

# 长城久鼎保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要(首次更新)

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

二〇一七年三月

长城久鼎保本混合型证券投资基金经 2016 年 3 月 7 日中国证券监督管理委员会证监许可[2016]445 号文注册募集。基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效。

## 重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现，本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、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。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 1 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。一、基金管理人

### （一）基金管理人情况

- 1、名称：长城基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 3、办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 4、法定代表人：何伟
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2001 年 12 月 27 日 7、电话：0755-23982338 传真：0755-

23982328

8、联系人：袁江天

9、管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金等三十九只基金。

10、客户服务电话：400-8868-666

11、注册资本：壹亿伍仟万元人民币

12、股权结构：

持股单位 占总股本比例

长城证券股份有限公司 47.059%

东方证券股份有限公司 17.647%

中原信托有限公司 17.647%

北方国际信托股份有限公司 17.647%

合计 100%

(二) 基金管理人主要人员情况

1. 董事、监事及高管人员介绍

## （1）董事

何伟先生，董事长，硕士。现任长城证券股份有限公司总裁、党委副书记。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。

熊科金先生，董事、总经理，硕士。曾任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。

范小新先生，董事，博士，高级经济师。现任长城证券股份有限公司副总经理、党委委员、纪委书记。曾任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。

杨玉成先生，董事，硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，东方金融控股（香港）有限公司董事长，上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师，君安证券有限公司证券投资部总经理助理，上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，东方证券股份有限公司财务总监、副总经理，申能集团财务有限公司董事、总经理。

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

金树良先生，董事，硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

王连洲先生，独立董事，现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行

总行印制管理局工作，1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。

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

万建华先生，独立董事，硕士。现任证通股份有限公司董事长。曾任中国人民银行资金管理司处长，招商银行总行常务副行长兼上海分行行长（期间兼任长城证券股份有限公司董事长、国通证券有限责任公司（现招商证券股份有限公司）董事长），中国银联股份有限公司总裁，上海国际集团总经理，国泰君安证券股份有限公司董事长。

鄢维民先生，独立董事，学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任，深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长，深圳市证券管理办公室公司审查处处长，招银证券公司副总经理。

## （2）监事

吴礼信先生，监事会主席，会计师、中国注册会计师（非执业）。现任长城证券股份有限公司董事会秘书、财务总监。曾任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券股份有限公司，任财务部总经理。

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

张令先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理。

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

袁江天先生，监事，博士。现任长城基金管理有限公司董事会秘书兼综合管理部总经理。曾任职于广西国际信托投资公司投资管理部、国海（广西）证券有限责

任公司投资银行部、证券营业部、总裁办、北方国际信托投资股份有限公司博士后工作站。

王燕女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理、综合管理部副总经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作，2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

### （3）高级管理人员

何伟先生，董事长，简历同上。

熊科金先生，董事、总经理，简历同上。

彭洪波先生，副总经理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理，硕士。曾就职于长城证券股份有限公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理。

桑煜先生，副总经理兼市场开发部总经理、广州管理部总经理，学士。曾任职于中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理、综合管理部总经理、公司总经理助理。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理，硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司工作，历任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理、“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理、“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理。

卢盛春先生，副总经理兼机构理财部总经理，硕士。曾就职于中国人民银行江西省分行、交通银行海南分行、海通证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、西北证券有限责任公司、华商基金管理有限公司（筹备组）。2003年进入长城基金管理有限公司，历任上海分公司总经理、北京分公司总经理、公司总经理助理。

车君女士，督察长、监察稽核部总经理，硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、

副处长、正处级调研员等职务。

## 2. 本基金基金经理简历

陈良栋先生，清华大学微电子学与经济学双学士、清华大学电子科学与技术硕士。具有6年证券从业经历。2011年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理助理。自2015年11月27日至今任“长城保本混合型证券投资基金”和“长城久祥保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年3月30日至今任“长城久安保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月12日至今任“长城久益保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年8月25日至今任“长城久鼎保本混合型证券投资基金”基金经理。

马强先生，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学计算机科学与技术专业学士、北京大学计算机系统结构专业硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”、“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”和“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理。自2015年6月24日至今任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2015年12月15日至今任“长城久鑫保本混合型证券投资基金”和“长城新策略灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2016年4月15日至今任“长城新优选混合型证券投资基金”基金经理，自2016年4月28日至今任“长城久益保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月20日至今任“长城久安保本混合型证券投资基金”和“长城久润保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年7月26日至今任“长城久鼎保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年11月4日至今任“长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金”基金经理。

## 3. 本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。

杨建华先生，投资决策委员会执行委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理。

钟光正先生，投资决策委员会委员，公司总经理助理、固定收益部总经理、基金经理。

吴文庆先生，投资决策委员会委员，公司研究部总经理、基金经理。

## 4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、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

托管部门信息披露联系人：王永民

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。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2016年12月31日，中国银行已托管534只证券投资基金，其中境内基金500只，QDII基金34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、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40-41层

法定代表人：何伟

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

## 2. 代销机构

### (1) 中国银行股份有限公司

住所：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：田国立

联系人：宋亚平

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

### (2) 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：姜建清

联系人：李鸿岩

电话：010-66107913

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

### (3) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网站：www.cmbchina.com

### (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：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：胡迪峰

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(5) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：021-62677777

传真：021-62569070

联系人：陈晓瑾

客户服务电话：95561

网站：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(6) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：丰靖

电话：010-65550827

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

网站：<http://bank.ecitic.com/>

(7) 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：董文标

电话：010-56367136

传真：010-57092611

联系人：穆婷

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(8) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

传真：021-63604199

联系人：唐苑

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

（9）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

传真：021-50979375

客户服务电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

（10）东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路 2 号

办公地址：东莞市南城路 2 号

法定代表人：何沛良

联系人：杨亢

电话：0769-22866270

传真：0769-22320896

客服电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

（11）泉州银行股份有限公司

注册地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

联系电话：0595-22551071

联系人：董培姗

客服电话：400-8896-312

公司网站：[www.qzccb.com](http://www.qzccb.com)

（12）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

客服电话：95574

公司网站：www.nbc.cn

（13）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

客户服务电话：4008888108

网站：www.csc108.com

（14）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

??法定代表人：王开国

电话：021-23219991 ?????

