证券股份有限公司	
	注册地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号	
	办公地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号	
	法定代表人：金才玖	联系人：奚博宇
	电话：027-65799999	传真：027-85481900
	客户服务电话：95579 或 4008-888-999	网址：www.95579.com
22	大通证券股份有限公司	
	注册地址：辽宁省大连市中山区人民路 24 号	
	办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层	
	法定代表人：赵玺	联系人：谢立军

	电话：0411-39673202	传真：0411-39673219
	客户服务电话：4008-169-169	网址：www.daton.com.cn
	德邦证券有限责任公司	
	注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼	
	办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼	
23	法定代表人：姚文平	联系人：王志琦
	电话：021-68761616	传真：021-68767032
	客户服务电话：400-8888-128	网址：www.tebon.com.cn
	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 18 楼	
24	法定代表人：刘学民	联系人：单晶
	电话：0755-23838750	传真：0755-25831754
	客户服务电话：95358	网址：www.firstcapital.com.cn
	东吴证券股份有限公司	
	注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号	
	办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号	
25	法定代表人：范力	联系人：陆晓
	电话：0512-62938521	传真：0512-65588021
	客户服务电话：400 860 1555	网址：www.dwjq.com.cn
	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	
26	法定代表人：刘秋明	联系人：龚俊涛
	电话：021-22169999	传真：021-22169134
	客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
	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 楼、20 楼	
	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 楼、20 楼	
27	法定代表人：胡伏云	联系人：梁微
	电话：020-88836999	传真：020-88836654
	客户服务电话：95548	网址：www.gzs.com.cn
	华福证券有限责任公司	
	注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层	
	办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层	
28	法定代表人：黄金琳	联系人：张腾

	电话：0591-87383623	传真：0591-87383610
	客户服务电话：95547	网址：www.hfzq.com.cn
	广发证券股份有限公司	
	注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室	
	办公地址：广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦	
29	法定代表人：林传辉	联系人：马梦洁
	电话：020-87555888 转各营业网点	传真：020-87557985
	客户服务电话：95575 或致电各地营业部	网址：www.gf.com.cn
	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	
30	法定代表人：翁振杰	联系人：李骏
	电话：010-84183389	传真：010-84183311-3389
	客户服务电话：400-818-8118	网址：www.guodu.com
	国金证券股份有限公司	
	注册地址：成都市东城根上街95号	
	办公地址：四川省成都市东城根上街95号	
31	法定代表人：冉云	联系人：杜晶、贾鹏
	电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
	客户服务电话：95310	网址：www.gjzq.com.cn
	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	
	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	
32	法定代表人：姚志勇	联系人：沈刚
	电话：0510-82831662	传真：0510-82830162
	客户服务电话：95570	网址：www.glsc.com.cn
	国盛证券有限责任公司	
	注册地址：江西省南昌市新建区子实路1589号	
	办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行大楼	
33	法定代表人：徐丽峰	联系人：占文驰
	电话：0791-88250812	传真：0791-86281443
	客户服务电话：956080	网址：www.gszq.com
	国泰君安证券股份有限公司	
34	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	

	法人代表人：贺青 电话：021-38676666 客户服务热线：95521/4008888666	联系人：朱雅崴 传真：021-38670666 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：张纳沙 电话：0755-81981259 客户服务电话：95536	联系人：于智勇 传真：0755-82133952 网址：www.guosen.com.cn
36	国元证券股份有限公司 注册地址：安徽省合肥市寿春路179号 办公地址：安徽省合肥市寿春路179号	
	法定代表人：俞仕新 电话：05551-2615542 客户服务电话：95578；4008-888-777	联系人：李飞 传真：0551-2634906 网址：www.gyzq.com.cn
37	海通证券股份有限公司 注册地址：上海市淮海中路98号 办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦	
	法定代表人：周杰 电话：021-23219000 客户服务电话：400-8888-001 或 95553	联系人：李笑鸣 传真：021-23219100 网址：www.htsec.com
38	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：合肥市蜀山区南二环959号B1座华安证券	
	法定代表人：章宏韬 电话：0551-5161666 客户服务电话：96518、400-80-96518	联系人：汪燕 传真：0551-5161600 网址：www.hazq.com
39	华宝证券有限责任公司 注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层 办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层	
	法定代表人：刘加海 电话：021-68777222 客户服务电话：400-820-9898	联系人：刘闻川 传真：021-68777822 网址：www.cnhbstock.com

40	华龙证券股份有限公司	
	注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼	
	办公地址：甘肃省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：范坤
	电话：0931-4890208	传真：0931-4890628
	客户服务电话：95368、4006898888	网址：www.hlzq.com
41	华泰证券股份有限公司	
	注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
	办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
	法定代表人：张伟	联系人：郭琳
	电话：025-83290979	传真：025-84579763
	客户服务电话：95597	网址：www.htsc.com.cn
42	江海证券有限公司	
	注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号	
	办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号	
	法定代表人：赵洪波	联系人：高悦铭
	电话：0451-82336863	传真：0451-82287211
	客户服务电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn
43	中航证券有限公司	
	注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼	
	办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼	
	法定代表人：丛中	联系人：戴蕾
	电话：0791-86768681	传真：0791-86770178
	客户服务电话：400-8866-567	网址：www.avicsec.com
44	平安证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
	办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）	
	法定代表人：何之江	联系人：王阳
	电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
	客户服务电话：95511-8	网址：www.stock.pingan.com
45	中泰证券股份有限公司	
	注册地址：济南市市中区经七路 86 号	
	办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
	法定代表人：李峰	联系人：秦雨晴
	电话：021-20315197	传真：021-20315125
	客户服务电话：95538	网址：www.zts.com.cn

46	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：上海市西藏中路 336 号	
	法定代表人：何伟	联系人：许曼华
	电话：021-53686888	传真：021-53686100-7008、021-53686200-7008
	客户服务电话：4008918918	网址：www.shzq.com
47	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 号世纪商贸广场 45 层	
	法定代表人：杨玉成	联系人：陈宇
	电话：021-33388999	传真：021-33388224
	客户服务电话：95523；4008895523	网址：www.swhysc.com
48	申万宏源西部证券有限公司	
	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	
	办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	
	法定代表人：王献军	联系人：梁丽
	电话：0991-2307105	传真：010-88085195
	客户服务电话：95523；4008895523	网址：www.swhysc.com
49	天风证券股份有限公司	
	注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼	
	办公地址：中国湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 48 层	
	法定代表人：余磊	联系人：程晓英
	电话：18064091773	传真：027-87618863
	客服电话：95391 或 400-800-5000	网址：www.tfzq.com
50	天相投资顾问有限公司	
	注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701	
	办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层	
	法定代表人：林义相	联系人：谭磊
	电话：010-66045182	传真：010-66045518
	客户服务电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
51	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：021-50295432	传真：021-68865680

	客户服务电话：95351	网址：www.xcsc.com
52	国融证券股份有限公司	
	注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼	
	办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层	
	法定代表人：张智河	联系人：叶密林
	电话：010-83991719	传真：010-66412537
	客户服务电话：95385	网址：www.grzq.com
53	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：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层	
	法定代表人：霍达	联系人：业清扬
	电话：0755-82943666	传真：0755-82943121
	客户服务电话：95565 或 0755-95565	网址：www.cmschina.com
54	中国民族证券有限责任公司	
	注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层	
	办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层	
	法定代表人：赵大建	联系人：姜建平
	电话：010-59355543	传真：010-66553791
	客户服务电话：40088-95618	网址：www.e5618.com
55	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	
	客户服务电话：4008-888-888 或 95551	网址：www.chinastock.com.cn
56	中信建投证券股份有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼	
	办公地址：北京市朝阳区门内大街188号	
	法定代表人：王常青	联系人：张颢
	电话：010-85130588	传真：010-65182261
	客户服务电话：400-8888-108	网址：www.csc108.com
57	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：洪成
	电话：0755-23953913	传真：0755-83217421
	客户服务电话：4009908826	网址：www.citicsf.com
58	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：侯艳红
	电话：010-60838888	传真：010-60833739
	客户服务电话：95548；400-889-5548	网址：www.citics.com
59	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5层	
	法定代表人：冯恩新	联系人：焦刚
	电话：0531-89606166	传真：0532-85022605
	客户服务电话：95548	网址：http://sd.citics.com/
60	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	网址：www.zszq.com.cn
61	信达证券股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
	办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
	法定代表人：祝瑞敏	联系人：鹿馨方
	电话：010-63081000	传真：010-63080978
	客服热线：95321	网址：www.cindasc.com
62	西南证券股份有限公司	
	注册地址：重庆市江北区桥北苑8号	
	办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦	
	法定代表人：廖庆轩	联系人：周青
	电话：023-63786633	传真：023-67616310
	客服热线：95355、4008096096	网址：www.swsc.com.cn
63	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五常街道文一西路969号3幢5层599室	
	办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼	
	法定代表人：祖国明	联系人：韩爱彬
	电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
	客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
64	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	
	法定代表人：张跃伟	联系人：马良婷
	电话：021-20691832	传真：021-20691861
	客户服务电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com
65	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：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼	
	法定代表人：汪静波	联系人：李娟
	电话：021-38602377	传真：021-38509777
	客户服务电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
66	上海好买基金销售有限公司	
	注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室	
	办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室	
	法定代表人：杨文斌	联系人：徐超逸
	电话：021-20613988	传真：021-68596916
	客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com
67	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：章知方	联系人：陈慧慧
	电话：010-85657353	传真：010-65884788
	客户服务电话：400-920-0022	网址：www.licaike.hexun.com
68	上海天天基金销售有限公司	
	注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	
	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：其实	联系人：余强萍
	电话：021-54509998	传真：021-64385308
	客户服务电话：400-1818-188	网址：fund.eastmoney.com
69	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 C 座 1809	
	法定代表人：才殿阳	联系人：程刚
	电话：010-52855713	传真：010-85894285
	客户服务电话：400-6099-200	网址：www.yixinfund.com
70	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街 18 号同花顺大楼 4 层	
	法定代表人：吴强	联系人：吴强
	电话：952555	传真：0571-86800423
	客户服务电话：952555	公司网站：www.5ifund.com
71	上海汇付基金销售有限公司	
	注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元	
	办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋	
	法定代表人：金佶	联系人：甄宝林
	电话：021-34013996-3011	
	客户服务电话：021-34013999	网址：www.hotjijin.com
72	上海陆金所基金销售有限公司	
	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元	
	办公地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼	
	法定代表人：陈祎彬	联系人：宁博宇
	电话：021-20665952	传真：021-22066653
	客户服务电话：4008219031	网址：www.lufunds.com
73	上海联泰基金销售有限公司	
	注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室	
	办公地址：上海市虹口区临潼路 188 号	
	法定代表人：尹彬彬	联系人：陈东
	电话：021-52822063	传真：021-52975270
	客户服务电话：400-118-1188	网址：www.66liantai.com
74	海银基金销售有限公司	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼	
	法定代表人：巩巧丽	联系人：毛林
	电话：021-80133597	传真：021-80133413
	客户服务电话：4008081016	网址：www.fundhaiyin.com
75	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：葛佳蕊
	电话：021-80365020	传真：021-63332523
	客户服务电话：4006433389	网址：www.vstonewealth.com
76	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：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层	
	法定代表人：李兴春	联系人：陈孜明
	电话：18516109631	传真：86-021-61101630
	客户服务电话：400-032-5885	网站：www.leadfund.com.cn
77	珠海盈米基金销售有限公司	
	注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室	
	办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 层	
	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	网站：www.yingmi.cn
78	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 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号	
	办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层	
	法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
	电话：010-56282140	传真：010-62680827
	客户服务电话：400-619-9059	网站：www.hcfunds.com
79	财通证券股份有限公司	
	注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716	
	办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716	
	法定代表人：陆建强	联系人：陶志华
	电话：0571-87789160	传真：0571-87818329
	客户服务电话：95336, 40086-96336	网站：www.ctsec.com
80	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：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：010-88066552
	客户服务电话：4008175666	网站：www.amcfortune.com

81	和谐保险销售有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302	
	办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 6 号安邦金融中心	
	法定代表人：左荣林	联系人：张楠
	电话：010-85256214	
	客户服务电话：4008195569	网站：www.hx-sales.com
82	一路财富（北京）基金销售股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208	
	办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208	
	法定代表人：吴雪秀	联系人：徐越
	电话：010-88312877-8032	传真：010-88312099
	客户服务电话：400-001-1566	网站：www.yilucaifu.com
83	嘉实财富管理有限公司	
	注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元	
	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：王宫
	电话：021-38789658	传真：021-68880023
	客户服务电话：400-600-8800	网站：www.jsfund.cn
84	北京雪球基金销售有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室	
	办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层	
	法定代表人：李楠	联系人：吴迪
	电话：010-57319532	
	客户服务电话：400-1599-288	网站：www.danjuanfunds.com
85	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	
	法定代表人：王翔	联系人：张巍婧
	电话：021-65370077-255	传真：021-55085991
	客户服务电话：400-820-5369	网站：www.jiyufund.com.cn
86	开源证券股份有限公司	
	注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
	办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
	法定代表人：李刚	联系人：袁伟涛
	电话：029-88447611	传真：029-88447611

