长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金于2015年4月27日获得中国证监会证监许可〔2015〕758号文注册募集。长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。基金管理人于2015年5月29日获得中国证监会书面确认，《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》自该日起生效。

根据《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》约定，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止长盛中证申万一带一路 A 份额与长盛中证申万一带一路 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于2020年12月2日在规定媒介发布《长盛基金管理有限公司关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向上海证券交易所申请长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的两类子份额退市，并于2020年12月31日（基金份额折算基准日）进行基金份额折算；《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》于基金份额折算基准日次日（2021年1月1日）生效；《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

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

本基金标的指数为中证申万一带一路主题指数。

中证申万一带一路主题投资指数从沪深市场中选取 100 只盈利能力较高、盈利成长较强、且盈利较为稳定的参与一带一路建设或与一带一路国家或地区进行进出口贸易的上市公司证券，以反映受益于一带一路主题的代表性上市公司证券在沪深市场的整体表现。

1、 样本空间：中证全指指数。

2、 选样方法：

1）对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；

2）对样本空间剩余证券，选取在一带一路沿线国家或地区进行投资、并购、项目承建，或与一带一路沿线国家或地区进出口贸易额较高的上市公司证券作为待选样本；

3）计算待选样本过去一年 ROE、过去一年 ROE 同比增速、过去十二个季度 ROE 均值与波动率之比、过去一年 ROIC、过去一年 ROIC 同比增速、过去十二个季度 ROIC 均值与波动率之比等六个指标的标准化得分， 再将六个标准化得分等权计算得到待选样本的综合得分。

4）对待选样本，按照综合得分由高到低排名，选取排名较高的 100 只证券作为指数样本。

3、指数计算公式如下：报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000 其中，调整市值=∑（证券价格×调整股本数×权重因子）。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见中证指数有限公司网站发布的计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使指数 以综合得分与自由流通市值乘积进行加权，且单个样本权重不超过 5%。

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

基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动而波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金份额持有人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积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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

提示”章节的具体内容。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，且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。投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等基金法律文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2026 年 9 月 23 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

目 录

重要提示 2
第一部分、绪言 7
第二部分、释义 8
第三部分、基金管理人 14
第四部分、基金托管人 23
第五部分、相关服务机构 25
第六部分、基金的历史沿革 51
第七部分、基金的存续 52
第八部分、基金份额的上市交易 53
第九部分、基金份额的申购与赎回 54
第十部分、基金的侧袋机制 65
第十一部分、基金的投资 68
第十二部分、基金的业绩 79
第十三部分、基金份额的非交易过户、转托管、定期定额投资、冻结、解冻及质押 81
第十四部分、基金的财产 83
第十五部分、基金资产估值 84
第十六部分、基金的收益与分配 90
第十七部分、基金费用与税收 92
第十八部分、基金的会计与审计 95
第十九部分、基金的信息披露 96
第二十部分、风险揭示 103
第二十一部分、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 109
第二十二部分、基金合同的内容摘要 111
第二十三部分、基金托管协议的内容摘要 128
第二十四部分、对基金份额持有人的服务 139

第二十五部分、其他应披露事项 140
第二十六部分、招募说明书的存放及查阅方式 142
第二十七部分、备查文件 143

第一部分、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》”）、《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（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“《流动性风险管理规定》”）和其他相关法律法规的规定及《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）等编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

第二部分、释义

在招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF），由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来

2、基金管理人：指长盛基金管理有限公司

3、基金托管人：指中国银行股份有限公司

4、基金合同：指《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

8、《上市交易公告书》：指《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书》

9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的

修订

13、《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

14、《流动性规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

18、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有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

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，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

25、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，为办理基金销售业务的机构

26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、注册登记机构：指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，通过场外销售机构申购的基金份额登记在本系统

29、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统，通过场内会员单位申购或买入的基金份额登记在本系统

30、开放式基金账户：指投资者通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户。基金投资者办理场外申购和场外赎回等业务时需具有开放式基金账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

31、上海证券账户：指投资者在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司开设的上海证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户。基金投资者通过上海证券交易所交易系统办理基金交易、场内申购和场内赎回等业务时需持有上海证券账户。记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

32、业务规则：指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所开放式基金业务管理办法》、《上海证券交易所上市开放式基金业务指引》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》及对其不时做出的修订，中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司上市开放式基金登记结算业务实施细则》及对其不时做出的修订，以及销售机构业务规则等相关业务规则和实施细则

33、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起基金的基金份额变动及结余情况的账户

34、基金合同生效日：指《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日，《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基

金基金合同》自同一日失效

35、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

36、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

37、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

38、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

39、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日），n 为自然数

40、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

41、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

42、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44、场外：指不通过上海证券交易所交易系统而通过基金管理人自身的柜台或者其他交易系统办理基金份额申购和赎回业务的基金销售机构和场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场外申购、场外赎回

45、场内：指通过上海证券交易所会员单位和上海证券交易所交易系统办理基金份额申购、赎回和上市交易业务的场所。通过该等场所办理基金份额的申购、赎回也称为场内申购、场内赎回

46、场外份额： 指登记在注册登记系统下的基金份额

47、场内份额： 指登记在证券登记结算系统下的基金份额

48、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

49、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、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人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

50、巨额赎回：指本基金若本基金单个开放日内，净赎回申请（赎回申请份

额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时的情形

51、标的指数：指中证申万一带一路主题指数

52、上市交易：基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖份额的行为

53、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

54、系统内转托管：基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为

55、跨系统转托管：基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

56、元：指人民币元

57、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入

58、基金资产总值：指基金拥有的各类证券、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和

59、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

60、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

61、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

62、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

63、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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）及其他媒介

64、不可抗力：指合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

65、中国：指中华人民共和国。就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

66、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

67、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

第三部分、基金管理人

一、基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3 层

法定代表人：胡甲

电话：（010）86497888

传真：（010）86497666

联系人：张利宁

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6 号文件批准，于 1999 年 3 月成立，注册资本为人民币 20600 万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%；新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%；安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。截至 2026 年 9 月 23 日，基金管理人共管理七十六只开放式基金和七只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

二、主要人员情况

1、董事会成员

胡甲先生，董事长，硕士，高级经济师。曾任安徽省财政厅农业财务处科员、副主任科员、主任科员，安徽省信托投资公司滁州证券营业部总经理，国元证券滁州营业部总经理，铜陵营业部总经理，合肥寿春路第二营业部总经理，合肥寿春路第一营业部总经理，市场营销总部副总经理，营销经纪总部副总经理、总经理，总裁助理兼经纪业务管理总部总经理，总裁助理兼证券信用总部总经理，总裁助理兼总裁办公室主任，董事会秘书，执行委员会委员。现任长盛基金管理有限公司董事长(法定代表人)。

汤琰女士，董事，硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理；华安基金管理有限公司零售业务部副总经理；中金基金管理有限公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理，兼任长盛基金（香港）有限公司董事。

沈和付先生，董事，学士。曾任中国安徽国际经济技术合作公司法律部科员、总经办经理助理，安徽省信托投资公司法律顾问室副主任，国元证券有限责任公

司法律事务部主任，国元证券股份有限公司合规总监、副总裁，安徽国元投资有限责任公司党委书记、董事长，国元证券股份有限公司党委副书记、执行委员会主任、总裁。现任国元证券股份有限公司党委书记、董事长，兼任国元国际控股有限公司董事。

