

# 长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 之金融地 A 与金融地 B 基金份额 上市交易公告书

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

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2015 年 6 月 26 日

公告日期：2015 年 6 月 23 日

# 目 录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的转型与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况.....	8
五、基金主要当事人简介.....	9
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	13
八、基金投资组合.....	14
九、重大事件揭示.....	18
十、基金管理人承诺.....	18
十一、基金托管人承诺.....	19
十二、备查文件目录.....	19
附录 基金合同摘要.....	20

## 一、重要声明与提示

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之金融地 A 与金融地 B 基金份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、深圳证券交易所（以下简称“深交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2015 年 5 月 22 日刊登在深圳证券交易所网站（[www.szse.cn](http://www.szse.cn)）以及长盛基金管理有限公司网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）的《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）和《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

## 二、基金概览

1. 基金名称：长盛中证金融地产指数分级证券投资基金
2. 基金类型：股票型
3. 基金运作方式：契约型开放式
4. 本基金采取分级方式运作，本基金的基金份额包括长盛中证金融地产指

数分级证券投资基金之基础份额（场内简称“金融地产”，基金代码 160814）、长盛中证金融地产指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（场内简称“金融地 A”，基金代码 150281），与长盛中证金融地产指数分级证券投资基金之积极收益类份额（场内简称“金融地 B”，基金代码 150282）。此三类基金份额分配不同的基金代码，所代表的基金资产合并运作。其中，金融地 A 份额与金融地 B 份额在存续期内始终保持 1:1 的份额配比不变。

5. 本基金的存续期为不定期。

6. 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额，将被确认为金融地产场外份额。投资者场内认购所得的金融地产份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分拆为金融地 A 份额与金融地 B 份额。基金合同生效后，投资者认购所得的金融地产场内份额的自动分拆，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

7. 基金合同生效后，金融地产份额（场内简称“金融地产”，基金代码 160814）只可以进行场内与场外的申购和赎回，不上市交易。金融地 A 份额（场内简称“金融地 A”，基金代码 150281）与金融地 B 份额（场内简称“金融地 B”，基金代码 150282）只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

8. 金融地产份额的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式，申购或赎回金融地产份额（场内简称“金融地产”，基金代码 160814）。办理金融地产份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。办理金融地产份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。本基金不对金融地 A 份额与金融地 B 份额单独开放场内申购、赎回。

9. 金融地产份额的跨系统转托管：通过场内、场外方式认/申购金融地产份额的基金份额持有人可以通过认/申购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。

10. 场内份额配对转换：场内份额配对转换是指本基金场内的金融地产份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。分拆指场内的金融地产份额按照 1:1 的基金份额配比分拆成金融地 A 份额与金融地 B 份额的行为。合

并指金融地 A 份额与金融地 B 份额按照 1: 1 的基金份额配比合并成金融地产场内份额的行为。

11. 基金份额折算：基金份额定期折算的频率为每年折算 1 次。基金份额不定期折算的条件是金融地产份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，或金融地 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“第二十部分 基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

12. 基金份额总额：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金的基金份额总额为 726,147,822.87 份，其中，金融地产份额为 530,129,756.87 份，金融地 A 份额为 98,009,033.00 份，金融地 B 份额为 98,009,033.00 份。

13. 基金份额净值：截至 2015 年 6 月 18 日，金融地产份额的基金份额净值为 0.983 元，金融地 A 份额的基金份额参考净值为 1.000 元，金融地 B 份额的基金份额参考净值为 0.966 元。

14. 本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：金融地 A，基金代码：150281；金融地 B，基金代码：150282。

15. 本次上市交易份额：截至 2015 年 6 月 18 日，金融地 A：98,009,033.00 份；金融地 B：98,009,033.00 份。

16. 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

17. 上市交易日期：2015 年 6 月 26 日

18. 基金管理人：长盛基金管理有限公司

19. 基金托管人：中国银行股份有限公司

20. 本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

### 三、基金的募集与上市交易

#### (一) 本基金募集情况

1. 基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]759 号

2.发售日期：2015年5月27日至2015年6月10日

3.发售面值：1.00元人民币

4.发售方式：场外、场内认购

5.发售机构：

（1）场内发售机构：

本基金场内发售的机构为具有基金代销业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站([www.szse.cn](http://www.szse.cn))。

（2）场外发售机构：

1) 直销机构

直销机构包括长盛基金管理有限公司直销中心及本公司网上交易系统。

2) 代销机构

中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、申万宏源证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国元证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、中航证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、江海证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、五矿证券有限公司、德邦证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海好买