	客户服务电话：95325 或 400-860-8866	网站：www.kysec.cn
87	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：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦	
	法定代表人：刘明军	联系人：刘鸣
	电话：0755-86013388-77386	
	客户服务电话：4000-890-555；95017（拨通后转1转8）	网站：www.tenganxinxi.com、www.txfund.com
88	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105号中环国际1413室	
	法定代表人：吴言林	联系人：林伊灵
	电话：025-66046166（分机号转810）	传真：025-53086966
	客户服务电话：025-66046166 转849	网站：www.huilinbd.com
89	华鑫证券有限责任公司	
	注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元	
	办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号	
	法定代表人：俞洋	联系人：杨莉娟
	电话：021-54967552	传真：021-54967293
	客户服务电话：95323	网站：www.cfsc.com.cn
90	中国人寿保险股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区金融大街16号	
	办公地址：北京市西城区金融大街16号中国人寿广场	
	法定代表人：王滨	联系人：秦泽伟
	电话：010-63631752	传真：010-6622276
	客户服务电话：95519	网站：www.e-chinalife.com
91	民商基金销售（上海）有限公司	
	注册地址：上海市黄埔区北京东陆666号H区（东座）6楼A31室	
	办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼	
	法定代表人：贵惠琴	联系人：林志枫
	电话：15626219801	传真：021-50206001
	客户服务电话：021-50206003	网站：www.msftec.com
92	泛华普益基金销售有限公司	
	注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室	

	办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座 12 层	
	法定代表人：于海峰	联系人：隋亚方
	电话：13910181936	
	客户服务电话：400-080-3388	网站：www.puyifund.com
93	国新证券股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室	
	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	
	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	网站：www.crsec.com.cn
94	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	
	办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼	
	法定代表人：葛新	联系人：王笑宇
	电话：010-59403028	传真：010-59403027
	客户服务电话：95055-4	网址：www.baiyingfund.com
95	京东肯特瑞基金销售有限公司	
	注册地址：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：北京市亦庄开发区科创 11 街 18 号京东大厦 A 座 15 层	
	法定代表人：李骏	联系人：隋斌
	客户服务电话：4000988511	传真：010-89189566
	网址：https://kenterui.jd.com/	
96	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
	客服电话：95357	传真：021-23586860
	公司网站：http://www.18.cn	
97	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	
	法定代表人：黄伟	联系人：马焱莹
	电话：021-50712782	
	客户服务电话：400-799-1888	网址：www.520fund.com.cn
98	东莞证券股份有限公司	
	注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号	

	办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心22楼	
	法定代表人：陈照星	联系人：梁微
	电话：0769-22115712	传真：0769-22115712
	客户服务电话：95328	网址：www.dgzq.com.cn
99	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	网址：www.jianfortune.com
100	南京苏宁基金销售有限公司	
	注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号	
	办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号	
	法定代表人：钱燕飞	联系人：冯鹏鹏
	电话：18551604006	
	客户服务电话：95177	网址：www.snjijin.com
101	北京创金启富基金销售有限公司	
	注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室	
	办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室	
	法定代表人：梁蓉	联系人：魏素清
	电话：010-66154828	传真：010-63583991
	客户服务电话：010-66154828	网址：www.5irich.com
102	上海中欧财富基金销售有限公司	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路497号1008-1室	
	办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋嘉昱大厦6层	
	法定代表人：许欣	联系人：张政
	电话：18865518956	传真：02135073616
	客户服务电话：400-700-9700	网址：www.zocaifu.com
103	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：彭浩	联系人：孔安琪
	电话：18201874972	
	客户服务电话：4000048821	网址：www.taixincf.com
104	南京证券股份有限公司	
	注册地址：南京市江东中路389号	

	办公地址：南京市江东中路 389 号	
	法定代表人：李剑锋	联系人：曹梦媛
	电话：025-58519529	
	客户服务电话：95386	网址：www.njzq.com.cn
105	博时财富基金销售有限公司	
	注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层	
	办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层	
	法定代表人：王德英	联系人：崔丹
	电话：0755-83169999	传真：0755-83195220
	客户服务电话：400-610-5568	网址：www.boserawealth.com
1	3、场内销售机构	
	场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站： http://www.sse.com.cn	

长信量化先锋混合型证券投资基金 C 类份额销售机构：

1	1、直销中心：长信基金管理有限责任公司	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼	
	法定代表人：刘元瑞	联系人：顾洵
	电话：021-61009916	传真：021-61009917
	客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
	2、场外代销机构	
1	招商银行股份有限公司	
	注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
	办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
	法定代表人：缪建民	联系人：季平伟
	电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
	客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
2	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：福州市湖东路 154 号中山大厦	
	法定代表人：吕家进	联系人：蒋怡
	电话：0591-87839338	传真：0591-87841932
	客户服务电话：95561	网址：www.cib.com.cn
3	杭州银行股份有限公司	
	注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
	办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	

	法定代表人：陈震山	联系人：严峻
	电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
	客户服务电话：95398，400-8888-508	网址：www.hzbank.com.cn
4	江苏银行股份有限公司	
	注册地址：南京市中华路 26 号	
	办公地址：南京市中华路 26 号	
	法定代表人：夏平	联系人：张洪玮
	电话：025-58587036	传真：025-58587820
	客户服务电话：95319	网址：www.jsbchina.cn
5	宁波银行股份有限公司	
	注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号	
	办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号	
	法定代表人：陆华裕	联系人：王靖余
	电话：021-23262712	传真：021-63586853
	客户服务电话：95574	网址：www.nbcb.com.cn
6	安信证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	
	办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	
	法定代表人：黄炎勋	联系人：陈剑虹
	电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
	客户服务电话：95517	网址：http://www.essence.com.cn/
7	长江证券股份有限公司	
	注册地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号	
	办公地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号	
	法定代表人：金才玖	联系人：奚博宇
	电话：027-65799999	传真：027-85481900
	客户服务电话：95579 或 4008-888-999	网址：www.95579.com
8	国金证券股份有限公司	
	注册地址：成都市东城根上街 95 号	
	办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
	法定代表人：冉云	联系人：杜晶、贾鹏
	电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
	客户服务电话：95310	网址：www.gjzq.com.cn
9	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	
	法人代表人：贺青	联系人：朱雅崑
	电话：021-38676666	传真：021-38670666
	客户服务热线：95521/4008888666	网址：www.gtja.com
10	海通证券股份有限公司	
	注册地址：上海市淮海中路 98 号	
	办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦	
	法定代表人：周杰	联系人：李笑鸣
	电话：021-23219000	传真：021-23219100
	客户服务电话：400-8888-001 或 95553	网址：www.htsec.com
11	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：合肥市蜀山区南二环 959 号 B1 座华安证券	
	法定代表人：章宏韬	联系人：汪燕
	电话：0551-5161666	传真：0551-5161600
	客户服务电话：96518、400-80-96518	网址：www.hazq.com
12	华宝证券有限责任公司	
	注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
	办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
	法定代表人：刘加海	联系人：刘闻川
	电话：021-68777222	传真：021-68777822
	客户服务电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
13	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	
	客户服务电话：95562	网址：www.xyzq.com.cn
14	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：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层	
	法定代表人：霍达	联系人：业清扬
	电话：0755-82943666	传真：0755-82943121
	客户服务电话：95565 或 0755-95565	网址：www.cmschina.com
15	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	
	客户服务电话：4008-888-888 或 95551	网址：www.chinastock.com.cn
16	中信建投证券股份有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	
	办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号	
	法定代表人：王常青	联系人：张颢
	电话：010-85130588	传真：010-65182261
	客户服务电话：400-8888-108	网址：www.csc108.com
17	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五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室	
	办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼	
	法定代表人：祖国明	联系人：韩爱彬
	电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
	客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
18	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	
	法定代表人：张跃伟	联系人：马良婷
	电话：021-20691832	传真：021-20691861
	客户服务电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com
19	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：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼	
	法定代表人：汪静波	联系人：李娟
	电话：021-38602377	传真：021-38509777
	客户服务电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
20	上海好买基金销售有限公司	
	注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室	
	办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室	
	法定代表人：杨文斌	联系人：徐超逸
	电话：021-20613988	传真：021-68596916
	客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com

21	上海天天基金销售有限公司	
	注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	
	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：其实	联系人：余强萍
	电话：021-54509998	传真：021-64385308
	客户服务电话：400-1818-188	网址：fund.eastmoney.com
22	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街18号同花顺大楼4层	
	法定代表人：吴强	联系人：吴强
	电话：952555	传真：0571-86800423
	客户服务电话：952555	公司网站：www.5ifund.com
23	上海联泰基金销售有限公司	
	注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室	
	办公地址：上海市虹口区临潼路188号	
	法定代表人：尹彬彬	联系人：陈东
	电话：021-52822063	传真：021-52975270
	客户服务电话：400-118-1188	网址：www.66liantai.com
24	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：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层	
	法定代表人：李兴春	联系人：陈孜明
	电话：18516109631	传真：86-021-61101630
	客户服务电话：400-032-5885	网站：www.leadfund.com.cn
25	珠海盈米基金销售有限公司	
	注册地址：珠海市横琴新区环岛东路3000号2719室	
	办公地址：广州市海珠区阅江中路688号保利国际广场北塔33层	
	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	网站：www.yingmi.cn
26	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E世界财富中心A座11层1108号	
	办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层	
	法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
	电话：010-56282140	传真：010-62680827
	客户服务电话：400-619-9059	网站：www.hcfunds.com

27	北京雪球基金销售有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室	
	办公地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层	
	法定代表人：李楠	联系人：吴迪
	电话：010-57319532	
	客户服务电话：400-1599-288	网站：www.danjuanfunds.com
28	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	
	法定代表人：王翔	联系人：张巍婧
	电话：021-65370077-255	传真：021-55085991
	客户服务电话：400-820-5369	网站：www.jiyufund.com.cn
29	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：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦	
	法定代表人：刘明军	联系人：刘鸣
	电话：0755-86013388-77386	
	客户服务电话：4000-890-555；95017（拨通后转1转8）	网站：www.tenganxinxi.com、 www.txfund.com
30	中国人寿保险股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区金融大街16号	
	办公地址：北京市西城区金融大街16号中国人寿广场	
	法定代表人：王滨	联系人：秦泽伟
	电话：010-63631752	传真：010-6622276
	客户服务电话：95519	网站：www.e-chinalife.com
31	民商基金销售（上海）有限公司	
	注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室	
	办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼	
	法定代表人：贲惠琴	联系人：林志枫
	电话：15626219801	传真：021-50206001
	客户服务电话：021-50206003	网站：www.msftec.com
32	泛华普益基金销售有限公司	
	注册地址：成都市成华区建设路9号高地中心1101室	
	办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街399号1栋1单元龙湖西宸天街B座12层	
	法定代表人：于海峰	联系人：隋亚方
	电话：13910181936	

	客户服务电话：400-080-3388	网站：www.puyifund.com
33	国新证券股份有限公司	
	注册地址：北京市西城区车公庄大街4号2幢1层A2112室	
	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	
	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	网站：www.crsec.com.cn
34	深圳市金海九州基金销售有限公司	
	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	
	办公地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	
	法定代表人：彭维熙	联系人：李光和
	电话：0755-36615050-5084	
	客户服务电话：4006773333	网站：www.jhjzfund.com
35	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	
	办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼	
	法定代表人：葛新	联系人：王笑宇
	电话：010-59403028	传真：010-59403027
	客户服务电话：95055-4	网址：www.baiyingfund.com
36	喜鹊财富基金销售有限公司	
	注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室	
	办公地址：北京市朝阳区北苑路甲1号	
	法定代表人：王舰正	机构联系人：张萌
	电话：010-58349088	传真：0891-6177483
	客户服务电话：400 699 7719	网址：www.xiquefund.com
37	京东肯特瑞基金销售有限公司	
	注册地址：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：北京市亦庄开发区科创11街18号京东大厦A座15层	
	法定代表人：李骏	联系人：隋斌
	客户服务电话：4000988511	传真：010-89189566
	网址：https://kenterui.jd.com/	
38	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

	客服电话：95357	传真：021-23586860
	公司网站： http://www.18.cn	
39	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	
	法定代表人：黄祎	联系人：马焱莹
	电话：021-50712782	
	客户服务电话：400-799-1888	网址： www.520fund.com.cn
40	东莞证券股份有限公司	
	注册地址：东莞市莞城区可园南路1号	
	办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心22楼	
	法定代表人：陈照星	联系人：梁微
	电话：0769-22115712	传真：0769-22115712
	客户服务电话：95328	网址： www.dgzq.com.cn
41	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	网址： www.jianfortune.com
42	南京苏宁基金销售有限公司	
	注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号	
	办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号	
	法定代表人：钱燕飞	联系人：冯鹏鹏
	电话：18551604006	
	客户服务电话：95177	网址： www.snjijin.com
43	北京创金启富基金销售有限公司	
	注册地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室	
	办公地址：北京市西城区白纸坊东街2号院6号楼712室	
	法定代表人：梁蓉	联系人：魏素清
	电话：010-66154828	传真：010-63583991
	客户服务电话：010-66154828	网址： www.5irich.com
44	上海中欧财富基金销售有限公司	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路497号1008-1室	
	办公地址：上海市虹口区公平路18号8栋嘉昱大厦6层	
	法定代表人：许欣	联系人：张政

	电话：18865518956	传真：02135073616
	客户服务电话：400-700-9700	网址：www.zocaifu.com
45	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：彭浩	联系人：孔安琪
	电话：18201874972	
	客户服务电话：4000048821	网址：www.taixincf.com
46	南京证券股份有限公司	
	注册地址：南京市江东中路 389 号	
	办公地址：南京市江东中路 389 号	
	法定代表人：李剑锋	联系人：曹梦媛
	电话：025-58519529	
	客户服务电话：95386	网址：www.njzq.com.cn
47	博时财富基金销售有限公司	
	注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层	
	办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层	
	法定代表人：王德英	联系人：崔丹
	电话：0755-83169999	传真：0755-83195220
	客户服务电话：400-610-5568	网址：www.boserawealth.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并在基金管理人网站公示。