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

郑思祯女士，董事，学士。曾任美银亚洲有限公司副总裁，星展银行(香港)有限公司银团贷款部董事总经理、星展银行香港分行大中型企业部主管和董事总经理（职级），星展银行（中国）有限公司企业及机构银行业务部大中型企业部主管、副行长、董事总经理（职级）。现任星展银行（中国）有限公司行长/行政总裁、执行董事，兼任深圳农村商业银行股份有限公司非执行董事，星展科技产业（中国）有限公司的董事长。

过劲松先生，董事，硕士，高级统计师、经济师。曾任安徽省统计局农业处主任科员、核算处副处长、投资处处长、设管处处长及安徽省统计局党组成员、总统计师。现任安徽省信用融资担保集团有限公司党委委员、副总经理。

张仁良先生，独立董事，博士。曾任香港教育大学校长、公共政策讲座教授、香港交通咨询委员会主席、第十三届中国全国政协委员、香港社会创新及创业发展基金专责小组主席、太平洋经济合作香港委员会主席、香港浸会大学工商管理学院院长、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席。2007 年被委任为太平绅士，2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章，2017 年获法国政府颁发棕榈教育军官荣誉勋章，2019 年获香港特区政府颁发银紫荆星章。现任圣方济各大学校长、招商永隆银行有限公司独立董事兼副董事长。

李清伟先生，独立董事，博士。曾任上海财经大学教授、博士生导师，上海大学法学院执行院长。现任上海大学法学院教授、博士生导师、娱乐法研究中心主任，中国法学会立法学研究会常务理事、中国比较法研究会理事、中国法理学研究会理事、中国行为法学会金融法律行为研究会常务理事、上海市法学会外国法与比较法研究会副会长，上海市法理法史研究会副会长，澳门城市大学兼职教授、博士生导师，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，爱丽家居科技股份有限

公司独立董事，浙江永和股份有限公司独立董事，张家港保税科技（集团）股份有限公司独立董事，上海董道律师事务所律师。

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

杜愚先生，独立董事，法律硕士。先后任职鞍山冶金设计研究院技术经济工程师、北京融融担保投资有限公司副总经理、国咨资产投资经营有限责任公司总经理、世纪投资有限公司（BVI）执行董事，北京仁杜律师事务所主任。现任北京仁杜律师事务所首席合伙人，兼任对外经济贸易大学国际经贸学院兼职研究生导师，北师大中国民营经济研究中心客座研究员。

2、管理层成员

胡甲先生，董事长，硕士，高级经济师。同上。

汤琰女士，总经理，硕士。同上。

蔡宾先生，硕士，特许金融分析师 CFA。曾任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，历任研究员、社保组合助理，投资经理，基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，基金经理，兼任长盛创富资产管理有限公司董事长(法定代表人)、总经理，长盛基金（香港）有限公司董事。

吴达先生，博士，特许金融分析师 CFA。曾任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、专户投资组合经理，新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员，华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理。2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司，历任基金经理，长盛创富资产管理有限公司总经理、国际业务部总监等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，投资经理，兼任长盛基金（香港）有限公司董事、执行副总经理、长盛基金管理有限公司北京分公司总经理。

张利宁女士，学士，注册会计师。曾任职于华北计算技术研究所财务部，太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司。1999 年 1 月起加入长盛基金

管理有限公司，历任公司研究部业务秘书，业务运营部基金会计、总监，财务会计部总监，监察稽核部副总监、总监等职务。现任长盛基金管理有限公司督察长，兼任风险管理部总经理、长盛创富资产管理有限公司监事。

刁俊东先生，硕士，注册会计师。曾任合肥电缆厂财务核算主管、安徽省国际信托投资公司财务主管，国际金融报社财务经理，国元证券有限责任公司财务主管。2004 年 11 月加入长盛基金管理有限公司，历任财务会计部副总监、总监、总经理助理。现任长盛基金管理有限公司财务负责人兼任董事会秘书、财务会计部总经理、总经理办公室总经理，兼任长盛创富资产管理有限公司董事。

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

3.本基金基金经理

石晓冉先生，硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员，中国人保资产管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理，万柏私募基金管理有限公司投资经理。2025 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

冯雨生先生，2015 年 5 月 29 日至 2019 年 10 月 9 日任本基金（转型前）基金经理；陈亘斯先生，自 2019 年 10 月 9 日至 2020 年 12 月 31 日任本基金（转型前）基金经理；陈亘斯先生，自 2021 年 1 月 1 日至 2026 年 7 月 2 日任本基金（转型后）基金经理。

4．投资决策委员会成员

权益投资决策委员会成员：

汤琰女士，总经理，硕士。同上。

蔡宾先生，副总经理，硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

郭堃先生，硕士。曾任阳光资产管理股份有限公司行业研究员、制造业研究组组长，泓德基金管理有限公司基金经理。2019 年 12 月加入长盛基金管理有限公司，历任研究部总监、公司副总经理等职务，现任公司首席投研专家，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理，长盛制造精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理，长盛优势企业精选混合型证券投资基金基金经理，长盛匠心研究精选混合型证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

张谊然女士，硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础研究组分析员。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司，现任权益投资部总经理，研究部总经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛成长精选混合型证券投资基金基金经理。

梁洁琼女士，硕士，特许金融分析师 CFA。曾任交银施罗德基金管理有限公司产品开发部产品经理，银华基金管理有限公司国际合作与产品开发部高级产品经理。2013 年 5 月加入长盛基金管理有限公司，历任产品开发部高级产品开发经理、副总监、行政负责人，现任量化投资部总经理，产品开发部总经理。

固定收益投资决策委员会成员：

汤琰女士，总经理，硕士。同上。

蔡宾先生，副总经理，硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

王贵君先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师，上投摩根基金管理有限公司债券研究员。2017 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任投资经理助理、投资经理、专户理财部副总监、固定收益部副总经理，现任公司总经理助理、固定收益部总经理，长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛安逸纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1.依法募集资金，办理基金份额的发售和登记事宜。

2.办理基金备案手续。

3.对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。

4.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。

5.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。

6.编制基金季度报告、中期报告和年度报告。

7.计算基金资产净值，计算并公告基金份额净值、基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格。

8.办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项。

9.按照规定召集基金份额持有人大会。

10.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

11.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

12.有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

1、本基金管理人不从事违反法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反法律法规行为的发生。

2、本基金管理人建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止将基金财产用于下列投资或活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）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；

（7）依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

3、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

（1）越权或违规经营，违反基金合同或托管协议；

（2）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

（3）在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；

（4）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（5）玩忽职守、滥用职权；

（6）泄漏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；

（7）除按依法进行基金资产管理外，直接或间接进行股票投资；

（8）其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

（3）不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的内部控制制度

1．内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

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

（4）相互制约原则。公司及各部门在内部组织结构和岗位的设置上要权责

分明、相互制衡。

（5）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

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

2．完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”（董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部、风险管理部）内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于公司风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况，组织指导公司监察稽核、风险管理部工作，对基金运作、内部管理的制度执行及遵规守法进行检查监督；公司风险控制委员会定期对基金资产运作的风险进行评估，对存在的风险隐患或发现的风险问题进行研究；监察稽核部通过日常的的监督检查工作，督促公司各部门持续完善且严格执行内控制度，风险管理部通过全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度，从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面及时和全面揭示各基金风险控制要素，明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法，全面加强对各基金投资合规风险监控。