联系人：程丽辉

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

（15）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

客户服务电话：4008888666

网站：www.gtja.com

（16）申万宏源证券股份有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33388215

传真：021-33388224

客服电话：95523/4008895523/4008000562

网址：www.swhysc.com

（17）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-38565785

联系人：谢高得

客户服务热线：95562

网站：www.xyzq.com.cn

（18）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：www.cgws.com

（19）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82960167

传真：0755-82943237

联系人：黄婵君

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

（20）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-33830395

客户服务电话：4008816168

网站：www.pingan.com

（21）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：戴蕾

电话：0791-86868681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网站：www.avicsec.com

（22）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼（深圳总部）

法定代表人：张慎修

联系人：张曼

电话：010-52723273

客户服务电话：4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

（23）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

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

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（24）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

法定代表人：曾小普

联系电话：0791-86281305

联系人：周欣玲

客户服务电话：4008222111

网站：www.gsstock.com

（25）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：杜庆平

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

网站：www.bhzq.com

（26）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303

网站：www.gzs.com.cn

（27）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：www.csco.com.cn

（28）中泰证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（29）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

（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 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（31）中国中投证券有限责任公司

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 层-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 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008、95532

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（32）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406649

传真：029-87406387

联系人：刘莹

客服热线：029—87419999

网址：[www.westsecu.com.cn](http://www.westsecu.com.cn)

（33）长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：4008-888-999 或 95579

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（34）国融证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈文彬

电话：010-83991888

传真：010-88086637

客户服务电话：400-660-9839

网址：[www.grzq.com](http://www.grzq.com)

（35）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客户服务电话：95548



网站: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(36) 华融证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 8 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

法定代表人: 祝献忠

联系人: 李慧灵

联系电话: 010-58315221

传真: 010-58568062

客服电话: 010-58568118

公司网站: [www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

(37) 大同证券有限责任公司

注册地址: 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址: 山西省太原市长治路 111 号世贸中心 A 座 13 层

法定代表人: 董祥

联系人: 薛津

客户服务热线: 400-7121-212

网址: [www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

(38) 东兴证券股份有限公司

住所: 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: 徐勇力

联系人: 汤漫川

电话: 010-66555316

传真: 010-66555246

客服电话: 400-8888-993

公司网站: [www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

(39) 信达证券股份有限公司

注册(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: 高冠江

联系人: 唐静

联系电话: 010-63081000

传真: 010-63080978

客服电话: 400-800-8899

公司网址: [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(40) 西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

公司网站：www.swsc.com.cn

(41) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李学东

电话：010-85679888

传真：010-85679535

联系人：秦朗

客服电话：400-910-1166

网站：www.cicc.com.cn

(42) 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

法定代表人：张磊

联系人：洪成

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客服电话：400-990-8826

公司网站：www.citicsf.com

(43) 申万宏源西部证券有限公司

住所：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：李季

联系人：李巍

传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562

网址: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(44) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人: 薛峰

联系人: 童彩平

电话: 0755-33227950

传真: 0755-33227951

客服电话: 4006-788-887

公司网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(45) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

联系人: 朱晓超

联系电话: 021-60897840

客服电话: 4000-766-123

公司网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(46) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人: 汪静波

联系人: 徐诚

联系电话: 021-38509636

客服电话: 400-821-5399

公司网站: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(47) 上海天天基金销售有限公司

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人: 其实

联系人: 高莉莉

联系电话: 020-87599121

客服电话: 400-1818-188

公司网站: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(48) 众升财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-059-8888

公司网站：www.zscffund.com

（49）北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

联系电话：010-62020088

客服电话：400-888-6661

公司网站：www.myfund.com

（50）北京增财基金销售有限公司

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：王昌庆

联系人：张蕾

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网站：www.zcvc.com.cn

（51）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：吴阿婷

联系电话：0755-82721106

客服电话：400-9200-022

公司网站：licaike.hexun.com

（52）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

联系人：胡锴隽

联系电话：021-20613635

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(53) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路6号

法定代表人：肖雯

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

(54) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务热线：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

(55) 上海中正达广投资管理有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

联系电话：021-33768132

客服电话：4006767523

网址：www.zzwealth.cn

(56) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

法定代表人：李兴春

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533-3011

客服电话：400-921-7755

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(57) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期418室

法定代表人：齐小贺

联系人：陈勇军

电话：0755-83999913

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

(58) 深圳金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼?

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

电话：0755-66892301

传真：0755-66892399

客服电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

(59) 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1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：马怡

电话：010-56282140

客服电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

(60) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

法定代表人：陈超

联系人：徐伯宇

电话：010 8918 9285

传真：010-89188000

客服电话：4000988511/ 4000888816

网址：kenterui.jd.com

(61) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

联系人：王峰

电话：025-66996699-887226

客服电话：955177

网址：www.snjijin.com

（62）上海万得投资顾问有限公司

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：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：13818306630

客服电话：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

基金管理人可根据业务发展需要，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）基金注册登记机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：何伟

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍

客户服务电话：400-8868-666

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京市中伦律师事务所

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 36-37 层

负责人：张学兵

电话：0755-33256666

传真：0755-33206888

联系人：李雅婷

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

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

执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：李妍明

四、基金的名称

长城久鼎保本混合型证券投资基金

五、基金的类型和运作方式

基金的类型：保本混合型

基金的运作方式：契约型开放式

六、基金的保本

一、保本

在第一个保本周期到期日，如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于认购保本金额（差额部分即为保本赔付差额），基金管理人应补足该差额，并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人；第二个保本周期起的后续各保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额，由基金管理人根据当期有效的《基金合同》或基金管理人与保本义务人签署的《保证合同》或《风险买断合同》的约定将该差额支付给基金份额持有人。

认购保本金额：基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。

过渡期申购的保本金额：基金份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和。

从上一保本周期转入的保本金额：基金份额持有人从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值。

基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用保本条款。



## 二、保本周期

本基金的保本周期一般为3年。第一个保本周期自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。在第一个保本周期内，如果基金份额累计净值收益率连续15个工作日达到或超过保本周期目标收益率，则管理人将在基金份额累计净值收益率连续达到或超过保本周期目标收益率的第15个工作日当日起10个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期。如果保本周期提前到期的，则第一个保本周期为自《基金合同》生效之日起至管理人公告的保本周期提前到期日止，但保本周期到期日不晚于《基金合同》生效之日起3个公历年后的对应日（如为非工作日，则顺延至下一工作日）；基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期的起始时间