（二）其他相关机构

信息类型	A 类份额注册登记机构	C 类份额注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	长信基金管理有限责任公司	上海源泰律师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
法定代表人	周明	刘元瑞	廖海（负责人）	曾顺福
联系电话	010-59378856	021-61009999	021-51150298	021-61418888
传真	010-59378907	021-61009800	021-51150398	021-61411909



联系人	崔巍	孙红辉	廖海、刘佳	汪芳（汪芳、冯适为 经办注册会计师）
-----	----	-----	-------	-----------------------

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定，于 2010 年 7 月 14 日经中国证监会证监许可【2010】962 号文核准募集。

本基金募集期为 2010 年 10 月 11 日至 2010 年 11 月 12 日。经上海众华沪银会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集 324,671,697.42 份基金份额，有效认购户数为 3,874 户。

七、基金合同的生效

(一) 根据《基金法》、《运作办法》和基金合同的有关规定，本基金符合基金合同生效的条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2010年11月18日获得证监会书面确认，基金合同从即日起生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

(二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产额

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元人民币的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案，法律法规或中国证监会另有规定的，按其规定办理。

八、基金份额的申购、赎回与转换

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人的直销机构和基金管理人委托的代销机构以及通过上海证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的会员单位。

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。基金管理人可根据情况针对某类份额增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。

若基金管理人或代销机构开通电话、传真或网上交易业务的，投资者可以以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法另行公告。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及业务办理时间

本基金的开放日是指为投资者办理基金申购、赎回等业务的上海、深圳证券交易所交易日，基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并提前公告。

2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购和赎回自基金合同生效日后不超过 3 个月时间里开始办理。本基金（基金代码：519983 [前端模式]）已于 2011 年 2 月 18 日开始办理日常申购赎回业务。

基金管理人尚未开放本基金[后端模式]日常申购赎回业务，具体办理申购赎回业务的时间基金管理人应按规定在指定媒介公告。

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。投资者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、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转

换时间所在开放日的价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即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份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在交易时间结束前撤销，在交易时间结束后不得撤销；

4、基金份额持有人赎回基金份额，对于其持有的基金份额，基金管理人按照“先进先出”的原则处理，即对基金份额持有人在销售机构托管的份额进行赎回处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回；

5、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，但应按《信息披露办法》等有关规定在新的原则实施前在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回的申请方式

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

投资者在提交申购申请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须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、申购与赎回申请的确认

本基金注册登记机构应以交易时间结束前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日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者应在T+2日（包括该日）起到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

3、申购与赎回的款项支付

申购时，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无效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

赎回时，当投资者赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。如遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款在该等故障消除后及时划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照基金合同有关条款处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、申购金额的限制

自 2014 年 5 月 15 日起，投资者通过场外申购时，投资者首次申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费），追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费）；超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台申购本基金需遵循上述规则；各基金代理销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理申购业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

投资者通过上海证券交易所场内申购时，每笔申购金额最低为人民币 100 元（含申购费），同时每笔申购必须是 100 元的整数倍。

投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

2、赎回份额的限制

自 2014 年 5 月 15 日起，投资者通过场外赎回时，本基金的投资者的最低赎回份额调整为 1 份，即投资者可将其全部或部分基金份额赎回，赎回的最低份额为 1 份；投资者当日持有份额减少导致在销售机构同一交易账户保留的基金份额不足 1 份的，注册登记机构将全部剩余份额自动赎回。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台赎回本基金需遵循上述规则；各基金代理销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理赎回业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

投资者通过场内赎回时，单笔赎回的基金份额为 1 份的整数倍。

3、基金管理人可以规定单个基金份额持有人累计持有的基金份额上限、单笔/单日申购金额上限、本基金总规模上限，详见相关公告。

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，具体请参见相关公告。

5、基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，对以上限制进行调整，最迟在调整前按规定在指定媒介上公告。

（六）申购与赎回的价格、费用及其用途

1、本基金根据注册登记机构、申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。

注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，且收取申购费用而不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，且在投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

2、申购费用

（1）场外申购费用

本基金 A 类基金份额收取基金申购费用；C 类基金份额不收取申购费。投资者可选择在申购或赎回本基金 A 类基金份额时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的费用称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的费用称为后端申购费用。投资者选择前端申购费用时，按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购 A 类基金份额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。养老金客户包括基本养老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：

- (1) 全国社会保障基金；
- (2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- (3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- (4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；
- (5) 企业年金养老金产品；
- (6) 职业年金计划；
- (7) 养老目标基金；
- (8) 个人税收递延型商业养老保险产品；
- (9) 基本养老保险基金；
- (10) 养老保障管理产品。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将依据规定将其纳入养老金客户范围。

通过基金管理人的直销中心申购基金份额的养老金客户及除养老金客户之外的其他投资者申购各类基金份额的申购费率如下：

基金份额类别	申购金额 (M, 含申购费)	非养老金客户前端申购费率	养老金客户前端申购费率
A 类基金份额	M < 100 万	1.5%	0.075%
	100 万 ≤ M < 500 万	1.0%	0.05%
	500 万 ≤ M	1000 元每笔	1000 元每笔
C 类基金份额		0	

注：M 为申购金额

投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率随持有时间的增加而递减，具体费率如下：

基金份额类别	持有年限 (N, 年)	后端申购费率
A 类基金份额	N < 1 年	1.8%
	1 年 ≤ N < 3 年	1.2%
	3 年 ≤ N < 5 年	0.6%
	5 年 ≤ N	0

注：N 为持有年限

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

(2) 场内申购费用

投资者在场内申购本基金 A 类基金份额时缴纳申购费用。本基金 A 类基金份额的场内申购费率与上述规定的场外前端申购费率一致。

3、赎回费用

本基金 A、C 类基金份额收取不同的赎回费，赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，两类份额具体费率如下：

基金份额类别	持有时间 (N, 年)	赎回费率
A 类基金份额	$N < 7$ 日	1.5%
	$7 \text{ 日} \leq N < 1$ 年	0.5%
	$1 \text{ 年} \leq N < 2$ 年	0.2%
	$2 \text{ 年} \leq N$	0
C 类基金份额	$N < 7$ 天	1.50%
	$7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天	0.75%
	$30 \text{ 天} \leq N < 6$ 个月	0.25%
	$N \geq 6$ 个月	0

注：N 为持有年限

4、针对 A 类基金份额：对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费应全额计入基金财产，其余不低于所收取的赎回费总额的 25% 归基金财产；针对 C 类基金份额：对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，不计入基金财产。其余用于支付市场推广费、注册登记费和其他必要的手续费。

5、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的费率或收费方式。基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前按规定在指定媒介上公告。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后对投资者适当调低基金申购费率、基金赎回费率、销售服务费，此项规定同样对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）业务适用。

（七）申购份额与赎回金额的计算

1、申购份额、余额的处理方式：场外申购 A、C 类份额时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，四舍五入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；场内申购 A 类份额时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，保留到整数位，不足一份基金份额部分的认购资金零头由交易所会员单位返还给投资者。

2、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以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、申购份额的计算

（1）前端收费模式

申购费用=申购金额-申购金额/(1+申购费率)

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额÷T 日基金份额净值

例：假定 T 日的 A 类基金份额净值为 1.100 元，申购金额为 1 万元，采用前端收费模式，申购费率为 1.5%，则需负担的申购费用和得到的基金份额为：

前端申购费用=10000-10000/(1+1.5%)=147.78 元

净申购金额=10000-147.78=9852.22 元

如果投资者（非养老金客户）是场外申购 A 类份额，可得到的申购份额为 8956.56 (=9852.22/1.100) 份；

如果投资者（非养老金客户）是场内申购 A 类份额，可得到的申购份额为 8956 份，剩余 0.62 元返还给投资者。

（2）后端收费模式

申购份额=申购金额/T 日基金份额净值

当投资者提出赎回时，后端认购费用的计算方法为：

后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率

例：假定 T 日的 A 类基金份额净值为 1.100 元，申购金额为 1 万元，采用后端收费模式，假定申购当日基金份额净值为 1.100 元，如果投资者是场外申购 A 类份额，可得到的申购份额为 9090.91 ($=10000/1.100$) 份；如果投资者是场内申购 A 类份额，可得到的申购份额为 9090 份，剩余 1.00 元返还给投资者。投资者在赎回时需根据其持有时间按对应的后端申购费率缴纳后端申购费用。

4、赎回金额的计算

投资者提交赎回申请时，其在销售机构(网点)必须有足够的基金份额余额。

(1) 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：

赎回总额=赎回份额×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

例：某投资者赎回 1 万份 A 类基金份额，持有时间大于 7 日小于 1 年，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类份额的基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额= $10000 \times 1.200 = 12000.00$ 元

赎回费用= $12000 \times 0.5\% = 60.00$ 元

赎回金额= $12000.00 - 60.00 = 11940.00$ 元

(2) 如果投资者在申购 A 类份额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=赎回份额×T 日基金份额净值

后端申购费用=赎回份额×申购日 A 类份额基金份额净值（基金份额面值）
×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

例：某投资者赎回 1 万份 A 类基金份额，持有时间大于 7 日小于 1 年，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.200 元，对应的后端申购费率为 1.8%，申购时的基金份额净值为 1.100 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10000×1.200=12000.00 元

后端申购费用=10000×1.100×1.8%=198.00 元

赎回费用=12000×0.5%=60.00 元

赎回金额=12000.00—198.00—60.00=11742.00 元

5、基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值=基金资产净值总额÷基金份额总数。

T 日的各类基金份额的基金份额净值计算均精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产所有或承担。T 日的各类基金份额的基金份额净值在当天收市后计算，并按基金合同的约定公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（八）申购与赎回的注册登记

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

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

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

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并依照《信息披露办法》的有关规定于开始实施前在中国证监会指定媒介上公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10%的情形。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个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；对于未能赎回部分，投资者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继续赎回，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。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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 本基金发生巨额赎回时，对单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请，基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动的，基金管理人有权对该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20% 以上的那部分赎回申请进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）接受全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(4) 当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并按规定编制临时报告书在指定媒介上公告。

3、暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付

赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时，基金管理人应当按规定编制临时报告书在指定媒介上公告。

(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

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

(2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

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

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

(6) 接受某笔或者某些申购申请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；

(7) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上且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情形。

发生上述情形之一，被拒绝的申购款项将全部退还投资者，发生上述（1）—（4）、（7）、（8）项情形时，基金管理人应根据有关规定将本基金暂停申购的情况在指定媒介上公告。基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。

在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并在指定媒介上公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

(2) 证券交易场所所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 连续 2 个或 2 个以上开放日发生巨额赎回，根据中国证监会和基金合同的有关规定，基金管理人可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

(5) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上且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、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应当按规定向中国证监会备案并在指定媒介上公告。

已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法予以支付。

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、暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定在指定媒介上公告。

(1) 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放申购或赎回日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值；

(2) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周（含 2 周），基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 1 个工作日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值；

(3) 如果发生暂停的时间超过 2 周，基金管理人应在暂停期间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，基金管理人应按规定在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

（十一）基金转换

本公司已开通了长信量化先锋混合基金 A 类份额（A 类代码：519983）与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）（非直销渠道）、长信银利精选混合基金 A 类前端份额（A 类前端代码：519997）、长信低碳环保量化股票基金 A 类份额（A 类代码：004925）、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信金利趋势混合基金 A 类前端份额（A 类前端代码：519995）、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、长信利丰债券基金 C 类份额（C 类代码：519989）、长信恒利优势混合基金、长信双利优选混合基金 A 类份额（A 类代码：519991）、长信内需成长混合基金 A 类份额（A 类代码：519979）、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金 A 类份额（A 类代码：519967）、长信量化多策略股票基金 A 类份额（A 类代码：519965）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金（非直销渠道）、长信多利混合基金 A 类份额（A 类代码：519959）、长信睿进混合基金、长信利保债券基金 A 类份额（A 类代码：519947）、长信利泰混合基金 A 类份额（A 类代码：519951）、长信利泰混合基金 C 类份额（C 类代码：007863）、长信先锐混合基金 A 类份额（A 类代码：519937）、长信利发债券基金、长信电子信息量化混合基金 A 类份额（A 类代码：519929）、长信利信混合基金 A 类份额（A 类代码：519949）、长信先优债券基金 A 类份额（A 类代码：004885）、长信中证 500 指数基金 A 类份额（A 类代码：004945）、长信乐信混合基金（非直销渠道）、长信创新驱动股票基金、长信合利混合基金、长信利率债债券基金、长信消费精选量化股票基金 A 类份额（A 类代码：004805）（非直销渠道）和长信价值优选混合基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

本公司已开通了长信量化先锋混合基金 C 类份额（C 类代码：004221）与长信长金通货币基金 A、B 级份额（A 类代码：005134；B 类代码：005135）、长信沪深 300 指数基金、长信国防军工量化混合基金、长信利信混合基金 C 类份额（C 类代码：007293）、长信利信混合基金 E 类份额（E 类代码：007294）、长