3．内部控制制度的内容

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

（1）公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，内部控制大纲对内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容加以明确。

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

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

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

4．内部控制制度评价与报告

公司建立了严格的内控制度评价程序和报告制度，以保证公司内部控制制度的合理性与有效性。部门负责人是本部门内部控制与风险管理的第一责任人，须定期检查本部门的风险控制情况和风险控制措施是否有效，对相应的内部控制制度的合理性、有效性做出评价，并根据检查、评价结果及时调整内控制度或修正行为。公司监察稽核部在各部门自我监督基础之上实施再监督，通过对各项制度执行情况定期、不定期的稽核，对各项制度的合理性与有效性进行检查评价，发现制度不合理的、不适用的，要求相关部门进行修改，同时报告公司总经理和督察长；发现制度未能有效执行、控制失效的，要求相关部门立即整改，并出具监察报告，及时向公司管理层和督察长报告。督察长就公司内控制度建设与执行情况定期向监管机构及公司董事会进行报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

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

第四部分、基金托管人

一、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币叁仟贰佰贰拾贰亿壹仟贰佰肆拾壹万壹仟捌佰壹拾肆元整

法定代表人：葛海蛟

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行资产托管部设立于 1998 年，现有员工 130 余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60％以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

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

三、证券投资基金托管情况

截至 2026 年 6 月 30 日，中国银行已托管 1250 只证券投资基金，其中境内基金 1181 只，QDII 基金 69 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF、REITs 等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务风险管理与内部控制纳入中国银行全面风险管理体系。资

产托管部作为一道防线部门，承担托管业务风险控制的第一责任；风险管理部门作为第二道防线部门，承担制定风险管理制度和流程，监测和管理风险的责任，对托管业务进行指导、培训、监督检查；审计部门作为第三道防线，负责开展托管业务审计工作，发现问题，揭示风险，提出审计建议。中国银行托管业务风险控制贯穿业务各环节，通过制度建设与执行、风险与控制评估、内外部检查及审计监督等措施，持续完善托管业务全员、全面、全程的风险管理体系。

2007 年起，中国银行开始聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作，已连续多年获得基于 “ISAE3402”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的内控鉴证报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

第五部分、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、场外销售机构

①直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

注册地址：深圳市福田区福田中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3 层

法定代表人：胡甲

电话：（010）86497908、（010）86497962

传真：（010）86497997、（010）86497998

公司网址：www.csfunds.com.cn

②其他销售机构

(1) 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：葛海蛟

客服电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：谷澍

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：廖林

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(4) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：缪建民

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(6) 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

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(7) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

公司网址：www.nbcb.com.cn

(8) 平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

客服电话：95511-3

公司网址：bank.pingan.com

(9) 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：张为忠

客服电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(10) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号

法定代表人：吕家进

客服电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

(11) 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：葛仁余

客服电话：95319

公司网址：www.jsbchina.cn

(12) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址：广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人：卢国锋

客服电话：(0769) 961122

公司网址：www.drcbank.com

(13) 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

客服电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

(14) 国泰海通证券股份有限公司

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

法定代表人：朱健

客服电话：95521

网址：www.gtht.com

(15) 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：北京市朝阳区光华路 10 号

法定代表人：刘成

客服电话：400-888-8108

网址：www.csc108.com

(16) 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：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼

法定代表人：张纳沙

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(17) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

法定代表人：霍达

客服电话：95565/400-8888-111

网址：www.cmschina.com

(18) 广发证券股份有限公司

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

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

法定代表人：孙树明

客服电话：95575 或致电各地营业网点

网址：www.gf.com.cn

(19) 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

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

(20) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

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：王晟

客服电话：95551/400-8888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(21) 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

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(22) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：上海市世纪大道 1198 号一座世纪汇广场 29 楼

法定代表人：李新华

客服电话：95579/400-8888-999

网址：www.95579.com

(23) 国投证券股份有限公司

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：段文务

客服电话：95517

网址：www.sdicsc.com.cn

(24) 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：吴坚

客服电话：400-809-6096

网址：www.swsc.com.cn

(25) 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

客服电话：95351

网址：www.xcsc.com

(26) 国元证券股份有限公司

注册地址：中国安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人：沈和付

客服电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

(27) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：安志勇

客服电话：956066

网址：www.bhzq.com

(28) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

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

法定代表人：周易

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(29) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：400-666-1618、95573

网址：www.i618.com.cn

(30) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座

法定代表人：冯恩新

客服电话：95548

网址：sd.citics.com

(31) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

客服电话：400-888-8993

网址：www.dxzq.net

(32) 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

客服电话：95321

网址：www.cindasc.com

(33) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 17 层

法定代表人：施华

客服电话：95571

网址：www.foundersc.com

(34) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

(35) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01 号）1001 室（部位：自编 01 号）

办公地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01 号）1001 室（部位：自编 01 号）

法定代表人：陈可可

客服电话：95548

网址：www.gzs.com.cn

(36) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

(37) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：何伟

客服电话：400-8918-918

网址：www.shzq.com

(38) 平安证券股份有限公司

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

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

法定代表人：何之江

客服电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

(39) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

(40) 东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：陈照星

客服电话：95328

网址：www.dgzq.com.cn

(41) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(42) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：王文卓

客服电话：95531/400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

(43) 华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

客服电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

(44) 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

客服电话：95523/400-8895-523

网址：www.swhysc.com

(45) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼

办公地址：济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼

法定代表人：王洪

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(46) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：刘学民

客服电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

(47) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 600 号外滩金融中心 S2 幢 22 楼

法定代表人：武晓春

客服电话：400-888-8128

网址：www.tebon.com.cn

(48) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址：陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

客服电话：95582

网址：www.west95582.com

(49) 华福证券股份有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5129 号 N1 座

法定代表人：苏军良

客服电话：95547

网址：www.hfzq.com.cn

(50) 华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼

法定代表人：祁建邦

客服电话：95368

网址：www.hlzq.com

(51) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

(52) 五矿证券有限公司

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

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

法定代表人：黄海洲

客服电话：400-1840-028

网址：www.wkzq.com.cn

(53) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A

办公地址：上海市徐汇区云锦路 277 号西岸数字谷二期 T3

法定代表人：俞洋

客服电话：95323/400-1099-918

网址：www.cfsc.com.cn

(54) 中国中金财富证券有限公司

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

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

层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

法定代表人：高涛

客服电话：95532/400-600-8008

网址：www.ciccwm.com

(55) 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：李永湖

客服电话：95329

网址：www.zszq.com

(56) 粤开证券股份有限公司

注册地址：广州经济技术开发区科学大道60号开发区控股中心21、22、23层

办公地址：深圳市福田区深南大道2002号中广核大厦北楼10层

法定代表人：严亦斌

客服电话：95564

网址：www.ykzq.com

(57) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：赵洪波

客服电话：956007

网址：www.jhzq.com.cn

(58) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

客服电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

(59) 华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

办公地址：上海市浦东新区浦电路 370 号宝钢大厦华宝证券 5 楼

法定代表人：刘加海

客服电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(60) 首创证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 13 号楼 A 座 11-21 层