## 三、保本案例

若某投资者投资100,000元认购本基金（该认购申请被全额确认）并持有到保本周期到期，认购费率为1.0%。假定募集期间产生的利息为10.00元，持有期间基金累计分红0.04元/基金份额。则，认购份额为：

$$\text{认购净金额} = 100,000 / (1 + 1.0\%) = 99,009.90 \text{ 元}$$

$$\text{认购费用} = 100,000 - 99,009.90 = 990.10 \text{ 元}$$

$$\text{认购份额} = (100,000 - 990.10 + 10.00) / 1.00 = 99,019.90 \text{ 份}$$

1、若保本周期到期日，本基金基金份额净值为0.900元。

$$\text{保本金额} = 99,019.90 \times 1.00 + 990.10 = 100,010.00 \text{ 元}$$

$$\text{可赎回金额} = 99,019.90 \times 0.900 = 89,117.91 \text{ 元}$$

$$\text{持有期间累计分红金额} = 99,019.90 \times 0.04 = 3,960.80 \text{ 元}$$

$$\text{可赎回金额} + \text{保本周期内累计分红金额} = 89,117.91 + 3,960.80 = 93,078.71 \text{ 元}$$

即：可赎回金额+持有期间累计分红金额 < 保本金额

若保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照保本金额（扣除其持有期间的累计分红金额）向该投资者支付96,049.20元（即：100,010.00 - 3,960.80 = 96,049.20）。其中，由基金管理人赔付的保本赔付差额为6,931.29元（即：100,010.00 - (89,117.91 + 3,960.80) = 6,931.29）。

2、若保本周期到期日，本基金基金份额净值为1.500元。

$$\text{保本金额} = 99,019.90 \times 1.00 + 990.10 = 100,010.00 \text{ 元}$$

$$\text{可赎回金额} = 99,019.90 \times 1.500 = 148,529.85 \text{ 元}$$

$$\text{保本周期内累计分红金额} = 0.04 \times 99,019.90 = 3,960.80 \text{ 元}$$

$$\text{可赎回金额} + \text{持有期间累计分红金额} = 152,490.65 \text{ 元}$$

即：可赎回金额+持有期间累计分红金额>保本金额

若保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照可赎回金额向该投资者支付 148,529.85 元。

#### 四、保本周期目标收益率

本基金保本周期最长为 3 年，在每一保本周期内均设置保本周期目标收益率，在运作期间，如本基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日达到或超过保本周期目标收益率，则管理人将在满足条件之日起 10 个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期（提前到期日为过渡期前一个工作日，距离满足条件之日起不超过 20 个工作日），并进入过渡期。在过渡期内开放申购赎回，在过渡期最后一个工作日日本基金净值折算为 1.00 元。过渡期结束后，本基金将进入下一保本周期，同时重新开始计算下一保本周期目标收益率。本基金基金合同生效后首个保本周期目标收益率为 24%，此后每个保本周期目标收益率将由基金管理人届时在相关公告中披露。

#### 五、适用保本条款的情形

1、基金份额持有人认购并持有到期的基金份额、或过渡期申购并持有到期的基金份额、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额；

2、对于前条所述持有到期的基金份额，基金份额持有人作出下列选择，均适用保本条款：

（1）保本周期到期后赎回基金份额；

（2）保本周期到期后从本基金转换到管理人管理的其他基金；

（3）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有基金份额；

（4）保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。

#### 六、不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日，基金份额持有人认购、或过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和不低于其保本金额；

2、基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额；

3、基金份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出的基金份额；

4、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；

- 5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；
- 6、在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；
- 7、因不可抗力等原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

## 七、基金保本的保证

### 一、基金保本的保证

本节所述基金保本的保证责任仅适用于第一个保本周期。就第一个保本周期而言，本基金的担保人为深圳市高新投集团有限公司或《基金合同》规定的其他机构，担保人为本基金保本提供不可撤销的连带责任保证，保证范围为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于认购保本金额的差额部分，保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。

自第二个保本周期起的后续各保本周期的保本保障机制，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的《保证合同》或《风险买断合同》决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告。

### 二、担保人基本情况

本基金第一个保本周期由深圳市高新投集团有限公司作为担保人，为基金管理人的保本义务提供连带责任担保。深圳市高新投集团有限公司有关信息如下：

名称：深圳市高新投集团有限公司

住所：深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层

办公地址：深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层

法定代表人：陶军

成立日期：1994 年 12 月 29 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：22 亿元人民币

经营范围：从事担保业务；投资开发，信息咨询；贷款担保；自有物业租赁。

深圳市高新投集团有限公司成立于 1994 年 12 月，是国内最早设立的专业担保机构之一。集团目前注册资本 22 亿元人民币，股东为深圳市投资控股有限公司、深圳市财政金融服务中心、深圳市远致投资有限公司和深圳市中小企业服务中心，2015 年 8 月完成新增注册资本 26.5 亿元，目前正在进行工商变更。核心业务：

保证担保、融资担保、金融产品担保、创业投资。截至 2015 年 8 月 31 日，深圳市高新投集团有限公司合并报表总资产 76.5 亿元人民币，净资产 36.9 亿元人民币。

### （三）担保人对外提供担保的情况

截至 2015 年 8 月 31 日，深圳市高新投集团有限公司对外担保规模为 469.2 亿元人民币，其中融资担保 51 亿元、保证担保 336.7 亿元，保本基金 68.7 亿元。

### 四、担保人出具《长城久鼎保本混合型证券投资基金保证合同》（全文详见附件）

。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意该《保证合同》的约定。本基金保本由担保人提供不可撤销的连带责任保证；对基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的保证范围为保本赔付差额，即在保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额的差额部分。

担保人保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。

担保人承担保证责任的最高限额不超过按《基金合同》生效之日确认的基金份额所计算的认购保本金额。

担保人的保证责任以《保证合同》为准。基金管理人应当保证《基金合同》中的相关内容的约定与《保证合同》的约定相符。

五、保本周期内，担保人出现足以影响其履行《保证合同》项下保证责任能力情形的，应在该情形发生之日起 3 个工作日内通知基金管理人。基金管理人在接到通知之日起 3 个工作日内通知基金托管人并应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法，并在接到通知之日起 5 个工作日内在指定媒介上公告上述情形。当确定担保人己丧失履行《保证合同》项下保证责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人应在接到通知之日起 60 日内召集基金份额持有人大会，就如下事项进行表决：

- 1、更换担保人；
- 2、变更基金类别；
- 3、《基金合同》终止；
- 4、法律法规或中国证监会规定的其他事项。

六、保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。

保本周期内更换担保人的程序：

- 1、提名

新任担保人由基金管理人提名。

基金管理人提名的新任担保人必须符合如下条件：（1）具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件；（2）符合基金份额持有人的利益。

## 2、决议

基金份额持有人大会对被提名的新任担保人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的1/2以上（含1/2）表决通过。