信稳益纯债债券基金、长信稳势纯债债券基金、长信纯债壹号债券基金 C 类份额（C 类代码：004220）、长信乐信混合基金（直销渠道）、长信利丰债券基金 A 类份额（A 类代码：005991）、长信利丰债券基金 E 类份额（E 类代码：004651）、长信消费精选量化股票基金 A 类份额（A 类代码：004805）（直销渠道）、长信量化多策略股票基金 C 类份额（C 类代码：004858）、长信稳健纯债债券基金、长信双利优选混合基金 E 类份额（E 类代码：006396）、长信内需成长混合基金 E 类份额（E 类代码：006397）、长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）（直销渠道）、长信易进混合基金、长信利保债券基金 C 类份额（C 类代码：008176）、长信利泰混合基金 E 类份额（E 类代码：008071）、长信利广混合基金（直销渠道）、长信量化价值驱动混合基金、长信稳健精选混合基金、长信消费升级混合基金、长信优质企业混合基金、长信内需均衡混合基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合基金、长信 30 天滚动持有短债债券基金、长信稳丰债券基金、长信稳惠债券基金、长信低碳环保量化股票基金 C 类份额（C 类代码：013151）、长信中证 500 指数基金 C 类份额（C 类代码：013881）、长信消费精选量化股票基金 C 类份额（C 类代码：013152）、长信电子信息量化混合基金 C 类份额（C 类代码：013153）、长信医疗保健混合（LOF）基金 C 类份额（C 类代码：013154）、长信多利混合基金 C 类份额（C 类代码：013488）、长信利富债券基金 C 类份额（C 类代码：013558）、长信银利精选混合基金 C 类份额（C 类代码：014572）、长信金利趋势混合基金 C 类份额（C 类代码：015039）、长信先进装备三个月持有混合基金、长信企业优选一年持有混合基金、长信稳健成长混合基金、长信稳航 30 天持有中短债债券基金、长信稳恒债券基金、长信中证科创创业 50 指数增强基金、长信稳健增长一年持有混合基金、长信中证 1000 指数增强基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

投资人可将长信量化先锋混合基金 C 类份额（C 类代码：004221）转换至长信企业成长三年持有混合基金、长信均衡策略一年持有混合基金、长信均衡优选混合基金，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

根据中国证监会[2009]32号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，本公司从2010年4月23日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下：

(1) 投资者进行基金转换时，转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

(2) 转换份额的计算公式：

A、非货币基金之间转换

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零)

B、货币基金转至非货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益

补差费=转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(货币基金份额净值为1.00元，没有赎回费)

C、非货币基金转至货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-赎回费

转入确认份额=转入确认金额÷货币基金份额净值

(货币基金份额净值为1.00元，补差费为零)

（十二）定期定额投资计划

定期定额投资计划，是指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。

本基金已开通定期定额投资业务，具体可办理定期定投投资业务的渠道详见本公司的相关公告。

（十三）基金的非交易过户与转托管

1、非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行，以及基金注册登记机构认可的其他行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

（1）“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。

（2）“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其他具有社会公益性质的社会团体。

（3）“司法强制执行”是指司法机关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

2、基金注册登记机构可以办理上述非交易过户，具体以其业务规则为准。办理非交易过户业务的投资者必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，直接向基金注册登记机构或其指定的机构申请办理。

3、转托管

基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照其业务规则规定的标准收取转托管费。基金份额从场外转至场内或从场内转至场外的流程按照《开放式基金通过上交所场内交易业务实施细则》等相关规定办理。

（十四）基金份额的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

（十五）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“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

九、基金的投资

（一）投资目标

本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，债券、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的 5%-40%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的 80%。

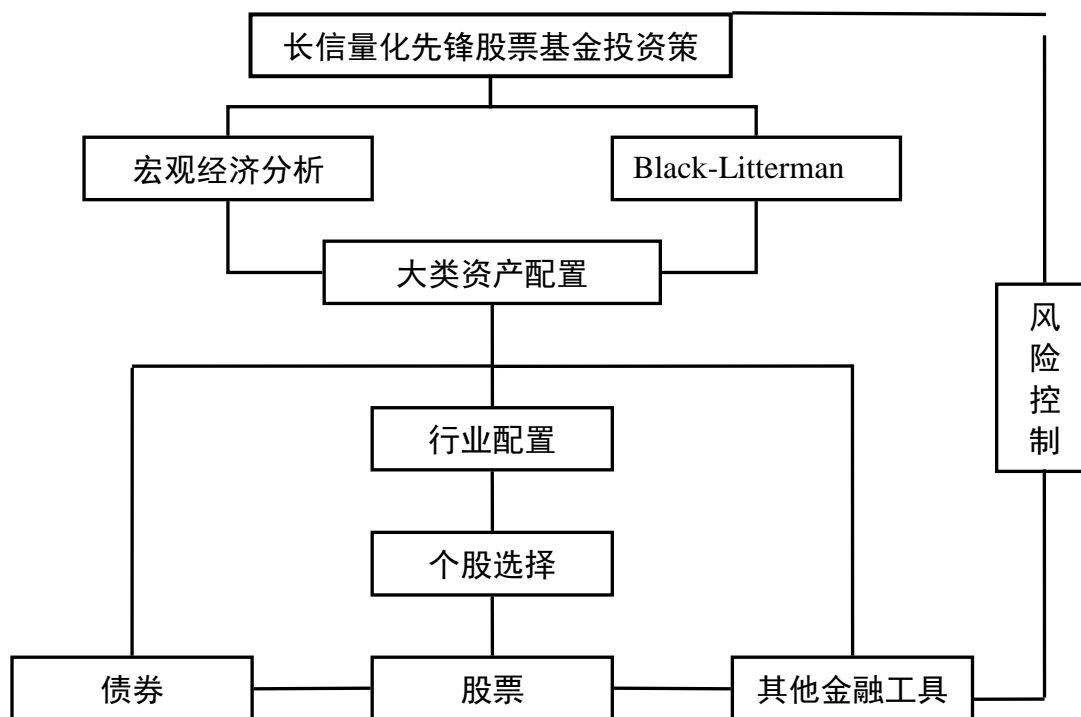
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（三）投资策略

本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，并利用数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股选择全程数量化的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。

本基金的投资策略包括两部分：一是通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化整个组合的风险收益参数；二是通过自下而上的上市公司研究，借助长信行业多因素选股模型选取具有投资价值的上市公司股票。

本基金投资策略的基本框架如下：



图：本基金投资策略基本框架

1、大类资产配置策略

本基金采用“自上而下”的资产配置方法，运用在国际资产配置决策领域广泛应用的 Black-Litterman 模型确定本基金资产在股票、债券及其他金融工具等类别资产间的分配比例。在具体的资产配置过程中，通过把握宏观经济增长的长期趋势，短期的经济周期波动以及政策导向，判断各类资产的风险程度和收益特征，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的比例，以达到控制风险、增加收益的目的。

2、股票投资策略

本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的数量化选股策略，在纪律化模型约束下，紧密跟踪策略，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，从而取得较高的收益。

(1) 行业配置

本基金所构建的股票投资组合在行业配置方面仍然采用 Black-Litterman 模型确定各行业的投资权重。Black-Litterman 模型基于市场均衡状态下各行业隐含的超额收益率和市场权重，融入基金管理人对各行业的预期收益观点，在基金整体风险水平可控的前提下，实现各行业的合理配置和优化。

具体来讲，由于本基金的行业划分采用申银万国一级行业分类体系，因此 23 个一级行业隐含的超额收益率及市场权重可由各行业历史收益率以及当前的市值权重计算得出。此外，基金管理人通过上中下游行业跟踪分析、积极型行业和防御型行业轮动特点的趋势研究，形成本基金行业配置量化的预期收益观点。最后，Black-Litterman 模型采用贝叶斯方法把隐含的超额收益率和观点收益结合起来，对均衡的市场权重进行调节，使得组合达到最优的预期风险收益。

本基金将结合 Black-Litterman 模型给出的行业配置权重，确定股票组合中每只股票的配置比例。

（2）个股选择

本基金在确定行业配置权重后运用长信行业多因素选股模型进行个股的选择。个股选择分为股票库的建立和个股的精选两个部分。

A、股票库的建立

本基金利用反映估值水平的财务指标对全部 A 股上市公司股票进行筛选，通过对估值指标（PE、PB、PCF 等）为负值或异常值的股票的剔除，构建本基金股票库。本基金股票库定期进行调整，原则上每三个月调整一次。

B、个股精选

考虑到二级市场业绩驱动的复杂性，长信行业多因素选股模型基于对申银万国一级行业运行特征的长期跟踪研究以及大量历史数据的实证检验，选取出对 A 股股价具有较强影响的四类因子，分别是价值因子、成长因子、基本面因子和市场因子。

价值因子考虑市盈率（PE）、市净率（PB）、市现率（PCF）、股息率、净资产收益率（ROE）等指标；

成长因子考虑主营收入增长率、净利润增长率、预期每股收益（EPS）、预期每股收益（EPS）增长率、PEG 等指标；

基本面因子考虑销售毛利率、息税前利润/营业总收入、营业总成本/营业总收入、总资产周转率等指标；

市场因子考虑个股收益率的动量和反转等指标。

长信行业多因素选股模型通过对个股历史数据及一致预期数据的实证检验以及对行业景气周期的考量，利用聚类分析、横截面数据与面板数据分析、遗传算法等量化技术考察上述四类因子对申银万国一级行业分类体系下各行业的影响，从而确定行业内部各因子的重要性顺序，并按照此顺序对各行业股票进行分步筛选来确定股票投资名单。当股票投资组合名单及行业配置权重确定后，本基金将通过个股权重的优化来构建本基金股票资产的投资组合。其中，优化权重的目标是使股票投资组合的风险调整后收益最大化。当股票投资组合构建完成后，基金管理人会进一步根据组合内个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期优化个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。

（3）存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

3、债券投资策略

本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

4、权证投资策略

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证，投资原则为有利于基金资产增值和加强基金风险控制。权证的选择是一个全面综合考虑的过程，本基金对权证的投资将以控制投资风险为主，适当采用以下方式进行投资。

（1）通过对权证标的证券的基本面研究，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值并结合期权定价模型估计权证价值；

（2）在对权证价值分析的基础上，根据权证的溢价率和隐含波动率等指标，

寻找溢价率低的权证，降低风险和提高潜在的收益；

(3) 在考虑权证价值、溢价率、隐含波动率的基础上，重点考察权证的流动性风险，使其流动性与基金的规模相匹配，进行合理的配置。

(四) 业绩比较基准

1、本基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准为中证综合债券指数，本基金的业绩比较基准为复合指数：

沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%

若未来市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告。

2、选择业绩比较基准的理由

沪深 300 指数是国内股票市场广受投资者关注的市场指数之一，指数本身对国内股票市场的走势有很强的代表性和广泛的影响力，可以较好地表征市场平均收益水平。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，因此该指数是本基金较为切合的市场基准选择。

(五) 风险收益特征

2015 年 8 月 7 日起本基金更名为长信量化先锋混合型证券投资基金，本基金的风险收益特征由“本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。”改为“本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。”

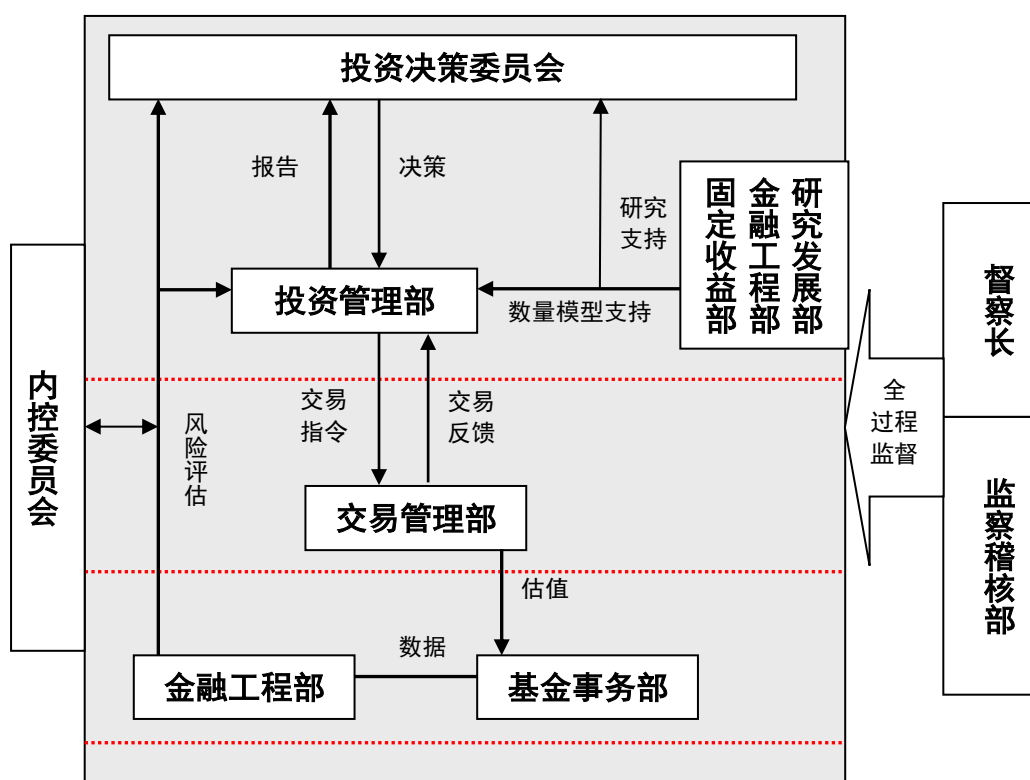
(六) 决策依据

1、国家有关法律法规和基金合同的有关规定；

- 2、宏观经济形势及前景、有关政策趋向对证券市场的影响等；
- 3、国家财政政策、货币政策、产业政策，以及利率走势、通货膨胀预期等；
- 4、股票、债券、衍生产品等类别资产的预期收益率及风险水平；
- 5、严格的数量化投资策略。

(七) 投资管理流程

本基金采用投资决策委员会指导下的基金经理负责制，具体的投资管理流程如下图所示：



图：本基金投资管理流程

1、固定收益部、研究发展部向投资决策委员会和投资管理部提交有关宏观经济分析、投资策略、债券分析等各类研究报告和投资建议，为投资运作提供决策支持；

2、金融工程部数量研究员进行量化研究，设计出资产配置模型和个股选择

模型，并根据行业研究员基本面研究成果以及对宏观经济形式、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等因素进行综合分析，定期对模型进行修正，为投资组合的构建提供重要依据；