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院北投投资大厦 A 座 18 层

法定代表人：毕劲松

客服电话：95381

网址：www.sczq.com.cn

(61) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街九号华远企业号 D 座三单元

法定代表人：李长伟

客服电话：0871-68885858-8152

网址：www.tpyzq.com

(62) 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学院路 77 号黄龙国际中心 E 座

法定代表人：王珺

客服电话：95188-8400

公司网址：www.fund123.cn

(63) 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南山街道听海大道 5212 号腾讯数码大厦 2 栋（南塔）L1401-L1501

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 层

法定代表人：谭广锋

客服电话：4000-890-555

公司网址：www.tenganxinxi.com

(64) 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 号楼二层

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

客服电话：400-1818-188

公司网站：http://www.1234567.com.cn

(65) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部 2 号楼

法定代表人：邹保威

客服电话：

个人业务：95118,4000988511

企业业务：4000888816

公司网址：kenterui.jd.com

(66) 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

客服电话：95357

公司网站：http://www.18.cn

(67) 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 6 层

办公地址：上海市闵行区申滨南路 1226 号诺亚财富中心

法定代表人：王强

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

(68) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼

办公地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼

法定代表人：陈祎彬

客服电话：4008219031

公司网址：www.lufunds.com

(69) 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 6 号楼 17 层

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-0618-518

公司网址：https://danjuanapp.com

(70) 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：杜松岭

客服电话：4006105568

公司网址：www.boserawealth.com

(71) 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 479 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：郑焰

客服电话：400-100-2666

公司网址：www.zocaifu.com

(72) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客服电话：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

(73) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：上海浦东新区张扬路 500 号华润时代广场 10F、11F、14F

法定代表人：陶怡

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(74) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

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

客服电话：400-820-5369

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(75) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 A 座 1108

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 401

法定代表人：王伟刚

客户服务电话：010-63158805

公司网址：www.hcjijin.com

(76) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022

公司网址：licaike.hexun.com

(77) 嘉实财富管理有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11

层

法定代表人：张峰

客户服务电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

(78) 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：上海市虹口区溧阳路 735 号 2 幢 3 层

法定代表人：尹彬彬

客户服务电话：400-118-1188

公司网址：www.66liantai.com

(79) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园 2 栋 3401

办公地址：北京市丰台区丽泽平安幸福中心 B 座 7 层

法定代表人：张斌

客户服务电话：4001661188-2

公司网址：www.xinlande.com.cn

(80) 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乙 118 号 10 层 1206

办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

法定代表人：彭浩

客服电话：4000048821

网址：www.taixincf.com

(81) 玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谙

客户服务电话：400-080-8208

公司网址：www.licaimofang.com

(82) 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 118 号招商局大厦 24 层

办公地址：北京市朝阳区建国路 118 号招商局大厦 24 层

法定代表人：胡雄征

客户服务电话：400-6099-200

公司网址：www.yixinfund.com

(83) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.com

(84) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人：葛新

客户服务电话：95055-4

公司网址：www.duxiaomanfund.com

(85) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

法定代表人：李科

客户服务电话：95510

公司网址：http://fund.sinosig.com

(86) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn；www.jjmmw.com

(87) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

办公地址：上海市浦东新区世博大道 1515 号世博天地写字楼 T1 栋 17 楼

法定代表人：贾志伟

客服电话：400-820-9935

公司网址：www.leadfund.com.cn

(88) 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：上海市浦东新区滨江大道 1111 弄 1 号中企国际金融中心 A 楼 6 楼

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

公司网址：www.erichfund.com

(89) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：申健

客服电话：021-20292031

公司网址：www.wg.com.cn

(90) 奕丰基金销售有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEOWEEHOWE

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

(91) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

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

法定代表人：穆飞虎

客服电话：010-62675369

公司网址：www.xincai.com

(92) 大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：卜勇

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

(93) 深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108

办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108（518000）

法定代表人：赖任军

客服电话：400-8224-888

公司网址：www.jfz.com

(94) 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

客服电话：95177

公司网址：www.snjijin.com

(95) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：王廷富

客服电话：400-799-1888

公司网址：http://www.520fund.com.cn

(96) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

法定代表人：吕柳霞

客服电话：021-50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

(97) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 703 室

法定代表人：郑新林

客户服务电话：021-68889082

公司网址：www.pytz.cn

(98) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人：温丽燕

客户服务电话：400-0555-671

网址：www.hgccpb.com

(99) 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

客户服务电话：010-66154828

网址：www.5irich.com

(100) 上海陆享基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼 01、08 单元

法定代表人：粟旭

客户服务电话：4001681235

网址：www.luxxfund.com

(101) 上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址（公司地址）：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

客户服务电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

(102) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

客服电话：025-66046166

公司网址：www.huilinbd.com

(103) 通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层

法定代表人：沈丹义

客服电话：400-101-9301

公司网址：https://www.tonghuafund.com

(104) 华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座

14 层

办公地址：上海市向城路 288 号国华金融大厦 8 楼

法定代表人：杨新章

客户服务电话：952303

公司网址：www.huaruisales.com

(105) 北京济安基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005

法定代表人：杨健

客户服务电话：400-673-7010

公司网址：www.jianfortune.com

(106) 深圳市米粒基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道 3046 号香江金融大厦 2111

办公地址：深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道 3046 号香江金融大厦 2111

法定代表人：黎泰材

客户服务电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

(107) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-818-8000

公司网址：www.myfund.com

(108) 北京坤元基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城大街特钢公司十一区（首特创业基地 A 座）八层 816 号

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号院北京财富中心写字楼 A 座 30 层

3001B

法定代表人：杜福胜

客户服务电话：4006498989

(109) 华源证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区万松街道青年路 278 号中海中心 32F-34F

法定代表人：邓晖

客户服务电话：95305-8

网址：www.huayuanstock.com

(110) 深圳前海微众银行股份有限公司

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

办公地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

法定代表人：顾敏

客服电话：400-999-8800

公司网址：http://www.webank.com

(111) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

电话：010-63631752

官网：www.e-chinalife.com

(112) 易方达财富管理基金销售（广州）有限公司

注册地址：广州市南沙区横沥镇期航二街 2 号 101 房

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 30 号广州银行大厦 41 楼

法定代表人：陈彤

客服电话：4001608888

公司网址：www.efundcf.com.cn

2、场内销售机构

本基金办理场内认购业务的销售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位，详见基金份额发售公告。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：中国北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：010-50938600

客户服务热线：4008 058 058

联系人：赵亦清

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所

注册地址：上海市华阳路 112 号 2 号楼东虹桥法律服务园区 302 室

办公地址：上海市陆家嘴环路 1366 号富士康大厦 12 层

负责人： 陈峰

电话：（021）58773177

传真：（021）58773268

联系人：张兰

经办律师：梁丽金、张兰

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

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

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

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

经办注册会计师：贺耀、马剑英

联系人：贺耀

第六部分、基金的历史沿革

长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金于 2015 年 4 月 27 日获中国证监会证监许可〔2015〕758 号文注册募集。长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。基金管理人于 2015 年 5 月 29 日获中国证监会书面确认，《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》自该日起生效。