## 3、备案

基金份额持有人大会选任新任担保人的决议自表决通过之日起生效，并自表决通过之日起5日内报中国证监会备案。

## 4、签订《保证合同》

在更换担保人的基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人与新任担保人签订《保证合同》。

## 5、公告

基金管理人在更换担保人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在至少一家指定媒介及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。

## 6、交接

原担保人职责终止的，原担保人应妥善保管保本周期内保证业务资料，及时向基金管理人和新任担保人办理保证业务资料的交接手续，基金管理人和新任担保人应及时接收。

保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前，原担保人应继续承担保证责任。

七、如果保本周到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人未能按照《基金合同》的约定全额履行保本义务的，基金管理人应在保本周到期日后5个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》（应当载明基金管理人应向基金份额持有人支付的本基金保本赔付差额、基金管理人已自行偿付的金额、需担保人支付的代偿款项以及基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户信息）。

担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内，将《履行保证责任通知书》载明的代偿款项划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人将该代偿款项支付给基金份额持有人。担保人将上述代偿金额全额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账

户中后即全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行代偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

基金管理人最迟应在保本周期到期日后 20 个工作日（含第 20 个工作日）内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人及担保人未履行《基金合同》及《保证合同》上述条款中约定的保本义务及保证责任的，自保本周期到期后第 21 个工作日起，基金份额持有人可以根据《基金合同》第二十四部分“争议的处理和适用的法律”约定，直接向基金管理人或担保人请求解决保本赔付差额支付事宜，但基金份额持有人直接向担保人追偿的，仅得在保证期间内提出。

八、除本部分第六款所指的“更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担”以及下列除外责任情形外，担保人不得免除保证责任：

下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：

- 1、在保本周期到期日，按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的认购保本金额；
- 2、基金份额持有人认购，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出本基金的基金份额；
- 3、基金份额持有人在保本周期内申购或转换入的基金份额；
- 4、在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；
- 5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；
- 6、在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；
- 7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；
- 8、未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的，根据法律法规要求进行修改的除外。

九、保本周期届满时，基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为

本基金下一保本周期提供保本保障，与基金管理人就本基金下一保本周期签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的，本基金继续存续并进入下一保本周期；否则，本基金变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，担保人不再为该混合型基金承担保证责任。

十、担保费由基金管理人从基金管理费收入中列支。

担保费支付方式：担保费从管理人收取的本基金管理费中列支，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。管理人应于每月收到基金管理费之后的五个工作日内向担保人支付担保费。担保人收到款项后的五个工作日内向管理人出具合法发票。

每日担保费计算公式=担保费计算日前一日本基金资产净值×1.8%×1/当年日历天数。

担保费计算期间自《基金合同》生效之日起，至担保人解除保证责任之日或保本周期到期日较早者止，起始日及终止日均应计入期间。

十一、《保证合同》的主要内容

担保人就本基金的第一个保本周期内基金管理人对基金份额持有人认购并持有到期的基金份额所承担保本义务的履行提供不可撤销的连带责任保证。担保人保证责任的承担以本《保证合同》为准。

《保证合同》的当事人包括基金管理人、担保人和基金份额持有人。基金投资者自依《基金合同》取得基金份额，即成为基金份额持有人和《保证合同》的当事人，其购买基金份额的行为本身即表明其对《保证合同》的承认、接受和同意。除非本《保证合同》另有约定，本《保证合同》所使用的词语或简称与其在《基金合同》中的释义部分具有相同含义。

1、保证的范围和最高限额

(1) 本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本金额（即认购保本金额）为：认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。

(2) 担保人承担保证责任的金额即保证范围为：保本周期到期日，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积（即“可赎回金额”）加上认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于认购保本金额的差额部分（该差额部分即为保本赔付差额）。

(3) 基金份额持有人申购或转换入，以及基金份额持有人认购、但在保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出部分不在保证范围之内，且担保人承担保

证责任的最高限额不超过按《基金合同》生效之日确认的基金份额所计算的认购保本金额。

(4) 保本周期到期日是指本基金保本周期（如无特别指明，保证合同所指保本周期即为本基金第一个保本周期）届满的最后一日。本基金的保本周期为 3 年，自《基金合同》生效之日起至 3 个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。但在保本周期内，如果基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日达到或超过保本周期目标收益率，则管理人将在基金份额累计净值收益率连续达到或超过保本周期目标收益率的第 15 个工作日当日起 10 个工作日内公告本基金当期保本周期提前到期。如果保本周期提前到期的，保本周期到期日为管理人公告的保本周期提前到期日，但不得晚于《基金合同》生效之日起 3 个公历年后的对应日（如为非工作日，则顺延至下一工作日）。

## 2、保证期间

保证期间为基金保本周期到期日起六个月。

## 3、保证的方式

在保证期间，本担保人在保证范围内承担不可撤销的连带保证责任。

## 4、责任分担及清偿程序

(1) 如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与认购并持有到期的基金份额在当前保本周期内的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人未能按照《基金合同》的约定全额履行保本义务的，基金管理人应在保本周期到期日后 5 个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》（应当载明基金管理人应向基金份额持有人支付的本基金保本赔付差额、基金管理人已自行偿付的金额、需担保人支付的代偿款项以及基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户信息）。

(2) 担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的 5 个工作日内，将《履行保证责任通知书》载明的代偿款项划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人将该代偿款项支付给基金份额持有人。担保人将上述代偿金额全额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中后即为全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行代偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

(3) 基金管理人最迟应在保本周期到期日后 20 个工作日（含第 20 个工作日）内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

(4) 如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额在当前保本周期内的累计分红金额之和低于认购保本金额，



基金管理人及担保人未履行《基金合同》及本合同上述条款中约定的保本义务及保证责任的，自保本周期到期后第 21 个工作日起，基金份额持有人可以根据《基金合同》第二十四部分“争议的处理和适用的法律”约定，直接向基金管理人或担保人请求解决保本赔付差额支付事宜，但基金份额持有人直接向担保人追偿的，仅得在保证期间内提出。

#### 5、适用法律及争议解决方式

本《保证合同》适用中华人民共和国法律。发生争议时，各方应通过协商解决；协商不成的，任何一方均可向中国国际经济贸易仲裁委员会提起仲裁，仲裁地点为北京，且仲裁裁决为终局，并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

### 八、保本周期到期

#### 一、保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准；如保本周期到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《基金合同》的约定，变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，依照《信息披露办法》的有关规定提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。

如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将根据本基金合同的规定终止。

#### 二、保本周期到期的处理规则

1、本基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日）。

2、在本基金保本周期到期操作期间，基金份额持有人可以做出如下选择：

（1）赎回基金份额；

（2）将基金份额转换为基金管理人管理的其他基金；

（3）本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人持有的基金份额根据届时基金管理人的公告转入下一保本周期；