3、投资管理部根据数量模型、研究团队的报告和对市场的判断，在遵守投资决策委员会制定的投资原则的前提下，向投资决策委员会提交基金的投资策略和资产配置建议；

4、投资决策委员会在认真分析数量模型、研究团队所提供的研究报告和投资管理部的投资策略草案后，确定公司所管理的基金资产的投资战略、投资方向，形成决策，并以投资决议形式下达给投资管理部执行；

5、投资管理部根据投资决策委员会的投资决策，结合研究人员提供的投资建议、自己的研究与分析判断以及每日基金申购和赎回的净现金流量和市场整体情况、投资组合和个股的流动性变化，在授权范围内制订具体的投资组合及操作方案，交由交易管理部执行；

6、交易管理部主要是根据基金经理的投资指令，进行基金资产的日常交易活动，对交易情况及时反馈，并对投资指令进行监督，遇有异常情况要及时向投资总监反映；同时对投资指令合规性检查；

7、金融工程部的风险与业绩评估人员定期对基金投资组合进行业绩和风险评估，提供基金业绩评估报告，提出风险控制意见，作为投资决策委员会调整风险控制策略和评估投资业绩的参考；

8、监察稽核部负责监督整个投资交易全过程是否有违反国家相关法律、法规和规章制度的规定，检查有无涉嫌内幕交易、侵犯持有人权益的行为；

9、投资管理部对整体投资组合及资金运用进行日常跟踪、分析，并根据市场变化、实际交易情况及研究发展部的追踪研究，在其权限范围内及时调整投资组合；

10、投资管理部在确保基金持有人利益的前提下，有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

（八）投资限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金资产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 3、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- 4、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- 5、本基金现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；
- 6、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- 7、本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- 8、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- 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、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- 11、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%；

12、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；

13、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

14、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；

15、本基金投资流通受限证券时，遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字【2006】141号）及相关规定；

16、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

17、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，法律法规或监管机构另有规定的，从其规定；

18、如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，除上述第5、7、12、14项外，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种，投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

(九) 投资禁止行为与限制

禁止用本基金财产从事以下行为

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

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(十) 基金管理人代表基金行使股东和债权人权利的处理原则及方法

- 1、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或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(十一) 基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的法律法规和政策的規定进行融资融券。

(十二) 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，无需召开基金份额持有人大会审议。

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“侧袋机制”章节的规定。

十、基金投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月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截至 2022 年 12 月 31 日（摘自本基金 2022 年年度报告），本报告中所列财务数据经审计。

(1) 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	578,706,027.95	93.28
	其中：股票	578,706,027.95	93.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,500,427.67	5.56
	其中：债券	34,500,427.67	5.56
	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	4,937,257.09	0.80
8	其他各项资产	2,267,701.00	0.37
9	合计	620,411,413.71	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

(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

金额单位：人民币元

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	28,736,283.00	4.66
B	采矿业	36,671,044.00	5.95
C	制造业	407,467,081.29	66.09

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,686,678.00	1.73
E	建筑业	3,496,712.00	0.57
F	批发和零售业	9,306,732.00	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	1,607,200.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,406,319.56	2.01
J	金融业	41,296,503.00	6.70
K	房地产业	6,275,226.00	1.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,111,430.40	2.29
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,606,535.00	1.07
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	578,706,027.95	93.87

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

(3) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300856	科思股份	208,800	10,888,920.00	1.77
2	688063	派能科技	33,800	10,668,970.00	1.73
3	688556	高测股份	138,820	10,414,276.40	1.69
4	600919	江苏银行	1,388,800	10,124,352.00	1.64
5	002938	鹏鼎控股	358,800	9,845,472.00	1.60
6	600256	广汇能源	1,088,800	9,820,976.00	1.59
7	002594	比亚迪	37,800	9,713,466.00	1.58
8	603309	维力医疗	478,800	9,566,424.00	1.55
9	601231	环旭电子	588,823	9,556,597.29	1.55
10	688559	海目星	164,400	9,508,896.00	1.54
11	603876	鼎胜新材	218,800	8,979,552.00	1.46
12	300570	太辰光	618,800	8,947,848.00	1.45
13	300498	温氏股份	453,100	8,894,353.00	1.44
14	600481	双良节能	658,800	8,524,872.00	1.38
15	688518	联赢激光	288,800	8,435,848.00	1.37

16	002459	晶澳科技	138,827	8,342,114.43	1.35
17	002318	久立特材	498,800	8,300,032.00	1.35
18	601012	隆基绿能	194,300	8,211,118.00	1.33
19	603259	药明康德	98,800	8,002,800.00	1.30
20	002831	裕同科技	238,800	7,897,116.00	1.28
21	000810	创维数字	555,600	7,745,064.00	1.26
22	600926	杭州银行	588,800	7,701,504.00	1.25
23	300910	瑞丰新材	61,800	7,620,558.00	1.24
24	600438	通威股份	192,600	7,430,508.00	1.21
25	300750	宁德时代	18,800	7,396,296.00	1.20
26	688800	瑞可达	68,800	7,339,584.00	1.19
27	688778	厦钨新能	93,800	7,286,384.00	1.18
28	605117	德业股份	21,800	7,220,160.00	1.17
29	300761	立华股份	209,800	7,185,650.00	1.17
30	002839	张家港行	1,550,600	7,148,266.00	1.16
31	301035	润丰股份	79,844	6,954,412.40	1.13
32	000983	山西焦煤	595,500	6,937,575.00	1.13
33	600188	兖矿能源	198,800	6,675,704.00	1.08
34	300502	新易盛	278,800	6,621,500.00	1.07
35	603129	春风动力	58,800	6,616,176.00	1.07
36	002273	水晶光电	558,800	6,588,252.00	1.07
37	300244	迪安诊断	261,300	6,566,469.00	1.07
38	002649	博彦科技	634,800	6,532,092.00	1.06
39	600901	江苏租赁	1,191,500	6,529,420.00	1.06
40	002714	牧原股份	131,400	6,405,750.00	1.04
41	603612	索通发展	245,800	6,395,716.00	1.04
42	002100	天康生物	761,400	6,327,234.00	1.03
43	000811	冰轮环境	568,800	6,313,680.00	1.02
44	603600	永艺股份	643,400	6,273,150.00	1.02
45	002124	天邦食品	1,023,000	6,250,530.00	1.01
46	601717	郑煤机	558,800	6,236,208.00	1.01
47	002085	万丰奥威	1,036,300	6,165,985.00	1.00
48	603127	昭衍新药	104,300	6,092,163.00	0.99
49	601857	中国石油	1,188,800	5,908,336.00	0.96
50	601869	长飞光纤	178,892	5,837,245.96	0.95
51	300628	亿联网络	95,900	5,810,581.00	0.94
52	600008	首创环保	2,049,200	5,799,236.00	0.94
53	688082	盛美上海	72,460	5,789,554.00	0.94
54	688196	卓越新能	98,800	5,732,376.00	0.93
55	300532	今天国际	391,000	5,661,680.00	0.92
56	601699	潞安环能	328,900	5,541,965.00	0.90
57	600210	紫江企业	1,097,500	5,487,500.00	0.89
58	600873	梅花生物	510,700	5,198,926.00	0.84
59	605138	盛泰集团	480,800	5,173,408.00	0.84

60	002965	祥鑫科技	88,800	5,169,048.00	0.84
61	002937	兴瑞科技	222,800	5,046,420.00	0.82
62	603408	建霖家居	458,800	4,982,568.00	0.81
63	000726	鲁泰A	666,600	4,919,508.00	0.80
64	600795	国电电力	1,144,600	4,887,442.00	0.79
65	300363	博腾股份	116,500	4,759,025.00	0.77
66	002422	科伦药业	178,800	4,757,868.00	0.77
67	000001	平安银行	358,800	4,721,808.00	0.77
68	600665	天地源	1,267,000	4,675,230.00	0.76
69	002705	新宝股份	278,500	4,637,025.00	0.75
70	300450	先导智能	110,800	4,459,700.00	0.72
71	600697	欧亚集团	293,000	4,096,140.00	0.66
72	002957	科瑞技术	268,800	4,066,944.00	0.66
73	600732	爱旭股份	107,400	4,061,868.00	0.66
74	002966	苏州银行	509,850	3,966,633.00	0.64
75	603086	先达股份	296,284	3,878,357.56	0.63
76	603035	常熟汽饰	172,700	3,669,875.00	0.60
77	688037	芯源微	23,284	3,643,946.00	0.59
78	002371	北方华创	15,800	3,559,740.00	0.58
79	002484	江海股份	158,826	3,552,937.62	0.58
80	600710	苏美达	604,200	3,552,696.00	0.58
81	688012	中微公司	35,800	3,508,758.00	0.57
82	600284	浦东建设	518,800	3,496,712.00	0.57
83	600660	福耀玻璃	92,900	3,258,003.00	0.53
84	603529	爱玛科技	65,800	3,018,246.00	0.49
85	600741	华域汽车	170,200	2,949,566.00	0.48
86	002478	常宝股份	488,800	2,751,944.00	0.45
87	601137	博威合金	168,800	2,499,928.00	0.41
88	688599	天合光能	38,000	2,422,880.00	0.39
89	002738	中矿资源	30,600	2,039,796.00	0.33
90	600389	江山股份	41,000	1,807,280.00	0.29
91	600583	海油工程	294,800	1,786,488.00	0.29
92	301193	家联科技	50,800	1,681,988.00	0.27
93	688390	固德威	5,200	1,680,068.00	0.27
94	603368	柳药集团	88,800	1,657,896.00	0.27
95	300389	艾比森	188,800	1,648,224.00	0.27
96	600233	圆通速递	80,000	1,607,200.00	0.26
97	002244	滨江集团	181,200	1,599,996.00	0.26
98	002533	金杯电工	239,700	1,450,185.00	0.24
99	002391	长青股份	194,000	1,363,820.00	0.22
100	002756	永兴材料	13,800	1,271,946.00	0.21
101	688312	燕麦科技	71,300	1,105,863.00	0.18
102	601009	南京银行	106,000	1,104,520.00	0.18
103	603556	海兴电力	58,800	1,034,880.00	0.17

104	002050	三花智控	38,800	823,336.00	0.13
105	300684	中石科技	47,000	696,070.00	0.11
106	688392	骄成超声	2,745	368,571.15	0.06
107	002518	科士达	6,000	345,600.00	0.06
108	688475	萤石网络	12,315	319,327.95	0.05
109	688332	中科蓝讯	3,580	179,751.80	0.03
110	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.03
111	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.02
112	688416	恒烁股份	2,147	79,460.47	0.01
113	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.01
114	301269	华大九天	621	54,610.74	0.01
115	301095	广立微	629	54,402.21	0.01
116	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.01
117	301308	江波龙	705	39,987.60	0.01
118	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.01
119	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
120	301165	锐捷网络	754	23,833.94	0.00
121	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
122	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
123	301356	天振股份	436	18,891.88	0.00
124	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
125	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
126	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
127	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
128	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
129	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
130	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
131	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
132	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
133	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
134	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
135	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
136	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
137	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
138	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
139	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
140	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
141	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
142	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
143	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
144	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
145	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
146	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00

(4) 报告期内股票投资组合的重大变动

1、累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300073	当升科技	31,666,710.00	3.49
2	600188	兖矿能源	28,231,973.00	3.11
3	605117	德业股份	27,823,873.00	3.07
4	300481	濮阳惠成	26,846,303.92	2.96
5	300750	宁德时代	26,148,202.92	2.88
6	600438	通威股份	25,993,078.91	2.86
7	000983	山西焦煤	24,792,823.10	2.73
8	000810	创维数字	24,521,409.42	2.70
9	601872	招商轮船	24,512,084.13	2.70
10	600481	双良节能	24,387,351.43	2.69
11	688063	派能科技	24,104,430.19	2.66
12	600499	科达制造	24,090,909.94	2.66
13	600039	四川路桥	23,830,217.00	2.63
14	688559	海目星	23,193,655.75	2.56
15	601231	环旭电子	21,840,427.86	2.41
16	603290	斯达半导	21,556,806.96	2.38
17	603259	药明康德	21,256,299.42	2.34
18	688518	联赢激光	21,026,750.14	2.32
19	300260	新莱应材	20,768,808.03	2.29
20	300363	博腾股份	20,097,810.00	2.21
21	002801	微光股份	19,687,625.55	2.17
22	603456	九洲药业	19,612,030.24	2.16
23	300244	迪安诊断	19,592,364.00	2.16
24	603236	移远通信	19,296,732.00	2.13
25	603613	国联股份	18,751,751.00	2.07
26	600873	梅花生物	18,408,796.69	2.03
27	600732	爱旭股份	18,397,600.52	2.03
28	002166	莱茵生物	18,392,752.06	2.03
29	688037	芯源微	18,241,994.19	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

2、累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601615	明阳智能	30,930,108.00	3.41