根据《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》约定，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止长盛中证申万一带一路 A 份额与长盛中证申万一带一路 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在规定媒介发布《长盛基金管理有限公司关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向上海证券交易所申请长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的两类子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》于基金折算基准日次日（2021 年 1 月 1 日）正式生效，《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

第七部分、基金的存续

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，在履行适当程序后，直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第八部分、基金份额的上市交易

一、上市交易的基金份额

基金合同生效后，基金管理人将根据有关规定，申请本基金份额上市交易。

二、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为上海证券交易所。

本基金上市后，登记在证券登记结算系统中的本基金基金份额可直接在上海证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的本基金基金份额通过办理跨系统转托管业务转至证券登记结算系统后，方可上市交易。

三、上市交易的时间

上市日期：2015 年 6 月 9 日

四、上市交易的规则

本基金上市交易遵循上海证券交易所相关业务规则及规定。

五、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照上海证券交易所有关规定办理。

六、上市交易的行情揭示

本基金在上海证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日基金份额净值。

七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和上海证券交易所的相关业务规则执行。

八、在不损害届时基金份额持有人利益的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可申请在其他证券交易所同时挂牌交易，而无需召开基金份额持有人大会审议。

九、相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加本基金上市交易方面的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

第九部分、基金份额的申购与赎回

本基金基金合同生效后，投资者可通过场外或场内对基金份额进行申购与赎回。

一、申购与赎回的场所

投资者办理基金份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的上海证券交易所会员单位办理，投资者需使用上海证券账户，通过上海证券交易所交易系统办理基金份额场内申购、赎回业务。

投资者办理基金份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人网上直销及直销中心柜台和场外基金销售机构。投资者需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理基金份额场外申购、赎回业务。

投资者应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理基金份额申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单将由基金管理人在《招募说明书》或其他公告中列明或基金管理人网站上公示。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在基金管理人网站予以公示。基金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份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

二、基金销售对象

个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

三、申购和赎回的开始日及开放时间

1、开放日及开放时间

申购起始日：2015 年 6 月 11 日

赎回起始日：2015 年 6 月 11 日

基金份额的申购、赎回开放日为上海证券交易所的交易日。基金投资者在开放日申请基金份额的申购和赎回。

场内业务办理时间为上海证券交易所的正常交易日的交易时间，场外业务办

理时间以各销售机构的规定为准。在《基金合同》约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求本基金暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券期货交易市场、证券期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额的申购、赎回或转换的价格。

四、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金净值为基准进行计算；

2、采用“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；

4、份额的赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资者通过上海证券交易所交易系统办理基金份额的场内申购、赎回业务时，需遵守上海证券交易所的相关业务规则；若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

6、基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

五、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购基金份额申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资人在提交基金份额赎回申请时，须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者应在 T+2 日后（包括该日）及时到销售机构规定的方式查询申请的确认情况。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请获得确认，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以中国证券登记结算有限责任公司的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用销售人规定的全额缴款方式。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

投资者赎回申请生效后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日的时间内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同和有关法律法规规定处理。

六、申购与赎回的限制

1、申购金额的限制

本基金场内单笔申购的最低金额为1,000元，超过1,000元的应为1元的整数倍（以上金额均含申购费），场外单笔申购的最低金额为1元（含申购费）。各代销机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

2、本基金不对投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额进行限制，但各代销机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各代销机构的业务规定为准。

3、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

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。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

七、申购费率和赎回费率

1、申购费率

（1）本基金的场外和场内申购费率根据申购金额设定如下：

申购金额（M）	申购费率	养老金特定客户申购费率
M<100万	1.20%	0.36%
100万≤M<200万	0.80%	0.24%
M≥200 万	每笔1,000元	每笔1,000元

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

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法

规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

2、本基金的赎回费用由赎回本基金的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金资产，对持续持有期长于7日（含）的投资者收取的赎回费，以不低于25%的比例归入基金财产，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

场外和场内的赎回费率如下：

赎回费	申请份额持有时间	赎回费率
	N<7日	1.50%
	7日≤N<1年	0.50%
	1年≤N<2年	0.25%
	N≥2年	0.00%

注：1年=365天，2年=730天

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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

5、办理本基金的场内申购、赎回业务应遵守上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

八、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式

本基金的场外申购和场内申购均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费

用和净申购金额。

（1）当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1＋申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日本基金的基金份额净值

（2）当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

申购费用＝固定金额

净认购金额=申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额/申购当日本基金的基金份额净值

投资者申购所得的场内份额先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的金额退还投资者；申购所得的场外份额按四舍五入的原则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。

例：某投资者投资 100,000 元通过场外申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.010 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	100,000 元
基金份额净值（NAV）	1.010 元
净申购金额	100,000/（1+1.2%）=98,814.23 元
申购费用	100,000-98,814.23＝1185.77 元
申购份额	98,814.23/1.010＝97835.87 份

例：某投资者投资 100,000 元通过场内申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.0100 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	100,000元
基金份额净值（NAV）	1.0100元
净申购金额	100,000/（1+1.2%）=98,814.23元
申购费用	100,000-98,814.23＝1,185.77元
申购份额	98,814.23/1.0100＝97,835.87份 场内份额保留到整数位，所以实际申购份额为97,835份
实际净申购金额	97,835×1.0100=98,813.35元

退款金额	100,000-1185.77-98,813.35=0.88元

2、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日本基金基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额＝赎回份数×T 日本基金净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用

例：某投资人持有本基金 50,000.00 份场外本基金，持有 0.8 年时决定赎回，假设赎回当日本基金净值 1.150 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额=50,000.00×1.150=57,500.00 元

赎回费用=57,500.00×0.5%=287.50 元

净赎回金额=57,500.00-287.50=57,212.50 元

即投资人赎回本基金 50,000.00 份场外本基金，持有 0.8 年，假设赎回当日本基金净值 1.150 元，则其获得的净赎回金额为 57,212.50 元。

3、本基金净值的计算

本基金净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此误差产生的损失或收益由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

T 日本基金净值＝T 日基金资产净值/T 日基金份额总数

九、申购和赎回的注册登记

1. 本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内申购的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

（1）登记在证券登记结算系统中的基金份额可以直接申请场内赎回或在上海证券交易所上市交易。

（2）登记在注册登记系统中的基金份额既可以直接申请场外赎回，也可以

通过跨系统转托管转至证券登记结算系统后赎回或在上海证券交易所上市交易。

2. 投资者 T 日申购基金份额成功后，正常情况下，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（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

3. 投资者 T 日赎回基金份额成功后，正常情况下，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益并办理相应的登记结算手续。

4. 基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整。基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

十、拒绝或暂停申购的情形及处理

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者对基金份额的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。

5、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产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

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

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

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、7、8 项暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

十一、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者对基金份额的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在规定媒介上刊登公告，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十二、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内，基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额) 超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定