（4）本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。

3、基金份额持有人可将其持有的所有基金份额选择上述四种处理方式之一，也

可以部分选择赎回、转换转出、转入下一保本周期或继续持有变更后基金的基金份额。

4、无论持有人采取何种方式作出到期选择，均无需就其认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在保本周期到期操作期间的赎回和转换支付赎回费用和转换费用等交易费用。转换为基金管理人管理的其他基金或转为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”后的其他费用，适用其所转入基金的费用、费率体系。

5、本基金保本周期到期后，如基金份额持有人没有作出到期选择，本基金符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额；如基金份额持有人没有作出到期选择，本基金不符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人选择了继续持有变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。

6、为了保障持有到期的基金份额持有人的利益，基金管理人可在保本周期到期前30个工作日内视情况暂停本基金的日常申购和转换业务。

7、在保本周期到期操作期间，本基金将暂停办理申购和转换转入业务。

8、基金赎回或转换转出采取“未知价”原则，即赎回价格或转换转出的价格以申请当日收市后本基金基金份额净值计算。

9、在保本周期到期操作期间，除暂时无法变现的基金财产外，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

### 三、保本周期到期的保本条款

1、认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、还是转入下一保本周期或继续持有变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，其基金份额都适用保本条款。

2、若认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人选择在持有到期后赎回基金份额、转换到基金管理人管理的其他开放式基金，或者选择或默认选择继续持有进入下一保本周期的基金份额或变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”基金份额，基金管理人均应按照本合同的约定履行保本义务，担保人应当按照《保证合同》的约定提供不可撤销的连带责任保证。

3、无论采取何种方式作出到期选择，持有人将自行承担保本周期到期日后（不含保本周期到期日）的基金份额净值波动风险。

#### 四、本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时，基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障，与基金管理人就本基金下一保本周期签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求的，本基金继续存续并进入下一保本周期。

##### 1、过渡期

到期操作期间截止日次日起（含该日）至下一保本周期开始日前一工作日的期间为过渡期；过渡期最长不超过 30 个工作日。具体日期由基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定。

##### 2、过渡期申购

（1）基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

（2）过渡期申购采取“未知价”原则，即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。

（3）对于过渡期申购的基金份额，基金份额持有人将自行承担过渡期申购之日起至过渡期最后一日（含该日）期间的基金份额净值波动风险。

（4）过渡期申购费率

过渡期申购具体费率在届时的《招募说明书》中列示。

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（5）过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告。

（6）在保本周期到期操作期间截止日，如果基金份额持有人选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额所对应的资产净值不低于本基金担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度上限，则本基金不设立过渡期申购。

（7）过渡期内，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

##### 3、下一保本周期基金资产的形成

（1）选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额

基金份额持有人在上一个保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的，按其选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额在折算日所对应的资产净值确认下一个保本周期的保本金额并适用下一个保本周期的保本条款。

## （2）过渡期申购的基金份额

投资者在过渡期内申购本基金基金份额的，按其申购的基金份额在折算日所代表的或赎回金额确认下一个保本周期的保本金额并适用下一个保本周期的保本条款。

## 4、基金份额折算

过渡期最后一个工作日（即下一保本周期开始日前一工作日）为基金份额折算日。

在基金份额折算日，基金份额持有人所持有的基金份额（包括投资者过渡期申购的基金份额、保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额持有人所持有的基金份额）在其所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整。

在基金份额持有人赎回基金份额时，持有期的计算仍以投资者认购、申购、转换转入或者过渡期申购基金份额的实际操作日期计算，不受基金份额折算的影响。

## 5、开始下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日，本基金进入下一保本周期运作。

基金份额持有人在当期保本周期的到期操作期间选择或默认选择转入下一保本周期的基金份额以及过渡期申购的基金份额，经基金份额折算后，适用下一保本周期的保本条款。

本基金进入下一保本周期后，仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务。

自本基金下一保本周期开始后，本基金管理人将暂停本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务。暂停期限最长不超过 3 个月。

投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换转入本基金基金份额的，相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。

## 五、转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”资产的形成

保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”。

1、如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额（差额部分即为保本赔付差额），基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

2、对于投资者在本基金募集期内认购的基金份额、保本周期内申购或转换转入的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资

基金”的，转入金额等于选择或默认选择转为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额在“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。

3、变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”申购的具体操作办法由基金管理人提前予以公告。

#### 六、保本周期到期的公告

1、保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续及为下一保本周期开放申购的相关事宜进行公告。

2、保本周期届满时，在不符合保本基金存续条件下，本基金将变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的招募说明书中公告相关规则。

3、在保本周期到期前，基金管理人还将进行提示性公告。

#### 七、保本周期到期的赔付

1、在发生保本赔付的情况下，基金管理人在保本周期到期日后二十个工作日内向基金份额持有人履行保本差额的支付义务；基金管理人不能全额履行保本差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后五个工作日内向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后五个工作日内，将需代偿的金额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中。

基金管理人最迟应在保本周期到期日后 20 个工作日内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

2、保本赔付资金到账后，基金管理人应按照《基金合同》的约定进行分配和支付。

3、发生赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。

#### 九、基金的投资目标

（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的投资目标为：本基金严格控制风险，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。

（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的投资目标为：本基金通过把握经济周期及行业轮动，挖掘中国经济成长过程中强势行业的优质上市公司，在控制风险的前提下，力求实现基金资产长期稳定的增值。

## 十、基金的投资范围

(一) 本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的投资范围为：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、银行存款及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金将投资对象主要分为固定收益类资产和风险资产，其中固定收益类资产为国内依法公开发行的各类债券（包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、分离交易可转债和债券回购等）、银行存款等；风险资产为股票、权证和中小企业私募债券等。

本基金按照 CPPI 策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构今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。

(二) 若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的投资范围为：

本基金的投资对象是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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金股票等权益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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。

## 十一、基金的投资策略

(一) 本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的投资策略为：

本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在固定收益类资产和风险资产之间的大类资产配置策略；另一层为固定收益类资产的投资策略和风险资产的投资策略。

## 1. 大类资产配置策略

本基金采用固定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简记为“CPPI”）建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整固定收益类资产与风险资产的投资比例，以保证基金资产在三年保本周期末本金安全，并力争实现基金资产的保值增值。

CPPI 投资策略的基本步骤可分为以下三步：

第一步，利用 CPPI 模型，根据保本周期末投资组合最低目标价值（本基金的最低保本值为保本金额的 100%）和合理的贴现率，确定基金当期投资于固定收益类资产的最小比例，即投资组合的安全底线。