2	601872	招商轮船	27,623,632.18	3.04
3	600089	特变电工	26,933,373.84	2.97
4	300073	当升科技	26,868,207.00	2.96
5	603217	元利科技	26,370,755.40	2.91
6	000977	浪潮信息	25,409,859.90	2.80
7	300481	濮阳惠成	25,231,030.01	2.78
8	300260	新莱应材	24,229,462.90	2.67
9	002049	紫光国微	23,929,727.93	2.64
10	000498	山东路桥	23,835,335.01	2.63
11	603688	石英股份	23,812,268.78	2.62
12	601668	中国建筑	23,748,420.00	2.62
13	600765	中航重机	23,675,679.98	2.61
14	600039	四川路桥	22,905,116.00	2.52
15	601666	平煤股份	22,736,886.50	2.51
16	603613	国联股份	22,639,938.20	2.50
17	603290	斯达半导	22,414,790.00	2.47
18	600481	双良节能	22,372,485.33	2.47
19	000933	神火股份	21,889,531.88	2.41
20	300244	迪安诊断	21,738,577.00	2.40
21	002801	微光股份	21,285,361.75	2.35
22	688122	西部超导	21,135,170.95	2.33
23	688516	奥特维	21,066,001.64	2.32
24	688037	芯源微	21,024,986.46	2.32
25	603668	天马科技	20,796,226.40	2.29
26	600188	兖矿能源	20,596,461.31	2.27
27	300750	宁德时代	20,438,756.00	2.25
28	688005	容百科技	20,344,307.85	2.24
29	600256	广汇能源	20,172,176.38	2.22
30	688099	晶晨股份	20,007,498.26	2.21
31	600499	科达制造	19,888,985.00	2.19
32	603456	九洲药业	19,697,531.00	2.17
33	000733	振华科技	19,542,657.35	2.15
34	000519	中兵红箭	18,853,533.80	2.08
35	600438	通威股份	18,817,850.00	2.07
36	002648	卫星化学	18,628,572.97	2.05
37	000983	山西焦煤	18,622,221.70	2.05
38	600057	厦门象屿	18,179,436.08	2.00

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

3、买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,442,054,632.05
卖出股票收入（成交）总额	3,507,471,898.97

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

(5) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	34,500,427.67	5.60
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	34,500,427.67	5.60

(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五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	338,170	34,500,427.67	5.60

(7) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(9) 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

本基金本报告期末未持有权证。

(10) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

(11) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

(12) 投资组合报告附注

1、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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体江苏银行股份有限公司于2022年12月5日收到江苏证监局关于对江苏银行股份有限公司采取责令改正措施的决定（〔2022〕114号），经查，江苏银行基金销售业务存在以下问题：一、零售业务部和网络金融部均负责基金销售业务，但未对基金销售产品实行集中统一准入管理，违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第175号）第二十七条的规定；二、部分基金销售业务人员未取得基金从业资格，违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第175号）第三十条的规定；三、存在向普通投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或服务的情况，违反了《证券期货投资者适当性管理办法》（证监会令第177号）第二十二条的规定。依据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第175号）第五十三条、《证券期货投资者适当性管理办法》（证监会令第177号）第三十七条的规定，江苏证监局决定对江苏银行采取责令改正的的行政监督管理措施。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余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。

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

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	196,855.06
2	应收清算款	1,795,782.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	275,063.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,267,701.00

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，分项之和与合计项可能存在尾差。

十一、基金的业绩

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

2022 年度及历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

长信量化先锋混合 A

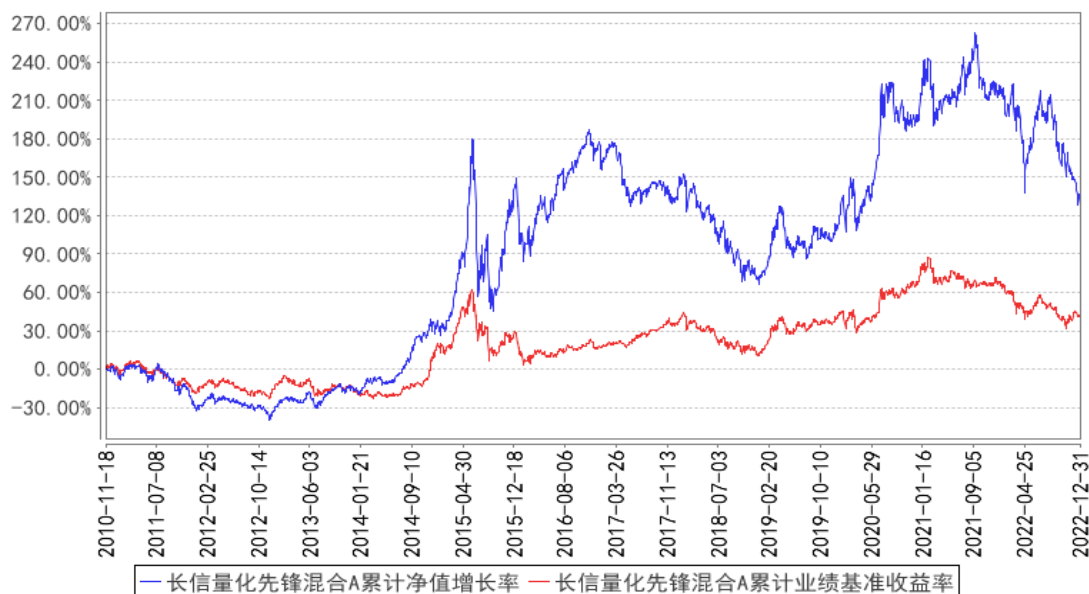
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2010 年 11 月 18 日- 2010 年 12 月 31 日	-1.40%	0.77%	0.69%	1.02%	-2.09%	-0.25%
2011 年	-27.89%	1.33%	-18.00%	0.98%	-9.89%	0.35%
2012 年	-0.42%	1.19%	6.95%	0.96%	-7.37%	0.23%
2013 年	19.92%	1.16%	-5.48%	1.05%	25.40%	0.11%
2014 年	57.83%	1.14%	40.36%	0.91%	17.47%	0.23%
2015 年	84.03%	2.73%	7.71%	1.86%	76.32%	0.87%
2016 年	10.52%	1.64%	-7.69%	1.05%	18.21%	0.59%
2017 年	-13.74%	0.89%	16.11%	0.48%	-29.85%	0.41%
2018 年	-27.59%	1.47%	-17.72%	1.00%	-9.87%	0.47%
2019 年	25.52%	1.32%	27.90%	0.93%	-2.38%	0.39%
2020 年	41.89%	1.65%	21.26%	1.07%	20.63%	0.58%
2021 年	6.15%	1.33%	-2.39%	0.88%	8.54%	0.45%
2022 年	-26.76%	1.52%	-15.70%	0.96%	-11.06%	0.56%

长信量化先锋混合 C

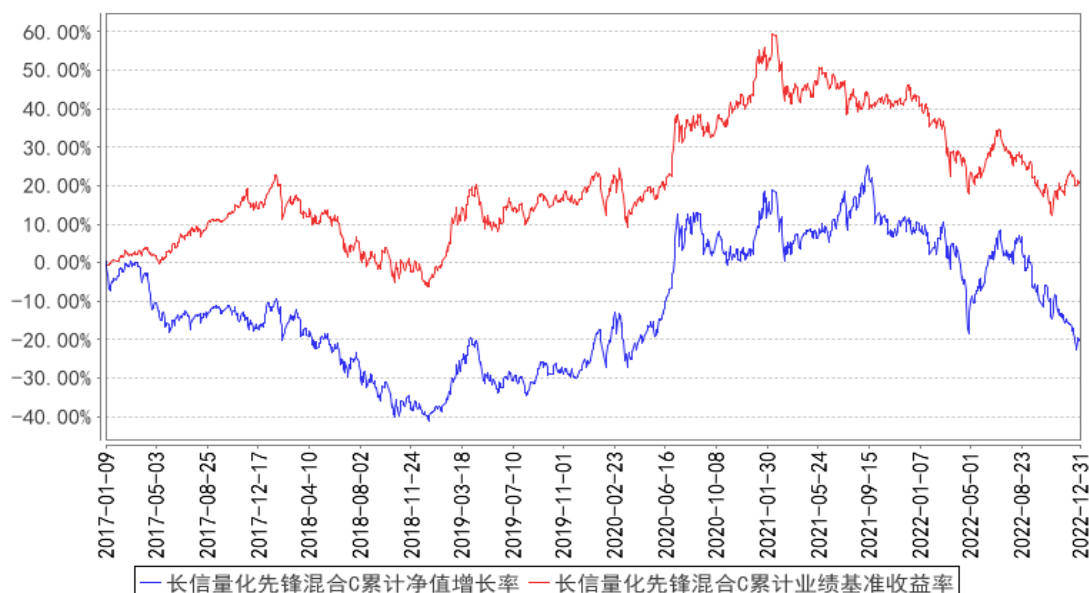
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2017 年 1 月 9 日 (份额增 加日)- 2017 年 12 月 31 日	-15.71%	0.89%	15.14%	0.48%	-30.85%	0.41%
2018 年	-28.49%	1.48%	-17.72%	1.00%	-10.77%	0.48%
2019 年	24.24%	1.31%	27.90%	0.93%	-3.66%	0.38%
2020 年	40.44%	1.65%	21.26%	1.07%	19.18%	0.58%
2021 年	5.12%	1.33%	-2.39%	0.88%	7.51%	0.45%
2022 年	-27.50%	1.52%	-15.70%	0.96%	-11.80%	0.56%

自合同生效之日/份额增加日至 2022 年 12 月 31 日期间，本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比：

长信量化先锋混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信量化先锋混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、长信量化先锋混合 A 图示日期为 2010 年 11 月 18 日至 2022 年 12 月 31 日，长信量化先锋混合 C 图示日期为 2017 年 1 月 9 日（份额增加日）至 2022 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金各项投资比例符合基金合同中的约定。

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴存的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购基金款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构自有的财产账户

以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

（四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

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

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

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

十三、基金资产的估值

（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

基金所拥有的股票、存托凭证、债券和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

（四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的权益类证券（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以及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、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

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

（2）首次公开发行未上市的股票和权证，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、流通受限股票的估值

发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、交易所市场交易的固定收益品种（指国债、企业债、公司债、可转换债券、中小企业私募债、资产支持证券等，下同）的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后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以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日收盘价减去可转换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；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

5、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、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。

8、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

9、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。

10、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。

（五）估值程序

基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。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或其他方式报给基金托管人，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。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、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 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基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；
- 4、出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的情形时；
- 5、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 6、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（七）基金净值的确认

基金资产净值与基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金净值信息并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致任一类基金份额净值小数点后三位内（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过该类基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代理销售机构或投资者自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，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。

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无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失、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。

3、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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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差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直接损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

4、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，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

(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的交易数据的，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；

(5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到或超过该类基金份额净值的0.25%时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应通报基金托管人，按基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

(九) 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净值信息，暂停披露侧袋账户的基金净值信息。

(十) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法第9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、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人及基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十四、基金收益与分配

（一）收益的构成

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

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

（二）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为相应类别的基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；

2、同一类别每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配 6 次，每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 30%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配（可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数）；

4、基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案至少应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（四）收益分配的时间和程序

1、基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；

2、在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

（五）收益分配中发生的费用

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。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除息日除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。

（六）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“侧袋机制”章节的规定。

十五、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的销售服务费；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- 8、基金银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费率为年费率 1.20%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，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，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，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，基金托管人复核无误后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费率年费率为 1.00%。

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的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基金销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中支付到指定账户。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

（三）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财产的损失，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。

基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按规定在指定媒介上公告。

（五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

（六）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，其他费用详见本招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。

（七）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。

十六、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。基金首次募集的会计年度按如下原则：如果当年基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度。

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计制度按国家有关的会计制度执行。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、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财务报表及其他规定事项进行审计；

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意；

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。基金管理人应在更换会计师事务所后按《信息披露办法》等有关规定在指定媒介上公告。

十七、基金的信息披露

（一）披露原则

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。

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”）和指定互联网网站（以下简称“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）等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，应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承诺在公开披露基金信息的过程中不得有下列行为：

- 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份额发售机构；
- 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。

（二）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、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议

(1)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。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、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，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在指定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金招募说明书、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，基金管理人可以不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

(2)《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。

(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。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露

招募说明书的当日登载于指定媒介上。

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、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前，基金管理人应

当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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的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的基金份额净值和基金份额累计净值。

5、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者营业网点查阅或者复制前述信息资料。

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告（含资产组合季度报告）

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，将年度报告登载于指定网站上，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。

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“影响投资者决

策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当按规定编制临时报告书，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；
- (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；
- (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；
- (11) 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；
- (12) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- (13) 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；
- (14) 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；

- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 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；
- (17) 某一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 更换基金注册登记机构；
- (20) 本基金开始办理申购、赎回；
- (21) 本基金发生巨额赎回并延期办理；
- (22) 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；
- (23) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- (24) 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；
- (25) 调整本基金份额类别设置；
- (26) 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。

8、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。

9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

10、清算报告

基金合同出现终止情形的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小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。

11、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“侧袋机制”章节的规定。

12、中国证监会规定的其他信息。

（三）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披露信息的报刊。

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，基金管理人应当自中国证监会规定之日起，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。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中

国证监会相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

（四）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，以供社会公众查阅、复制。

十八、侧袋机制

（一）侧袋机制的实施条件、实施程序和特定资产范围

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，无需召开基金份额持有人大会。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。

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。

（二）侧袋机制实施期间的基金运作安排

1、基金份额的申购与赎回

（1）侧袋账户

侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户的申购、赎回和转换。基金份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

（2）主袋账户

基金管理人将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事项，具体事项届时将由基金管理人在相关公告中规定。

（3）当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并暂停接受基金申购赎回申请或延缓支付赎回款项。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，基金管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制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。

2、基金份额的登记

侧袋机制实施期间，基金管理人应对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原基金代码，侧袋账户使用独立的基金代码。侧袋账户份额的名称以“基金简称+侧袋标识 S+侧袋账户建立日期”格式设定，同时主袋账户份额的名称增加大写字母 M 标识作为后缀。基金所有侧袋账户注销后，将取消主袋账户份额名称中的 M 标识。