全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金投资者的赎回全部申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付基金投资者的赎回申请有困难或认为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，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；基金投资者未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，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，并以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

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

（4）暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

（5）上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司对于发生巨额赎回

时的场内份额的处理方式另有规定的，按其规定执行。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

4、场内巨额赎回的处理方式按照中国证券登记结算有限公司有关业务规则执行。

十三、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

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

3、如发生暂停的时间超过 1 日，则基金管理人可以根据需要增加公告次数，但基金管理人须依照《信息披露办法》，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，或根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时可不再另行发布重新开放的公告。

十四、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金基金份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

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“第十部分、基金的侧袋机制”或相关公告。

十六、基金管理人可在不违反相关法律法规、不对基金份额持有人利益产生不利影响的前提下，根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

第十部分、基金的侧袋机制

(一)侧袋机制的实施条件

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

(二)侧袋机制的特定资产范围

本基金的特定资产由基金管理人充分审慎严格评估后确定。特定资产包括：

1、无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；

2、按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；

3、其他资产价值存在重大不确定性的资产。

(三)侧袋机制的实施程序

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

1、基金管理人对本基金是否符合侧袋机制的实施条件进行评估，制作合规性评估报告，并经内部程序决策通过。

2、基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询符合《证券法》规定的会计师事务所意见后，决定启用侧袋机制。

3、启用侧袋机制当日，基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。启用侧袋机制后，基金管理人应聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

4、基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案，并于启用侧袋机制后 5 个工作日内提交相关材料。

5、基金管理人应在启用侧袋机制的次日发布临时公告，在实施侧袋机制期间处置特定资产或发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。基金管理人应及时向基金销售机构提示侧袋机制启用的相关事宜。

6、在实施侧袋机制期间，基金管理人应当与基金销售机构共同及时向侧袋

实施期间申购或赎回基金的相关投资者传递信息，做好相应的风险揭示。

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

(四)侧袋机制的运作安排

1、特定资产处置清算

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

2、对基金申购赎回的影响

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

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

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

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

3、信息披露

(1)基金管理人应当暂停披露侧袋账户份额净值，对基金简称进行特殊标识。

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

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

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

4、实施侧袋账户期间的基金费用

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

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

(3)因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

(五)主袋账户的投资安排

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

2、基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

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

(六)基金托管人的职责

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

(七)相关风险提示

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

第十一部分、基金的投资

一、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证申万一带一路主题指数的有效跟踪。

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，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、权证、股指期货、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它金融工具，（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%－10%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资不高于基金资产净值的 3%。

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

三、投资理念

本基金管理人坚持指数化投资理念，以低成本投资于标的指数所表征的市场组合，以期获得标的指数所表征的市场平均水平的投资收益。

四、投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪

误差。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2、债券组合管理策略

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

3、金融衍生工具投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低调仓成本与跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

五、标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数为中证申万一带一路主题指数。

标的指数编制方法具体见本招募说明书的规定。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起 10 个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理

人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

本基金运作过程中，标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未做出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，及时对标的指数成份股的投资比例进行调整。

2、本基金的业绩比较基准为：中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

六、风险收益特征

本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

七、投资限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（1）承销证券；

（2）违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）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；

（7）依照法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

2、基金投资组合比例限制

（1）本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投

资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；

（2）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%，本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；

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

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

（8）本基金参与股票发行申购，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；

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

（10）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（11）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

①在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

②在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年

以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

④基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑤在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（12）本基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

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

（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）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第（7）、（10）、（13）、（14）项外，因证券期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本基金，不需要经基金份额持有人大会审议，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。如本基金增加投资品种，投资限制以法律法规和中

国证监会的规定为准。

八、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

九、基金管理人代表基金行使相关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相关权利，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、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

十一、基金投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据取自《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）2026 年第 2 季度报告》，报告截止日：2026 年 6 月 30 日。本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	222,209,854.45	93.98
	其中：股票	222,209,854.45	93.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	14,185,477.20	6.00
8	其他资产	42,876.24	0.02
9	合计	236,438,207.89	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,269,223.00	7.35
C	制造业	146,898,419.34	62.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,954,650.00	5.51
E	建筑业	1,305,696.00	0.56
F	批发和零售业	1,339,956.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	4,004,711.80	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,802,338.80	2.04
J	金融业	16,652,690.00	7.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,916,537.00	6.35
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,540,250.46	0.66
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	221,684,472.40	94.33

（2）报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	28,364.16	0.01
C	制造业	373,955.88	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,035.14	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,582.89	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,443.98	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	525,382.05	0.22

（3）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（1）报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)

1	603259	药明康德	117,900	14,679,729.00	6.25
2	300502	新易盛	21,500	13,050,500.00	5.55
3	300274	阳光电源	74,800	11,894,696.00	5.06
4	300750	宁德时代	28,000	11,004,280.00	4.68
5	600900	长江电力	409,300	10,834,171.00	4.61
6	600519	贵州茅台	8,900	10,550,861.00	4.49
7	000333	美的集团	137,280	10,368,758.40	4.41
8	601899	紫金矿业	403,200	10,136,448.00	4.31
9	300394	天孚通信	32,860	9,946,064.80	4.23
10	000651	格力电器	176,000	6,600,000.00	2.81

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	301666	大普微	418	239,091.82	0.10
2	001248	华润新能源	11,774	119,035.14	0.05
3	301682	宏明电子	247	39,505.18	0.02
4	001257	盛龙股份	1,122	28,364.16	0.01
5	301696	三瑞智能	175	18,340.00	0.01

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

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

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

（2）基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	24,828.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,048.21
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	42,876.24

（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

a)报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

b)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	239,091.82	0.10	限售期锁定
2	001248	华润新能源	119,035.14	0.05	新股未上市
3	301682	宏明电子	39,505.18	0.02	限售期锁定
4	001257	盛龙股份	28,364.16	0.01	限售期锁定
5	301696	三瑞智能	18,340.00	0.01	限售期锁定

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分、基金的业绩

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金成立以来的业绩如下：

项目	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2015 年 5 月 29 日（长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	-42.04%	3.30%	-37.69%	3.12%	-4.35%	0.18%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-14.86%	1.84%	-12.36%	1.72%	-2.50%	0.12%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	12.93%	0.82%	11.70%	0.80%	1.23%	0.02%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-25.87%	1.30%	-26.52%	1.28%	0.65%	0.02%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	18.39%	1.23%	17.36%	1.24%	1.03%	-0.01%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	25.75%	1.38%	15.17%	1.40%	10.58%	-0.02%
2015 年 5 月 29 日（长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	-38.50%	1.67%	-39.42%	1.61%	0.92%	0.06%

长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）成立以来的业绩如下：

项目	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2021 年 1 月 1 日（转型后新基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	6.14%	1.16%	0.10%	1.17%	6.04%	-0.01%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	-20.23%	1.20%	-22.20%	1.19%	1.97%	0.01%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	-7.47%	0.76%	-8.99%	0.77%	1.52%	-0.01%
2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	4.08%	1.29%	-0.18%	1.33%	4.26%	-0.04%
2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	23.05%	0.99%	18.81%	1.00%	4.24%	-0.01%