第二步，根据数量模型，通过对无风险利率、市场波动趋势等参数的预测，确定安全垫的放大倍数——风险乘数，然后根据安全垫和风险乘数确定当期投资风险资产的最大比例，其余资产投资于固定收益类资产。

第三步，结合市场实际运行状态，根据固定收益类资产、风险资产的价值变动以及安全底线的变化，动态调整固定收益类资产和风险资产的投资比例，进行投资组合管理，实现基金资产在保本基础上保值增值。

其中， $r$  表示无风险利率； $T$  表示保本期限；

$M$  为风险乘数；

$V_{t-1}$ 、 $V_t$  分别为期初、期的安全底线；

$V_{T-1}$  为保本周期末投资组合最低目标价值；

$V_{t-1}^f$ 、 $V_t^f$  分别为基金资产组合在期初、期的净值；

$V_{t-1}^r$  为期的风险资产价值； $\Delta V_t^r$  为风险资产在期的价值变动；

$V_{t-1}^f$  为期的固定收益类资产价值； $\Delta V_t^f$  为固定收益类资产在期的价值变动。

## 2) 风险乘数 M 值的调整方式和投资决策流程

根据 CPPI 投资策略，在风险乘数 M 值保持固定时，根据投资组合资产净值的变化，本基金需要动态调整固定收益类资产、风险资产的比例。当市场波动较大时，

为维持固定风险乘数 M 值，频繁的资产调整将给基金带来较高的交易成本；另一方面，预期未来市场环境将发生较大变化时，固定风险乘数 M 值可能会限制资产的灵活调整。

因此，本基金对于风险乘数 M 值采用定期调整与特殊情形下灵活调整相结合的方式。一般地，本基金根据研究部每月提交的投资策略报告，拟定下月风险乘数 M 值范围报投资决策委员会审批，之后根据投资决策委员会的决议，在风险乘数 M 值范围内进行灵活调整。另一方面，若已发生或预期将发生引起市场波动率急剧加大的事件，本基金亦将对风险乘数 M 值进行及时的调整。

风险乘数 M 值的投资决策流程分为以下三步：

第一步，研究部金融工程小组、宏观策略小组对宏观经济、证券市场从定量、定性两个方面进行分析，其中，定量分析是预测分析市场波动率等参数；定性分析包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况等分析。研究部为本基金提出投资策略报告，基金经理以此作为风险乘数 M 值的投资决策依据；对于可能对证券市场造成重大影响的突发事件，研究部及时提出投资建议。

第二步，基金经理参考研究部提交的投资策略报告，拟定基金风险乘数 M 值范围报投资决策委员会审批。

第三步，投资决策委员会对基金经理上报的风险乘数 M 值范围配置提案召开投资决策会议，投资决策委员会通过会议决议后，以书面形式下达给基金经理，由基金经理具体实施。

为控制风险，在投资管理过程中，本基金规定风险乘数 M 值不超过 3。

## 2. 固定收益类资产投资策略

### （1）债券投资策略

本基金债券的收益主要来源于久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择、跨市场套利以及把握市场低效或失效情况下的交易机会，主要包括以下几个方面：

#### 1) 久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，通过预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。

本基金将债券市场视为金融市场整体的一个有机部分，通过“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式，并据此确定资产组合的平均久期。

#### 2) 收益率曲线策略

本基金将在确定资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立



最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

### 3) 个券选择策略

本基金将通过对个券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。

在个券基本面分析方面，本基金重点关注：信用评级良好的个券，预期信用评级上升的个券和具有某些特殊优势条款的个券。在个券估值方面，本投资组合将重点关注估值合理的个券，信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券，经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。

### 4) 跨市场套利

跨市场套利是指基金管理人从债券各子市场所具有的不同运行规律、不同参与主体和不同风险收益特征的差异中发掘套利机会，从而进一步增强债券组合的投资回报。本基金将在确定套利机会可行性的基础上，寻找合适的介入时机，进行一定的跨市场套利。

### 5) 把握市场低效或失效状况下的交易机会

在市场低效或失效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。

#### A、新券发行溢价策略

在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。

#### B、信用利差策略

不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，从而出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。

#### (2) 可转换债券投资策略

当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。

#### (3) 债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求债券资产的超额收益。

### 3. 风险资产投资策略

#### (1) 股票投资策略

本基金股票重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业。根据 CPPI 策略，在股票投资限额之下，发挥基金管理人主动选股能力，控制股票资产下行风险，分享股票市场成长收益。

股票选择方面，本基金将充分发挥“自下而上”的主动选股能力，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断，选择具备外延式扩张能力的优势上市公司，结合财务与估值分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合，同时通过选择流动性高、风险低、具备中期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，动态优化股票投资组合，控制流动性风险和集中性风险，保证股票组合的稳定性和收益性。

#### (2) 新股申购策略

本基金将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。本基金组合的新股申购（含增发新股）策略主要是从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平，预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。

#### (3) 权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

#### (4) 中小企业私募债券投资策略

1) 根据宏观经济环境及各行业的发展状况，优先投资于选择盈利能力稳定、经济周期波动性较弱行业中的企业，并根据行业特征、所处阶段等因素对于不同行业进行排序；

2) 研究债券发行人的产业状况、市场竞争格局、行业政策、盈利能力、治理结构、特殊事件风险等基本面信息，综合评价公司的长期竞争能力和运作风险；

3) 运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流状况等方面进行综合评价，合理评估发行人财务风险；

4) 利用债券和可获取的信贷历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率，根据债券相关条款和可类比实际投资的回收情况，估算

该债券的违约损失率；

5) 债券评级的具体要求债券主体评级 BBB+以上（含），债项评级 AA 以上（含），同时考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；

6) 综合发行人各方面分析结果，确定合理的信用利差水平，利用市场的相对失衡，选择溢价偏高、性价比较优的私募债品种进行投资。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的投资策略为：

#### 1、大类资产配置策略

在大类资产配置中，本基金将采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险及提高基金收益的目的。

#### 2、行业配置策略

本基金在行业配置上，采用“投资时钟理论”，对于经济周期景气进行预判，并按照行业轮动的规律进行行业配置。通过对于经济增速、通货膨胀率、以及其他宏观经济指标的分析，可以将经济周期大致划分入复苏、增长、萧条、衰退四个阶段。对应不同的阶段，不同的阶段，配置不同的大类资产及不同的行业，将取得不同的收益，并能够呈现出一定的规律性。