基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、上海联泰资产管理有限公司。

6.验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

7.认购资金总额及入账情况：

本次长盛中证金融地产指数分级证券投资基金募集的有效认购户数为7,959户，有效净认购金额为人民币725,950,498.20元，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币197,324.67元。

上述资金中，场内首次发行募集资金及其利息为人民币196,018,066.00元，场外首次发行募集资金及其利息为人民币530,129,756.87元，募集资金已于2015年6月15日全额划入本基金通过基金托管人中国银行股份有限公司开立的长盛中证金融地产指数分级证券投资基金托管专户。

按照每份基金份额初始面值1.00元计算，本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计197,324.67份，已全部计入基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。其中，募集期间基金管理人的从业人员认购本基金0份，占基金总份额比例为0.00%；基金管理人未运用固有资金认购本基金；基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未认购本基金。本基金的基金经理未认购本基金。

8. 本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，长盛基金管理有限公司已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2015年6月16日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

9. 基金合同生效日：2015年6月16日

10.基金合同生效日的基金份额总额：726,147,822.87份

## （二）本基金上市交易的主要内容

1. 基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上〔2015〕293号
2. 上市交易日期：2015年6月26日
3. 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4. 本次上市的基金份额简称及代码：金融地 A，基金代码：150281；金融地 B，基金代码：150282。
5. 本次上市交易份额：截至 2015 年 6 月 18 日，金融地 A：98,009,033.00 份；金融地 B：98,009,033.00 份。
6. 基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布金融地产份额的基金份额净值以及金融地 A 份额、金融地 B 份额的基金份额参考净值，并在深交所行情发布系统揭示。
7. 未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的金融地产份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为金融地 A 份额和金融地 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的金融地产份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为金融地 A 份额和金融地 B 份额即可上市流通。
8. 本基金开通跨系统转托管业务日期：2015 年 6 月 26 日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

### （一）本基金持有人户数

截至 2015 年 6 月 18 日，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金之金融地产份额的持有人总户数为 6703 户，其中场外持有人总户数为 6703 户；金融地 A 份额持有人总户数为 1256 户，全部为场内持有人；金融地 B 份额持有人总户数为 1256 户，全部为场内持有人；金融地产份额平均每户持有的场外基金



份额为 79,088.43 份，金融地 A 份额平均每户持有的场内基金份额为 78,032.67 份，金融地 B 份额平均每户持有的场内基金份额为 78,032.67 份。

## （二）本基金持有人结构

1. 截至 2015 年 6 月 18 日，场内基金份额持有人结构如下：

金融地 A 份额：场内机构投资者持有的基金份额 16,515,742.00 份，占比 16.85%；场内个人投资者持有的基金份额 81,493,291.00 份，占比 83.15%。

金融地 B 份额：场内机构投资者持有的基金份额 16,515,742.00 份，占比 16.85%；场内个人投资者持有的基金份额 81,493,291.00 份，占比 83.15%。

2. 截至 2015 年 6 月 18 日，本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 0 份，占该基金总份额的比例为 0%；本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人未持有本基金；本基金的基金经理未持有本基金。

## （三）截至 2015 年 6 月 18 日，本次上市交易的金融地 A、金融地 B 基金份额 前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有金融地 A 份额	占金融地 A 总份额比例	持有金融地 B 份额	占金融地 B 总份额比例
1	上海大正投资有限公司	8,500,413.00	8.67%	8,500,413.00	8.67%
2	中国银河证券股份有限公司	5,000,194.00	5.10%	5,000,194.00	5.10%
3	赵峰	2,750,107.00	2.81%	2,750,106.00	2.81%
4	吕爱平	2,500,145.00	2.55%	2,500,146.00	2.55%
5	周少品	1,800,087.00	1.84%	1,800,087.00	1.84%
6	中国银河证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,155,053.00	1.18%	1,155,055.00	1.18%
7	齐瑞海	1,085,052.00	1.11%	1,085,052.00	1.11%
8	郭维	1,050,041.00	1.07%	1,050,040.00	1.07%
9	天津水泉生物科技有限公司	1,000,048.00	1.02%	1,000,049.00	1.02%
10	王豪	900,034.00	0.92%	900,035.00	0.92%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：高新

电话：（010）82019988

传真：（010）82255988

联系人：叶金松

### 2、经营概况

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6 号文件批准，于 1999 年 3 月 26 日成立，注册资本为人民币 18900 万元。截至目前，基金管理人股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%；新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。截至 2015 年 6 月 18 日，基金管理人共管理三十九只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