2026年1月1日至2026年6月30日	-1.21%	0.93%	-1.66%	0.94%	0.45%	-0.01%
2021年1月1日（转型后新基金合同生效日）至2026年6月30日	-0.89%	1.08%	-17.33%	1.09%	16.44%	-0.01%

注：本基金由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为2021年1月1日（即基金合同生效日）。

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

第十三部分、基金份额的非交易过户、转托管、定期定额投资、冻结、解冻及质押

（一）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人，或按法律法规或国家有权机关要求的方式执行。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

（二）基金的系统内转托管

1.系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

2. 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理本基金赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有本基金的系统内转托管。

3. 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理本基金场内赎回时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

（三）跨系统转托管

1. 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的本基金在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2. 本基金基金份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所的相关规定办理。

（四）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（五）基金的冻结、解冻与质押

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，以及基金注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。法律法规另有规定的除外。

基金管理人可以根据法律法规或监管机构的规定办理基金份额的质押业务，并制定相应的业务规则。如法律法规、注册登记机构或上海证券交易所的有关规则发生变化，本基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻的有关规则将相应调整。

（六）基金管理人可在不违反相关法律法规、不对基金份额持有人利益产生不利影响的前提下，根据具体情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

第十四部分、基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券、银行存款本息和基金应收的款项以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

第十五部分、基金资产估值

一、估值目的

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

二、估值日

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

三、估值原则

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

四、估值方法

1、证券交易所上市交易的有价证券的估值

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

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

（3）交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定

公允价格。

（4）交易所上市交易或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；

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、股票指数期货合约估值方法：

股票指数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。

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

7、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

8、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提

利息。

9、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-8 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

10、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

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，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

五、估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

六、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方约定的形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

七、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位) 发生差错时，视为基金份额净值错误。

本合同的当事人应按照以下约定处理：

1.差错类型

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

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

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

2.差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方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，由责任方承担；但若经诉讼或仲裁的终局裁判，基金财产未获得补偿的部分可列入基金费用项下的相关科目，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，基金管理人或基金托管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，则基金管理人或基金托管人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3.差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

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

4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

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

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

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

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

八、暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2.因不可抗力或其它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.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

九、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

本基金基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

十、特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十一、实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

第十六部分、基金的收益与分配

一、基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约。

二、基金净利润

基金净利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。基金期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

三、收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每份基金份额每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金场外份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红。本基金场内份额的收益分配方式仅为现金分红，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止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。

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 个工作日内在规定媒介公告并报中国证监会备案。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照本基金收益分配原则中有关规定执行。

七、实施侧袋机制期间的收益分配

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

第十七部分、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券、期货交易费用；

7、基金的开户费用；

8、基金上市费用及年费；

9、基金的银行汇划费用；

10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.0%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3－10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用根据《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》执行；

4、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支；

5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、实施侧袋机制期间的基金费用

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

五、基金管理费和基金托管费的调整

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

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十八部分、基金的会计与审计

一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、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；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定的方式确认。

二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

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。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

第十九部分、基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性规定》、《基金合同》及其他有关规定。

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币

元。

五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）《基金合同》、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金托管协议

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

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在 3 个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在 3 个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在规定网站、基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

4、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。

基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

（二）《上市交易公告书》

基金管理人应当在本基金的基金份额上市交易 3 个工作日前，将《上市交易公告书》登载在规定媒介上。

（三）基金净值信息

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或营业网点披露开放日的基金份额净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值。

（四）定期报告

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

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 3 个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载于规定网站上，将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。

2、基金中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 2 个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在规定网站上，将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

3、基金季度报告：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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额 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季度报告、中期报告、年度报告等基金定期报告“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本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

（五）临时报告与公告

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

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事件，包括：

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、基金终止上市交易、《基金合同》终止、基金清算；

3、转换基金运作方式、基金合并；

4、更换基金管理人、基金托管人基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

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

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

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

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

10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；

11、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；

12、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 ；

13、基金收益分配事项；

14、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；

15、基金份额净值估值错误达基金份额净值百分之零点五；

16、基金开始办理申购、赎回；

17、基金发生巨额赎回并延期办理；

18、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；

19、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、本基金上市交易、停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市；

21、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

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

（六）澄清公告

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

（七）清算报告

《基金合同》终止的，基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（八）实施侧袋机制期间的信息披露

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

（九）投资股指期货相关公告

在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

（十）投资资产支持证券相关公告

在基金年报及中期报告中披露基金管理人持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细；在基金季度报告中披露基金管理人持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前十名资产支持证

券明细。

（十一）基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

（十二）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

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，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

基金管理人、基金托管人除依法在规定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所和基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

八、暂停或延迟信息披露的情形

1、基金投资所涉及的证券期货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、出现会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的紧急事故的任何情况时；

5、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

第二十部分、风险揭示

（一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益的不确定性。市场风险主要包括：政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、国有股减持与流通政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。股市是国民经济的晴雨表。因此，宏观经济运行的周期性波动将会通过证券市场反映出来，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。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

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，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，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，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

6、与本基金投资于股指期货相关的风险。如因股指期货合约与标的指数波动不一致导致的基差风险以及股指期货合约之间价差异常变动可能导致的展期风险等。

7、与本基金投资资产支持证券相关的风险，包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会

影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

（三）流动性风险

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

1、基金申购、赎回安排

参见本招募说明书“第九部分、基金份额的申购与赎回”的相关规定。

2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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

3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

5、实施侧袋机制对投资者的影响

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

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

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

（四）信用风险

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，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

（五）本基金的特定风险

1、指数投资风险

本基金为股票指数型基金，标的指数为中证申万一带一路主题指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

（1）系统性风险

标的指数成份股的价格可能由于政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动。当中证申万一带一路主题指数下跌时，本基金面临基金净值与中证申万一带一路主题指数同步下跌的风险。

（2）投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金

无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

（3）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数为主题指数，并不代表整个股票市场，标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率存在偏离。

（4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资过程中存在流动性风险、交易成本和中证申万一带一路主题指数成份股调整等情况导致基金投资组合回报与标的指数回报存在跟踪偏离风险，主要影响因素可能包括：

1）基金运作过程中发生的费用，包括交易成本、市场冲击成本、管理费和托管费等；

2）当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

3）投资人申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

4）在指数化投资过程中，基金管理人对指数基金的管理能力，如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度；本基金将进行被动型的股票投资并通过多项风险控制方式降低跟踪风险。

（5）标的指数变更风险

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

（6）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差不超过0.35%，且年化跟踪误差不超过4%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

（7）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起10个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

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

（8）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

2、本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、和操作风险。具体为：

（1）市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资人带来的风险。

（2）流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

（3）基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。

（4）保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

（5）信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

（6）操作风险是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，

或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

3、本基金将资产支持证券纳入到投资范围中，投资于资产支持证券的风险主要包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险等，信用风险指发行主体违约的风险，是资产支持证券最大的风险。利率风险指由于利率发生变化和波动使得资产支持证券价格和利息产生波动，从而影响到基金业绩。流动性风险是由于资产支持证券交易不活跃导致的风险。提前偿付风险指由于发行方提前偿还所导致的收益率下降的风险。

（六）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如基金在交易时所采用的电脑系统可能因突发性事件或不可抗原因出现故障，由此给基金投资带来风险；