在衰退阶段，大多数行业的产能过剩将通货膨胀率冲击至很低位置，需求不足导致经济增速较低，企业盈利能力下降。中央银行将通过降低利率的方式来刺激经济，在这一阶段，债券将是最佳的投资类别，股票市场上，防御性的成长性行业，如消费品行业，相对较好；

在复苏阶段，随着衰退期的政策刺激，低利率逐渐刺激需求，企业利润企稳反弹，通货膨胀率低位温和反弹，经济一片欣欣向荣。此时，周期性成长行业为最佳投资类别。

随着需求的继续反弹，经济增速强劲，通货膨胀率将攀上高位，利率被动抬升，周期轮动进入增长期，强周期性行业如建筑、石油石化、房地产等行业表现较好。

为了抑制经济过热走势，利率将成为主要调控手段，企业盈利见顶，高通胀与低增长将逐步到来，此时，全行业承担着高利率带来的负担，现金是最佳投资标的，股票市场中，相对必需的消费品以及价值型行业，相对较好。

### 3、个股投资策略

在个股选择上，基金管理人将优选具备核心竞争力并估值合理的优势个股。主要评价维度包括：

(1) 公司主营业务具备核心竞争力，核心优势突出。公司在细分行业中处于龙头位置，具备核心竞争力，比如垄断的资源优势、独特的商业模式、稳定的销售网络、卓越的品牌影响力等；

(2) 公司处于快速成长期，收入、利润连续快速增长；同时从盈利模式、公司治理、人员稳定性、创新能力等多角度来分析其成长性的持续能力；

(3) 个股的估值优势。针对处于不同成长阶段、不同行业的公司，运用不同的估值方法进行评估，挖掘具备安全边际的个股。

### 4、债券投资策略

当股票市场投资风险和不确定性增大时，本基金将择机把部分资产转换为债券资产，降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础，在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整，并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。

#### (1) 久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，通过预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。

本基金将债券市场视为金融市场整体的一个有机部分，通过“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式，并据此确定资产组合的平均久期。当预测利率和收益率水平上升时，建立较短平均久期组合或缩短现有债券资产组合的平均久期；当预测利率和收益率水平下降时，建立较长平均久期组合或增加现有债券资产组合的平均久期。

债券资产投资建立的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标有 GDP、CPI、PPI、固定资产投资、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量 M1/M2、新增贷款、新增存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将用以分析央行的货币政策，以判断市场利率变动方向；另一方面，央行货币政策对金融机构的资金流也将带来明显的影响，从而引起债券需求变动。本基金在对市场利率变动和

债券需求变动进行充分分析的基础上，选择建立和调整最优久期债券资产组合。

#### (2) 收益率曲线策略

本基金将在确定资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

#### (3) 个券选择策略

本基金将通过对各券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。

在个券基本面分析方面，本基金重点关注：信用评级良好的个券，预期信用评级上升的个券和具有某些特殊优势条款的个券。在个券估值方面，本投资组合将重点关注估值合理的个券，信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券，经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。

#### (4) 跨市场套利

跨市场套利是指基金管理人从债券各子市场所具有的不同运行规律、不同参与主体和不同风险收益特征的差异中发掘套利机会，从而进一步增强债券组合的投资回报。

我国债券市场目前由交易所市场和银行间市场构成。由于其中投资群体、交易方式等市场要素不同，使得两个市场在资金面、利率期限结构、流动性等方面都存在着一定的差别。本基金将在确定套利机会可行性的基础上，寻找合适的介入时机，进行一定的跨市场套利。

#### (5) 把握市场低效或失效状况下的交易机会

在市场低效或失效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。

##### 1) 新券发行溢价策略

在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。

##### 2) 信用利差策略

不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，从而出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。

#### 5、现金管理

本基金将利用银行存款、回购和短期政府债券等短期金融工具进行有效的现金流

管理，在满足赎回要求的前提下，有效地在现金、回购及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具之间进行灵活配置。

## 6、权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

此外，本基金还将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。本基金组合的新股申购（含增发新股）策略主要体现在从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。

## 十二、基金的业绩比较基准

（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的业绩比较基准为：3年期银行定期存款税后收益率。

本基金选择3年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准主要考虑如下：

（1）本基金是保本基金，通过第三方担保机制的引入和通过固定收益类资产与权益类资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增值。其，其主要目标客户为低风险偏好的客户，以3年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准，符合本基金的产品定位和风险收益特征。

（2）本基金保本周期最长为3年，通过保本周期内高赎回费率的设置和随持有期限递减的赎回费率结构安排，鼓励长期持有、稳健投资。以3年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准与目标客户群的预期持有期限基本一致。

（3）3年期银行定期存款税后收益率容易被广大投资人所理解和接受。

综上所述，选择3年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能比较贴切地体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

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，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。

（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+中债总财富指数收益率×45%。

沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，较好地反映了 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债总财富指数的编制采用了银行间债券市场结算数据、交易所债券的成交数据、债券柜台的双边报价、银行间债券市场的双边报价以及市场成员收益率的估值数据，并参考了中国债券市场中部分核心成员的收益率估值数据，以更好地反映债券价格信息。中债总财富指数是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金是混合型证券投资基金，股票投资范围为 0-95%，债券等资产投资范围为 0-95%。本基金对沪深 300 指数和中债总财富指数分别赋予 55%和 45%的权重符合本基金的投资特性。

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，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

### 十三、基金的风险收益特征

（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的风险收益特征为：本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。

（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的风险收益特征为：本基金是混合型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，为中高风险、中高收益的基金产品。

### 十四、投资组合报告

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

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 2 月 10 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 35,410,345.36 0.95

其中：股票 35,410,345.36 0.95

2 基金投资	--
3 固定收益投资	2,242,199,003.70 59.85
其中：债券	2,242,199,003.70 59.85
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	1,229,065,723.60 32.81
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	201,762,101.33 5.39
8 其他资产	37,651,635.50 1.01
9 合计	3,746,088,809.49 100.00

## 2、报告期末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	23,228,841.16 0.62
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	3,612,000.00 0.10
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	8,569,504.20 0.23
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	--
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	35,410,345.36 0.95



3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002236	大华股份	1,685,807	23,061,839.76	0.62
---	--------	------	-----------	---------------	------

2	300182	捷成股份	828,700	8,543,897.00	0.23
---	--------	------	---------	--------------	------

3	600511	国药股份	120,000	3,612,000.00	0.10
---	--------	------	---------	--------------	------

4	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
---	--------	------	-------	-----------	------

5	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
---	--------	-----	-------	-----------	------

6	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
---	--------	------	-------	-----------	------

7	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
---	--------	------	-------	-----------	------