启用侧袋机制当日，基金管理人和基金登记机构应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

侧袋账户资产完全清算后，基金管理人将注销侧袋账户。

3、基金的投资及业绩

侧袋机制实施期间，本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。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。

基金管理人、相关服务机构在展示基金业绩时，应当就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

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，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

4、基金的估值

侧袋机制启用当日，基金管理人以完成日终估值后的基金净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割，与特定资产可明确对应的资产类科目余额、除应交税费外的负债类科目余额一并纳入侧袋账户。基金管理人应将特定资产作为一个整体，不能仅分割其公允价值无法确定的部分。

侧袋机制实施期间，基金管理人将对侧袋账户单独设置账套，实行独立核算。如果本基金同时存在多个侧袋账户，不同侧袋账户分开进行核算。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

5、基金的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。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。

基金管理人可以待侧袋账户资产变现后将与处置侧袋账户资产相关的费用从侧袋账户中列支。

6、基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

7、基金的信息披露

(1) 基金净值信息

侧袋机制实施期间，基金管理人应当暂停披露侧袋账户的基金份额净值和基金份额累计净值。

(2) 定期报告

侧袋机制实施期间，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：

- 1) 侧袋账户的基金代码、基金名称、侧袋账户成立日期等基本信息；
- 2) 侧袋账户的初始资产、初始负债；
- 3) 特定资产的名称、代码、发行人等基本信息；
- 4) 报告期内的特定资产处置进展情况、与处置特定资产相关的费用情况及其他与特定资产状况相关的信息；
- 5) 可根据特定资产处置进展情况披露特定资产的可变现净值或净值参考区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺；
- 6) 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。

(3) 临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、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应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间，

若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按规定及时发布临时公告。

8、特定资产处置清算

基金管理人将按照基金份额持有人利益最大化原则制定变现方案，将侧袋资产处置变现。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应及时向侧袋账户对应的基金份额持有人支付已变现部分对应款项。

9、侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《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，具体如下：

基金管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

基金管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内，聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本基金持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期间基金侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，基金管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

（三）本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

十九、风险揭示

基金份额持有人须了解并承受以下风险：

（一）风险揭示

1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

（2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

（3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

（4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

（5）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金财产损失。

3、债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动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。

4、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，将获得较少的收益率。

5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

本基金拟投资市场、行业及资产具有较好的流动性，与基金合同约定的申购赎回安排相匹配，能够支持不同市场情形下投资者的赎回要求。本基金主要的流动性风险为投资者可能会面临因巨额赎回带来的流动性风险。若是由于投资者大量赎回而导致基金管理人被迫抛售持有投资品种以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，在巨额赎回发生时采取备用的流动性风险管理应对措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

（1）基金申购、赎回安排

本基金申购赎回的具体安排可见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节。

（2）拟投资市场的流动性风险评估

本基金主要投资于国内具有良好流动性的金融工具。随着我国股票、债券市场交易机制的逐步完善、投资者结构的优化、信息披露相关法律法规的推出，我国的股票和债券市场已经具备较好的流动性。同时，基金管理人在个股个券选择时将精选具有良好流动性的优质标的。因此，本基金拟投资的市场整体具有较高的流动性水平，可以匹配本基金约定的申购赎回安排。

（3）巨额赎回下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的

事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金经理和风险管理部会根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以支付所有的赎回款项。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，基金管理人会在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请。具体措施详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节中“（九）巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

（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

1) 暂停赎回或延缓支付赎回款项：上述具体措施详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节中“（九）巨额赎回的认定及处理方式”及“（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”的相关规定。

2) 延期办理巨额赎回申请：上述具体措施可见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节中“（九）巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

3) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

4) 暂停基金估值

暂停估值的情形详见招募说明书“十三、基金资产估值”章节第（六）条的相关约定，若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，实施暂停基金估值，基金管理人相应会采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

5) 实施侧袋机制

具体措施详见招募说明书“侧袋机制”章节的相关内容。当本基金启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，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。因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。

6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。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对基金收益水平存在影响。

7、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

8、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

9、人才流失风险

公司主要业务人员的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响。

10、本基金特有的投资风险

本基金采用数量化投资方式，通过 Black-Litterman 模型配置股票、债券等各类资产的权重，并借助长信行业多因素选股模型精选个股，从而构建投资组合。本基金所使用的数量化投资方式的风险在于模型理论可能存在的缺陷和对历史数据的依赖。另外，在数据处理的过程中，由于宏观数据、上市公司财务数据、股票交易数据、债券基础与交易数据、一致预期数据等各类数据的可靠性及透明度存在一定的不确定性，因此可能导致本基金对各类资产收益率的预测产生偏差，从而给本基金带来风险。

11、存托凭证的投资风险

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；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

12、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

（二）声明

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

二十、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、基金合同变更涉及基金合同第八章第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

2、除上述第 1 项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当按规定由基金管理人在指定媒介上公告。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

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

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算小组

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

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

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

3、清算程序

- (1) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算小组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 基金清算小组做出清算报告；
- (6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金清算公告；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- (1) 支付基金财产清算费用；
- (2) 缴纳基金所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立在指定媒介上公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算小组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十一、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人基本情况

名称：长信基金管理有限责任公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

法定代表人：刘元瑞

成立日期：2003 年 5 月 9 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]63 号

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿陆仟伍佰万元人民币

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

（3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（4）根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费以及法律法规和中国证监会批准的其他费用；在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

（5）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其他法律法规规定的费用；

（6）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重

大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 根据基金合同的规定选择、委托、更换基金代销机构，并有权依照销售代理协议的约定对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 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；

(16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(17) 法律法规、中国证监会、基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

- (5) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；
- (6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；
- (7) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立，对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- (8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (9) 接受基金托管人依法进行的监督；
- (10) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回及注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不得向他人泄露；
- (13) 按基金合同确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请，及时、足额支付赎回和分红款项；
- (15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 按规定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 15 年以上；
- (18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (19) 编制基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告；

(20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，能在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

(22) 面临解散、依法被撤销、被依法宣告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；

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

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

(25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

(26) 公平对待所管理的不同基金和受托资产，防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配；

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

(28) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(29) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

4、基金托管人基本情况

名称：交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

成立日期：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：742.62 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

5、基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

6、基金托管人的义务

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户及债券托管账户；

(7) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(8) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，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、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

(13) 根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人或基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，并执行生效的基金份额持有人大会的决议；

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

(18) 面临解散、依法被撤销、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；

(19) 按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，

基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

(21) 不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；

(22) 法律、法规、本基金合同所规定的其他义务。

7、基金投资者持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，基金投资者依据本基金合同取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

8、基金份额持有人的权利

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、注册登记机构、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

9、基金份额持有人的义务

(1) 遵守基金合同；

(2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

- (4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- (7) 法律法规及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、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人及其合法授权代表共同组成。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金的基金份额持有人享有平等的表决权，每一基金份额具有一票表决权。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 更换基金管理人；
- (5) 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；
- (6) 本基金与其他基金的合并；
- (7) 变更基金类别；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况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、其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方

式、调低本基金的赎回费率，或调低基金销售服务费；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 经中国证监会的允许，基金管理人、基金注册登记机构或销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则。

(7) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，会议时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，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 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3) 代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）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 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额

10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但至少应当提前 30 日向中国证监会备案。

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

（6）基金份额持有人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。

5、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

（1）召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒介及基金管理人网站上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- A. 会议召开的时间、地点和方式；
- B. 会议拟审议的主要事项；
- C. 会议形式；
- D. 议事程序；
- E. 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- F. 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- G. 表决方式；
- H. 会务常设联系人姓名、电话；
- I. 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- J. 召集人需要通知的其他事项。

（2）采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由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、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对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。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

6、基金份额持有人出席会议的方式

(1) 会议方式

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。

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。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

基金份额持有人大会具体召开的方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

A. 现场开会方式

在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，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（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。

B. 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a、召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

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和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

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应占权益登记日基金总份额的 50%以上（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他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，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。

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。

7、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

A. 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

B. 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

C. 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提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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

人大会决定的程序进行审议。

D. 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上（含 10%）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、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，未获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 6 个月。法律法规另有规定除外。

E. 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

（2）议事程序

A. 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，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上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、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

B. 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人至少提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

（3）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。

8、决议形成的条件、表决方式、程序

（1）基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议：

A. 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理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、转换基金运作方式、终止基金合同的重大事项必须以特别决议方式通过；

B. 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除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。

(3) 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，并在指定媒介上公告。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(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。

(6) 基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

9、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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；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推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

C. 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主

持有人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议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。

D. 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

(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（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

(1) 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 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起按规定由相关信息披露义务人在指定媒介上公告。

11、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表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额

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、当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。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内同一类别的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。

（三）基金收益分配原则、执行方式

1、收益的构成

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

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

2、收益分配原则

（1）基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息

日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为相应类别的基金份额进行再投资), 基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式; 若基金份额持有人事先未做出选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红; 若基金份额持有人选择红利再投资, 红利再投资的份额免收申购费用;

(2) 同一类别每一基金份额享有同等分配权;

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下, 基金收益每年最多分配 6 次, 每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 30%, 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配(可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数);

(4) 基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配净额后不能低于面值;

(5) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红, 分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过 15 个工作日。

(7) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

3、收益分配方案

基金收益分配方案至少应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

4、收益分配的时间和程序

(1) 基金收益分配方案由基金管理人拟订, 由基金托管人复核, 依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告;

(2) 在收益分配方案公布后, 基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令, 基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

5、收益分配中发生的费用

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。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额, 不足于支付银行转账或其他手续费用时,

基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除息日除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。

6、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，详见招募说明书的规定。

(四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

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) 基金的销售服务费；
- (4) 基金的证券交易费用；
- (5) 基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- (8) 基金银行汇划费用；
- (9) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

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

本基金的管理费率为年费率 1.20%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，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，基金托管人复核无

误后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，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，基金托管人复核无误后于次月首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

(3) 基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费率年费率为 1.00%。

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的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基金销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中支付到指定账户。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

(4) 本条第 1 款第 (4) 至第 (9) 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

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财产的损失，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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

4、基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按规定在指定媒介上公告。

5、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

6、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，其他费用详见招募说明书的规定或相关公告。

7、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

(五) 基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。

2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，债券、货币市场工具、资产支持证券以

及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的 5%-40%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的 80%。

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

3、投资理念

用数量化投资技术战胜市场。

4、业绩比较基准

（1）本基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准为中证综合债券指数，本基金的业绩比较基准为复合指数：

沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%

若未来市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告。

（2）选择业绩比较基准的理由

沪深 300 指数是国内股票市场广受投资者关注的市场指数之一，指数本身对国内股票市场的走势有很强的代表性和广泛的影响力，可以较好地表征市场平均收益水平。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，因此该指数是本基金较为切合的市场基准选择。

5、风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

6、投资禁止行为与限制

（1）禁止用本基金财产从事以下行为

A. 承销证券；

- B. 向他人贷款或者提供担保；
- C. 从事承担无限责任的投资；
- D. 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- E. 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- F. 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

G. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

H. 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

（2）基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- A. 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- B. 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- C. 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- D. 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- E. 本基金现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；
- F. 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- G. 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级

报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

I. 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%；

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

K. 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%；

L. 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；

M. 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

N. 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；

O. 本基金投资流通受限证券时，遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字【2006】141 号）及相关规定；

P. 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

Q. 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，法律法规或监管机构另有规定的，从其规定；

R. 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种，投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- （1）银行存款及其应计利息；
- （2）结算备付金及其应计利息；
- （3）根据有关规定缴存的保证金及其应收利息；
- （4）应收证券交易清算款；
- （5）应收申购基金款；
- （6）股票投资及其估值调整；
- （7）存托凭证投资及其估值调整；
- （8）债券投资及其估值调整和应计利息；
- （9）其他投资及其估值调整；
- （10）其他资产等。

2、基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

3、估值方法

（1）股票估值方法

A. 上市流通股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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的

现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

B. 未上市股票的估值：

a、首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

b、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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第 A 条确定的估值价格进行估值。

c、送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第 A 条确定的估值价格进行估值。

d、非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

(a) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第 A 条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第 A 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

(b) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第 A 条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$$
（FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

C. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(2) 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。

(3) 债券估值方法

A. 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参

考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

B. 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

C. 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

D. 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

E. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（4）权证估值方法

A. 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

B. 首次发行未上市的权证，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，按成本估值。

C. 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

D. 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘

价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

E. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(5) 资产支持证券的估值方法

A. 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，按成本估值。

B. 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

C. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(6) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(7)在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财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各因素的基础上，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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

4、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前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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的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的基金份额净值和基金份额累计净值。

(七) 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

(1) 基金合同变更涉及本基金合同第八章第(二)项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的,应经基金份额持有人大会决议同意。变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准,并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

(2) 除上述第(1)项规定的情形外,经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更,该等变更应当按规定由基金管理人在指定媒介上公告。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同终止:

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

3、基金财产的清算

(1) 基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

(2) 基金财产清算小组

A. 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算小组,在基金财产清算小组接管基金财产之前,基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

B. 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人

员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(3) 清算程序

- A. 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- B. 基金财产清算小组根据基金财产的情况确定清算期限；
- C. 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- D. 对基金财产进行评估和变现；
- E. 基金清算小组做出清算报告；
- F. 会计师事务所对清算报告进行审计；
- G. 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- H. 将基金清算结果报告中国证监会；
- I. 公布基金清算公告；
- J. 对基金剩余财产进行分配。

(4) 清算费用

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

(5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- A. 支付基金财产清算费用；
- B. 缴纳基金所欠税款；
- C. 清偿基金债务；
- D. 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(6) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立在指定媒介上公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算小组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

- (7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

（八）争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

（九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资者查阅，基金合同条款及内容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