2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈等行为产生的违规风险；

4、人才流失风险，公司主要业务人员的离职如基金经理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；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

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

7、其他意外导致的风险。

第二十一部分、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、基金合并

本基金与其它基金合并，应当按照有关法律法规约定的程序进行。

二、《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

三、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

四、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、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、符合《证券法》规定的注册会计师、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。

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限不超过 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

五、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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

六、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

七、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

八、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，法律法规另有规定从其规定。

第二十二部分、基金合同的内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利和义务

（一）基金管理人的权利与义务

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通业务；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者

实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

（7）依法接受基金托管人的监督；

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

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上，法律法规另有规定从其规定；

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

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

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

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

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

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

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

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

本基金的基金托管人为中国银行股份有限公司。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括

但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户及投资所需的其他账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有

规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、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；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上，法律法规另有规定从其规定；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利与义务

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

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

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

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会的审议事项应由基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬和费率标准的除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）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。

2、在不违背法律法规和《基金合同》约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）在不损害现有基金份额持有人利益的情况下，在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率，或在不损害现有基金份额持有人利益的情况下，变更收费方式、调整基金份额类别的设置；

（4）在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；

（5）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（6）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

（7）基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整有关申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

（8）在不损害现有基金份额持有人利益的情况下，在法律法规和《基金合同》规定的范围内，基金推出新业务或服务；

（9）按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会以外的情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人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，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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。

5、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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30日报中国证监会备案。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。

（三）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，召集人应于会议召开前30日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（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；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管部门允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，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；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持

有人所代表的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）项中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代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在不与法律法规冲突的前提下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、重新召集基金份额持有人大会的条件。基金份额持有人大会应当有代表基金份额二分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前述比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表基金份额三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持

大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议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 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开

审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）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出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全

文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

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

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规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提前公告后，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。

三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合并

本基金与其它基金合并，应当按照有关法律法规约定的程序进行。

（二）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（三）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

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

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（四）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、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、符合《证券法》规定的注册会计师、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。

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限不超过 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

（五）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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（六）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（七）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（八）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。

四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交仲裁。仲裁机构为北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用、律师费用由败诉方承担。争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

第二十三部分、基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

本基金托管协议当事人基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人每个估值日后将投资于股票占非现金基金资产的比例发送给托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、权证、股指期货、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它金融工具，（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%－10%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资不高于基金资产净值的 3%。

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

2、对基金投融资比例进行监督：

（1）本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；

（2）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%，本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的且在本托管人处托管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；

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

（4）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20％；

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

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

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

（8）本基金参与股票发行申购，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；

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

（10）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（11）本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

①在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

②在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

④基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 85%；

⑤在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

（12）本基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

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

（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；本基金管理人承诺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与基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失；

（15）法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

除上述第（7）、（10）、（13）、（14）项外，因证券市场波动、期货市场波动、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基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于主袋账户。

如果法律法规对上述投资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，

但须提前公告，不需要经基金份额持有人大会审议。

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

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

（四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

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

三、基金管理人对基金托管人的业务监督和核查

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

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知

基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

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

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

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

（二）基金的银行账户的开设和管理

1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

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

3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

（三）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在符合条件的存款银行的指定营业网点开立存款账

户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

（四）基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

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

2、本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

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

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

（五）债券托管专户的开设和管理

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

（六）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

（七）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金

管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年，法律法规另有规定的从其规定。

对于无法取得两份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章的合同传真件，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

（一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息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估值日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 4 位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

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

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

（二）基金会计核算

1、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、登记和保管基金的全套账册，对双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。

2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

3、基金财务报表和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；《基金合同》生效后，招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登

载在规定网站上。招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次；基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点。基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书和基金产品资料概要。基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。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，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。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，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金合同生效不足两个月的，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。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应 3 个工作日内进行复核，并将复核结果通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果通知基金管理人。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复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以双方商定的方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双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。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认，双方各自留存一份。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证监会备案。

（三）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

六、基金份额持有人名册的保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；

2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；

3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；

4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

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

（三）基金份额持有人名册的保管

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

七、争议解决方式

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

争议处理期间，当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更

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

（二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

1、《基金合同》终止；

2、本基金更换基金托管人；

3、本基金更换基金管理人；

4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

第二十四部分、对基金份额持有人的服务

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

一、电话服务

长盛基金管理有限公司客户服务电话：（010）8649 7888、400-888-2666。

客户服务中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客服电话人工服务时间为交易日的 8:30-17:00。

二、在线服务

基金份额持有人可通过基金管理人网站、微信公众号等渠道获得在线服务。在线客服人工服务时间为交易日的 8:30-17:00。

三、资讯服务

基金份额持有人可通过基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息，包括基金法律文件、产品信息、最新动态、热点问题等。

长盛基金管理有限公司网址： www.csfunds.com.cn

长盛基金管理有限公司客户服务电子邮箱： services@csfunds.com.cn

四、对账单服务

基金管理人根据持有人账户情况和定制情况定期或不定期发送对账单，至少每年度以电子邮件形式主动向长盛直销系统份额持有人提供基金保有情况。但由于基金份额持有人在基金管理人系统中资料信息不完整或不准确等原因导致无法送出的除外。

五、投诉建议受理

基金份额持有人可以通过基金管理人网站客户服务电话、在线客服、电子邮箱、信函传真等渠道或方式对基金管理人和销售机构进行投诉或提出建议。

第二十五部分、其他应披露事项

其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露日期
1	本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项	
2	最近 3 年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚	
3	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	2025/10/17
4	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	2025/10/17
5	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 3 季度报告提示性公告	2025/10/25
6	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)2025 年第 3 季度报告	2025/10/25
7	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	2026/1/15
8	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	2026/1/22
9	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)2025 年第 4 季度报告	2026/1/22
10	长盛基金管理有限公司旗下基金2025年年度报告提示性公告	2026/3/28
11	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)2025 年年度报告	2026/3/28
12	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	2026/4/15
13	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	2026/4/22
14	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)2026 年第 1 季度报告	2026/4/22
15	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠的公告	2026/4/22
16	长盛基金管理有限公司关于调整长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)基金经理的公告	2026/6/10
17	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	2026/6/11
18	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	2026/6/11
19	长盛基金管理有限公司关于调整长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)基金经理的公告	2026/7/3
20	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	2026/7/7
21	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	2026/7/7

22	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)2026 年第 2 季度报告	2026/7/21
23	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 2 季度报告提示性公告	2026/7/21
24	长盛基金管理有限公司旗下基金2026年中期报告提示性公告	2026/8/29
25	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)2026 年中期报告	2026/8/29

第二十六部分、招募说明书的存放及查阅方式

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

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（http://www.csfunds.com.cn）查阅和下载招募说明书。

第二十七部分、备查文件

（一）《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》

（二）《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》

（三）法律意见书

（四）基金管理人业务资格批件和营业执照

（五）基金托管人业务资格批件和营业执照

（六）中国证监会规定的其他文件

以上第（六）项备查文件存放在基金托管人的办公场所，其他文件存放在基金管理人的办公场所。基金投资者在营业时间内可免费查阅，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。

长盛基金管理有限公司

2026年10月16日