公司目前下设二十三个部门、分公司及营销中心和两个全资子公司，分别是：权益投资部、研究部、交易部、国际业务部、社保业务管理部、固定收益部、专户理财部、产品开发部、市场销售总部、电子商务部、北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司、华南营销中心、业务运营部、信息技术部、财务会计部、人力资源部、总经理办公室、监察稽核部、风险管理部以及长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。

权益投资部主要负责境内公募基金的投资组合管理；研究部主要负责行业与上市公司研究，投资备选库建立、维护与更新；交易部主要负责完成基金经理、组合经理及投资经理下达的交易指令；国际业务部主要负责 QDII 产品的投资运作管理及 QFII 投资顾问服务；社保业务管理部主要负责公司社保组合的

投资管理工作；固定收益部主要负责公司固定收益产品的投资管理与研究工作；专户理财部主要负责特定资产管理业务的客户营销和服务、产品开发设计和投资管理工作；产品开发部主要负责基金新产品的开发报批及产品维护工作；市场销售总部主要负责基金销售策略及基金销售计划制订、客户服务、销售渠道管理等；电子商务部主要负责制定及实施公司品牌宣传及市场推广计划；北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司和华南营销中心主要负责所辖区域的营销策划与基金销售工作；业务运营部主要负责基金核算与估值、开放式基金注册与登记，以及资金清算等工作；信息技术部主要负责公司信息系统的日常运行与维护，以及相关系统的规划与开发等；财务会计部主要负责公司财务管理工作；人力资源部主要负责公司战略及人力资源管理；总经理办公室主要负责公司行政事务的管理；监察稽核部主要负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；风险管理部主要负责对投资风险的管理与控制。长盛基金（香港）有限公司可开展香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四类（就证券提供意见）和第九类（提供资产管理）牌照所允许的业务；长盛创富资产管理有限公司的业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。

截至 2015 年 6 月 18 日，公司共有员工 156 人，其中具有硕士及以上学历的员工占 62%，具有本科学历的员工占 35%。研究员和基金经理全部拥有硕士及以上学历，公司员工平均年龄为 35 岁，平均金融从业年限 9 年。公司主要业务部门人员全部具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。

### 3、本基金基金经理

王超先生，1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员，从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理。现任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理。

## （二）基金托管人

### 1、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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：（010）66594942

### 2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110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（一对多、一对一）、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。

### 3、证券投资基金托管情况

截至2015年3月31日，中国银行已托管328只证券投资基金，其中境内基金303只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，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。

### （三）基金验资机构

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：吴港平

电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

经办注册会计师：汤骏、贺耀

联系人：贺耀

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附录：基金合同摘要。

## 七、基金财务状况

深圳证券交易所本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金截至2015年6月18日资产负债表如下：

单位：人民币

元

资产	期末数	负债和所有者权益	期末数
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	447,691,242.63	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	407,831,949.49	卖出回购金融资产款	-

其中：股票投资	407,831,949.49	应付证券清算款	141,494,243.82
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	39,871.53
基金投资	-	应付托管费	8,771.73
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	382,147.81
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	43,557.03	应付利息	-
应收股利	14,146.55	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	4,038.63
其他资产	197,324.67	负债合计	141,929,073.52
		所有者权益：	
		实收基金	726,147,822.87
		未分配利润	-12,298,676.02
		所有者权益合计	713,849,146.85
资产合计：	855,778,220.37	负债与持有人权益总计：	855,778,220.37

## 八、基金投资组合

截至 2015 年 6 月 18 日，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的投资组合如下：

### （一）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	407,831,949.49	47.66
	其中：股票	407,831,949.49	47.66
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	447,691,242.63	52.31
7	其他资产	255,028.25	0.03
8	合计	855,778,220.37	100.00

## (二) 按行业分类的股票投资组合

### 1、指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	337,218,960.12	47.24
K	房地产业	66,766,081.57	9.35
L	租赁和商务服务业	721,770.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	3,125,137.80	0.44
	<b>合计</b>	<b>407,831,949.49</b>	<b>57.13</b>

### 2、积极投资按行业分类的股票投资组合

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有积极投资的股票。

## (三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

### 1、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

股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占净值比(%)
601318	中国平安	451,800	37,933,128.00	5.31
600036	招商银行	1,377,263	25,878,771.77	3.63
600030	中信证券	656,700	19,635,330.00	2.75
600016	民生银行	1,822,440	17,641,219.20	2.47
601166	兴业银行	954,000	17,181,540.00	2.41