1、基金管理人

名称：长信基金管理有限责任公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

法定代表人：刘元瑞

成立日期：2003 年 5 月 9 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]63 号

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿陆仟伍佰万元人民币

存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）

法定代表人：牛锡明

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业

监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.62 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

本基金的投资范围为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、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，债券、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的 5%-40%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的 80%。

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

基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自《基金合同》生效日起开始履行。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出以上范围的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投

资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- (5) 本基金现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；
- (6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (7) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (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) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (11) 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；
- (12) 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；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14) 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；

(15) 基金投资流通受限证券时，遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字【2006】141 号）及相关规定执行；

(16) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

(17) 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，法律法规或监管机构另有规定的，从其规定；

(18) 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种，投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，除上述第（5）、（7）、（12）、（14）项外，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

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

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金合同生效后 2 个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

基金托管人发现基金管理人以上投资禁止行为的，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和基金合同的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名

单，并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人，基金托管人于2个工作日内电话或回函确认已知名单的变更。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，若无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。因此造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人负责对交易对手的资信控制和交易方式进行控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人撤销交易，基金管理人仍不撤销的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。因交易对手不履行合约造成的基金财产的损失，基金托管人不承担责任，但有权报告中国证监会。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中

约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式。基金管理人仍不重新确定交易方式的，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

(3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

7、基金托管人根据法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资其他方

面进行监督。

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

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

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本托管协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正，并通知基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在 10 个工作日内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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

10、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，无需召开基金份额持有人大会审议。

基金托管人依照相关法律法规的规定和基金合同的约定，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。侧袋机制实施期间的具体规则依照相关法律法规的规定和基金合同的约定执行。

（三）基金管理人

基金管理人根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本托管协议规定，对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户和证券账户及债券托管账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，如遇到问题是否及时反馈，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为，是否对非公开信息保密。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在 10 个工作日内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在 10 个工作日内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此遭受的损失。

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和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基

金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

- （1）基金托管人应安全保管基金财产。
- （2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立。
- （5）基金托管人应安全、完整地保管基金资产；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。
- （6）对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知并有义务配合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。基金托管人对此不承担责任。

2、基金合同生效时募集资产的验证

（1）本基金募集期届满之日前，投资者的认购款项只能存入本基金在中国证券登记结算有限责任公司开立的开放式基金结算备付金账户中，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以注册登记机构的记录为准。

（2）基金募集期满之日起 10 日内，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

(3) 若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

3、基金的银行存款账户的开立和管理

(1) 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行存款账户进行。

(3) 本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。

(4) 基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用网银办理托管资产的资金结算汇划业务。

(5) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《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》以及其他有关规定。

(6) 基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户，及时核查基金银行存款账户余额。

4、基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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

基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结

算备付金账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议生效日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

5、债券托管账户的开立和管理

(1) 《基金合同》生效后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

7、基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库，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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券及银行定期存款存单等有价凭证在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

8、与基金财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，相关业务程序另有限制除外。除本托管协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，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。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在 30 个工作日内将正本送达基金托管人处。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

（五）基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律法规的规定。基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核盖章后，将复核结果以加密传真的方式通知基金管理人，由基金管理人将基金资产净值予以公布。待条件成熟后，双方可协商采用电子对账方式。

本基金按以下方法估值：

（1）股票估值方法

A. 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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

B. 未上市股票的估值：

a、首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难

以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

b、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，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第 A 条确定的估值价格进行估值。

c、送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第 A 条确定的估值价格进行估值。

d、非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

(a) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第 A 条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第 A 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

(b) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第 A 条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$$
（FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

C. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(2) 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。

(3) 债券估值方法

A. 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

B. 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但

最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

C. 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

D. 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

E. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（4）权证估值方法

A. 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

B. 首次发行未上市的权证，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，按成本估值。

C. 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

D. 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

E. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

（5）资产支持证券的估值方法

A. 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，按成本估值。

B. 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

C. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(6) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(7) 在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财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各因素的基础上，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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

2、净值差错处理

当基金财产的估值导致任一类基金份额净值小数点后三位内（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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，由基金管理人对基金份额持有人或者基金先行支付赔偿金。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) 如采用本托管协议第八章“基金资产估值、基金资产净值计算与复核”中估值方法的第（1）—（6）进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，基金托管人承担

30%，基金管理人承担 70%的赔偿责任；

(2) 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；

(3) 基金管理人、基金托管人按上述估值方法第(7)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。

由于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的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，相关各方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

3、暂停估值与公告基金份额净值的情形

(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基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；

(4) 出现导致基金管理人不能出售或评估基金资产的情形时；

(5) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

(6) 法律法规、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

4、基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

5、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

6、会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

7、基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会公布的《信息披露办法》要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内予以公告；中期报告在基金会计年度前 6 个月结束后的两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。基金合同生效后，基金管理人应至少每年更新一次基金招募说明书、基金产品资料概要。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在收到后 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在收到后 5 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在更新招募说明书、基金产品资料概要完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 日内复核，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，发现相关各方的报表存在不符

时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准，若由此产生信息披露的差错，托管人不承担责任。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，相关各方各自留存一份。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中国证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核检查。

(六) 基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金注册登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由各基金注册登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

1、基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记机构编制的基金份额持有人名册；

2、基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由注册登记机构编制的基金份额持有人名册；

3、基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提供由注册登记机构编制的基金份额持有人名册；

4、除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由各注册登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备

份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额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。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

（七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本托管协议而产生的或与本托管协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，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，维护基金份额持有人的合法权益。

本托管协议受中华人民共和国法律管辖。

（八）托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、基金托管协议的变更

本托管协议相关各方当事人经协商一致，可以对本托管协议进行修改。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，应报中国证监会核准。

2、基金托管协议的终止

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的

终止事项。

3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组

在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

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

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

(2) 基金财产清算程序

A. 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

B. 基金财产清算小组根据基金财产的情况确定清算期限；

C. 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；

D. 对基金财产进行评估和变现；

E. 基金清算组做出清算报告；

F. 会计师事务所对清算报告进行审计；

G. 律师事务所对清算报告出具法律意见书；

H. 将基金清算报告中国证监会；

I. 公布基金清算公告；

J. 对基金剩余财产进行分配。

(3) 清算费用

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

(4) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

A. 支付基金财产清算费用；

B. 缴纳基金所欠税款；

C. 清偿基金债务；

D. 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(5) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算小组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

(6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十三、基金份额持有人服务

长信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”，或“基金管理人”，或“公司”）将为基金份额持有人提供一系列的服务，并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。基金份额持有人可以通过销售网点、客户服务中心、网站等渠道享受全方位、全过程的服务。以下是主要的服务方式和内容：

基金份额持有人服务内容			
序号	类型	明细	内容详述
(一)	账户服务	对账单服务	每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单； 每月结束后的 5 个工作日内，基金管理人根据投资者的对账单定制需求以书面或电子形式寄送交易对账单。
		其他资料	基金管理人将按基金份额持有人的需求不定期向其邮寄相关公司介绍和产品介绍的资料。
(二)	查询服务	网络在线查询	客户通过基金账户号码或开户证件号码登录基金管理人网站“账户登录”栏目，可享有账户查询、短信/邮件信息定制、资料修改等多项在线服务。
		交易信息查询	在一笔交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日开始通过销售机构的网点或登录基金管理人网站“账户登录”栏目查询交易情况，包括客户购买总金额、基金购买份额、基金分红份额、历史交易信息等等。
		客户账户信息的修改	基金份额持有人可以直接登录基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话、电子邮箱等等。也可以亲自到直销网点或致电客户服务专线，由人工坐席提供相关服务。 为了维护投资者的利益，投资者重要信息的更改手续办理如下： 1、代销客户由代销渠道提交办理（具体提供材料请咨询代销机构）。以配号方式开立的开放式基金账户资料中的投资者名称、证件类型、证件号码的变更业务，在一个工作日内，对单个开放式基金账户只能够修改其中一项关键信息。 2、直销客户：非正常变更需要提供本人身份证复印件、公安机关证明原件、开放式基金账户业务申请表、开放式基金账户资料变更申请表；正常变更需要提供本人身份证复印件、开放式基金账户业务申请表、开放式基金账户资料变更申请表；银行柜台出具的新旧银行卡转换证明原件，邮寄到公司。
(三)	基金投资的服务	网上交易	投资者除可通过销售机构和基金管理人的直销网点办理申购、赎回及信息查询外，还可通过基金管理人的网站（www.cxfund.com.cn）享受网上交易服务。具体业务规则详见本公司网站说明。
		红利再投资	本基金收益分配时，经投资者选择，基金管理人将为持有人提供红利再投资服务。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时（权益登记日申请设置的分红方式对当次分红无效）选择更改基金分红方式。

(四)	客户服务中心电话服务		客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。 每交易日客户服务中心人工坐席提供服务,投资者可以通过该专线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。
(五)	客户投诉受理服务	客户投诉处理流程	本公司客户投诉受理由客户服务中心统一管理,指定专人负责,设定专门的投诉管理工作流程,并由监察稽核部负责督促投诉的处理情况。
		客户投诉方式	投资者可通过本公司的客户服务专线(400-700-5566)、代销机构、公司网站(www.cxfund.com.cn)、电子邮件(service@cxfund.com.cn)、信件、各销售机构网点柜台等多种形式对本公司所提供的服务以及公司的政策规定进行投诉。客户投诉都将被定期汇总登记并存档,通过拨打客户服务专线进行的投诉将被电话录音存档,本公司将采取适当措施,及时妥善处理客户投诉,总结相关问题,完善内控制度。
(六)	增值服务	信息定制服务	基金份额持有人可以在基金管理人网站或致电客户服务专线定制自己所需要的信息,包括产品净值、交易确认、公司新闻、基金信息等方面的内容。基金管理人按照要求,将以手机短信或者电子邮件的方式定期向投资者发送信息。
		个性化理财服务	随着公司的发展,本公司将酌情为基金份额持有人提供个性化理财服务,如配备理财顾问为基金份额持有人提供理财建议以及相关的理财计划等形式。
		组织投资者交流会	本公司将不定期地举行投资者交流会,为基金份额持有人提供基金、投资、理财等方面的讲座,使得本公司基金份额持有人能得到更多的理财信息和其他增值服务。另外,本公司基金经理也将通过多种方式不定期地与基金份额持有人交流,让基金份额持有人了解更多基金运作情况。
(七)	投资者教育服务		为了进一步做好投资者服务,让投资者了解证券市场和各类证券投资品种的特点和风险,熟悉证券市场的法律法规,树立正确的投资理念,增强风险防范意识,依法维护自身合法权益,本公司将开展普及证券知识、宣传政策法规、揭示市场风险、引导依法维权等投资者教育活动。
(八)	公开信息披露服务	披露公司信息	为方便社会公众了解公司的信息,包括本公司的发展概况、组织结构、公司文化、经营理念、经营管理层、经营情况等公开信息,本公司开通了全国统一的客户服务专线 400-700-5566(免长话费)和公司网站(www.cxfund.com.cn),以方便投资者查询。
		披露基金信息	本公司将按规定在中国证监会指定媒介上披露法定的文件、公告信息。 本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构及相关基金宣传资料来披露本基金相关信息,包括本基金的概况、投资理念、投资对象、风险收益特征、净值及其变化情况、基金经理介绍等多方面的信息。
		其他信息的披露	本公司客户服务中心和网站除为投资者提供上述信息咨询外,还提供其他信息咨询,包括托管人的情况、基金知识、市场新闻和行情、产品信息等多方面内容。
(九)	客户	客户服务	4007005566(免长话费)、工作时间(8:30-12:00 13:00-17:00)



长信量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书

服务 联络 方式	专线	内可转人工坐席。
	传真	021-61009865
	公司网址	https://www.cxfund.com.cn/
	电子信箱	service@cxfund.com.cn

二十四、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信量化先锋混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/4/22
2	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/4/22
3	长信基金管理有限责任公司关于增加湘财证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/4/25
4	长信量化先锋混合型证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/4/28
5	长信基金管理有限责任公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/5/7
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/5/11
7	长信基金管理有限责任公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/5/25
8	长信基金管理有限责任公司关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/5/26
9	长信基金管理有限责任公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/6/8
10	长信基金管理有限责任公司关于增加上海中欧财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/6/13

11	长信基金管理有限责任公司关于增加上海攀赢基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/6/15
12	长信基金管理有限责任公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/6/15
13	长信基金管理有限责任公司关于增加南京证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/6/30
14	长信量化先锋混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/7/21
15	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第二季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/7/21
16	长信基金管理有限责任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	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/8/4
17	长信基金管理有限责任公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/8/17
18	长信基金管理有限责任公司关于增加山西证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/8/17
19	长信基金管理有限责任公司关于增加东兴证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/8/24
20	长信量化先锋混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/8/31
21	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/8/31

22	长信基金管理有限责任公司关于增加兴业证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/9/2
23	长信基金管理有限责任公司关于长信基金APP终止运营及维护服务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/9/28
24	长信量化先锋混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/10/26
25	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/10/26
26	长信基金管理有限责任公司关于增加方正证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/11/8
27	长信基金管理有限责任公司关于增加甬兴证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/12/16
28	长信量化先锋混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/1/20
29	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/1/20
30	长信基金管理有限责任公司关于增加东方财富证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/3/13
31	长信量化先锋混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/3/31
32	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/3/31
本信息披露事项截止时间为 2023 年 3 月 31 日			

二十五、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十六、备查文件

本基金备查文件包括：

- （一）中国证监会批准长信量化先锋混合型证券投资基金募集的文件；
- （二）《长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《长信量化先锋混合型证券投资基金托管协议》；
- （四）法律意见书；
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （七）基金销售代理人业务资格批件和营业执照；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

长信基金管理有限责任公司

2023年8月28日