600837	海通证券	675,247	16,658,343.49	2.33
600000	浦发银行	933,900	16,548,708.00	2.32
601939	建设银行	2,166,835	14,517,794.50	2.03
601328	交通银行	1,637,700	13,298,124.00	1.86
000002	万科A	809,316	11,476,100.88	1.61

2、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

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有积极投资的股票。

(四) 按券种分类的债券投资组合：

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有债券。

(五) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细：

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有债券。

(六) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有贵金属。

(八) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有权证。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

1、本基金本报告期内未发生股指期货投资。

2、本基金投资股指期货的投资政策

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。

#### （十）本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

#### （十一） 投资组合报告附注

**1. 声明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（2015年6月18日）前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

（1）本基金跟踪的标的指数为金融地产指数，配置了指数成分股海通证券。

根据2015年1月16日中国证券监督管理委员会2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对海通证券采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

（2）本基金跟踪的标的指数为金融地产指数，配置了指数成分股中信证券。

根据2015年1月16日中国证券监督管理委员会2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

（3）本基金跟踪的标的指数为金融地产指数，配置了指数成分股中国平安。

根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》，决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2867万元，并处以440万元罚款。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

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

**2. 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。**

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

**3. 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	14,146.55
4	应收利息	43,557.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	197,324.67
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	255,028.25

**4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有可转换债券。

**5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

(1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至 2015 年 6 月 18 日，本基金未持有积极投资的股票。

**6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**九、重大事件揭示**

本基金自基金合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、备查文件目录

（一）中国证监会准予长盛中证金融地产指数分级证券投资基金注册的文

件；

- (二) 《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》；
- (三) 《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金托管协议》；
- (四) 《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

以上第（七）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

2015年6月23日

## 附录 基金合同摘要

### 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认购、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认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，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、半年度和年度基金报告；

(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；

(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) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利

息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 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、半年度和年度基金报告出具意见，说  
明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如  
果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应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；

(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和义务

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。

长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的每份基金份额按基金合同约定在其份额类别内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) 缴纳基金认购、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各种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分别由长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的同一级别内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) 终止长盛中证金融地产 A 份额与长盛中证金融地产 B 份额的运作；
- (9) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (10) 变更基金份额持有人大会程序；
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(12) 单独或合计持有长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额各自份额 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；

本基金在存续期内，依据基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的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或类似表述均指“单独或合计持有长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额各自的基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人”或其类似表述。

- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(14) 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、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、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调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(8) 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，在指定媒介公告。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书符合法律法规、《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，长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额有效的基金份额不少于本基金在权益登记日各自基金总份额的 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，基金份额持有人所持有长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的 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书符合法律法规、《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长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额各自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长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额各自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，则由出席大会的长盛中



证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的基金份额持有人和代理人所持各自表决权的 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长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持各自表决权的 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长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的基金份额持有人或其代理人所持各自表决权的 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个工作日内在指定媒介上公告。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) 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、基金收益分配原则、执行方式**

#### **(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**

在长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的运作期内，本基金（包括长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，如果终止长盛中证金融地产 A 份额与长盛中证金融地产 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

### **四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例**

#### **(一) 基金费用的种类**

##### **1、基金管理人的管理费；**

- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的标的指数使用许可费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《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；
  
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的开户费用；
- 9、基金上市费用及年费；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、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：

$$H=E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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 0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

### 3、标的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按照前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率进行计提，且收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计算，逐日累计，每季支付一次，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的指数使用费。基金管理人可根据指数许可使用合同和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 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

下列费用不列入基金费用：

- 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；
- 4、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）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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### （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%，实现对中证金融地产指数的有效跟踪。

#### （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%，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。

### （五）标的指数与业绩比较基准

#### 1、标的指数

本基金的标的指为中证金融地产指数。

如果标的指数被停止编制及发布,或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据

审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

2、本基金的业绩比较基准为：中证金融地产指数收益率×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，由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。

运作过程中，本基金共有三类基金份额，分别为长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额。其中长盛中证金融地产份额为普通的股票型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征；长盛中证金融地产 A 份额的风险与预期收益较低；长盛中证金融地产 B 份额采用了杠杆式的结构，风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

#### （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其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

### 3、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%；

(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) 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。

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。

### 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

#### （一）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。

#### （二）基金资产净值、基金份额净值（或基金份额参考净值）公告

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各级基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各级基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）。基金管理人应当在前款规定的最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、各级基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）登载在指定媒介和网站上。

## **七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式**

### **（一）《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指定媒介公告。

### **（二）《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、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### **（三）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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金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为 6 个月。

#### (四) 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。

#### (五) 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。

#### (六) 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。

#### (七) 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。

### 八、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。

#### **九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

《基金合同》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。