8	600996	贵广网络	1,000	18,790.00	0.00
---	--------	------	-------	-----------	------

9	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
---	--------	------	-------	-----------	------

10	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
----	--------	------	-----	-----------	------

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

1	国家债券	194,857,498.70	5.22
---	------	----------------	------

2	央行票据	--	
---	------	----	--

3	金融债券	980,140,000.00	26.26
---	------	----------------	-------

其中：	政策性金融债	980,140,000.00	26.26
-----	--------	----------------	-------

4	企业债券	625,864,000.00	16.77
---	------	----------------	-------

5	企业短期融资券	441,140,000.00	11.82
---	---------	----------------	-------

6	中期票据	--	
---	------	----	--

7	可转债（可交换债）	197,505.00	0.01
---	-----------	------------	------

8	同业存单	--	
---	------	----	--

9	其他	--	
---	----	----	--

10	合计	2,242,199,003.70	60.07
----	----	------------------	-------

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	160420	16农发20	3,500,000	343,140,000.00	9.19
---	--------	--------	-----------	----------------	------

2	011699583	16国电SCP003	3,000,000	301,140,000.00	8.07
---	-----------	------------	-----------	----------------	------

3	160415	16农发15	1,900,000	187,872,000.00	5.03
---	--------	--------	-----------	----------------	------

4	136702	16华润02	1,800,000	175,950,000.00	4.71
---	--------	--------	-----------	----------------	------

5 130408 13 农发 08 1,700,000 170,850,000.00 4.58

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的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

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资，期末未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

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

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

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

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

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

(2) 本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 116,431.94

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 37,535,104.51

- 5 应收申购款 99.05
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 37,651,635.50

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十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	300587	天铁股份	20,290.18	0.00	新股未上市
2	002840	华统股份	11,881.70	0.00	新股未上市
3	002838	道恩股份	10,405.68	0.00	新股未上市

- |   |        |      |           |      |       |
|---|--------|------|-----------|------|-------|
| 1 | 300587 | 天铁股份 | 20,290.18 | 0.00 | 新股未上市 |
| 2 | 002840 | 华统股份 | 11,881.70 | 0.00 | 新股未上市 |
| 3 | 002838 | 道恩股份 | 10,405.68 | 0.00 | 新股未上市 |

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十五、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较（截至2016年12月31日）

时间段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
基金合同生效日（2016年7月21日）至2016年12月31日	-0.30%	0.06%	1.24%	0.01%	-1.54%	0.05%

基金合同生效日（2016年7月21日）至2016年12月31日 -0.30% 0.06% 1.24% 0.01% -1.54% 0.05%

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

## 十六、基金费用概览

### 一、与基金运作有关的费用

#### （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、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；

- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、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 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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

保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转型为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。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。

### 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 0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转型为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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。

在保本周期到期操作期间和过渡期间，基金管理人和基金托管人免收本基金的管理费和托管费。

上述“一、基金费用的种类中第 3—7 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。

## 二、与基金销售有关的费用

### (一) 申购费用

本基金在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：

#### 1、申购费率

申购金额(含申购费) 申购费率

100 万元以下 1.2%

100 万元(含)－300 万元 0.8%

300 万元(含)－500 万元 0.4%

500 万元以上(含) 每笔 1000 元

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

#### 2、特定申购费率

申购金额(含申购费) 申购费率

100 万元以下 0.24%

100 万元(含)－300 万元 0.16%

300 万元(含)－500 万元 0.08%

500 万元以上(含) 每笔 1000 元

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

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

本基金申购费由申购者承担，不列入基金财产。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，申购费率最高不超过 5%，具体费率以届时公告为准。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)，对于500万元(含)以上的申购，净

申购金额=申购金额-固定申购费金额

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额/T日基金份额净值

例：投资者申购本基金100,000元，T日基金份额净值为1.150元，其获得的基金份额计算如下：

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

申购份数=98,814.23/1.150=85,925.42份

即投资者缴纳申购款100,000元，获得85,925.42份本基金的基金份额。

## (二) 赎回费用

本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减，费率如下：

持有期 赎回费率

1年以内 2.0%

1年(含)-2年 1.5%

2年(含)-3年 1.0%

3年(含)以上 0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，赎回费率最高不超过5%，具体费率以届时公告为准。

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总金额=赎回份数×赎回当日基金份额净值

赎回手续费=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回手续费

例：假定T日本基金的基金份额净值为1.325元，投资者赎回其持有的100,000份基金份额，持有期10个月，则：

赎回总额=100,000×1.325=132,500元

赎回费用=132,500×2.0%=2,650元

赎回金额=132,500-2,650=129,850元

即投资者赎回其持有的100,000份本基金的基金份额，获得赎回金额129,850元。

### （三）转换费用

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

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

（1）如转入基金的申购费率 $>$ 转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额 $\times$ 转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额 $\times$ 转出基金赎回费率

转入总金额=转出金额-转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率-转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差

转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差

例：某投资者将持有的长城货币市场证券投资基金 10 万份基金份额转换为本基金，假设转换当日转入基金（本基金）份额净值是 1.050 元，转出基金（长城货币市场证券投资基金）对应赎回费率为 0，申购费补差费率为 1.2%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000 $\times$ 1=100,000 元

转出基金赎回费=0

转入总金额=100,000-0=100,000 元

转入基金申购费补差=100,000-100,000/(1+1.2%)=1,185.77 元

转入净金额=100,000-1,185.77=98,814.23 元

转入份额=98,814.23/1.050=94,108.79 份

基金转换费=0+1,185.77=1,185.77 元

（2）如转出基金的申购费率 $\geq$ 转入基金的申购费率

基金转换费用=转出金额 $\times$ 转出基金赎回费率

例：某投资者持有本基金 10 万份基金份额，持有满 2 年，决定转换为长城货币市场证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金）份额净值是 1.150 元，转出基金对应赎回费率为 1.0%，申购补差费率为 0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000 $\times$ 1.150=115,000 元

转出基金赎回费=115,000×1.0%=1,150 元

转入总金额=115,000-1,150=113,850 元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=113,850-0=113,850 元

转入份额=113,850/1=113,850 份

基金转换费=115,000×1.0%=1,150 元

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

3、转出基金赎回费的 25%计入转出基金资产（基金合同或招募说明书另有规定的除外）。

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

（四）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，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体公告。

（五）基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者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相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

### 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、费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介上公告。



## 五、基金税收

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 十七、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及《长城久鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资管理活动，对2016年7月6日刊登的本基金的招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”中，调整了风险提示的相关内容；更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。
- 2、在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人情况及主要人员情况。
- 3、在第四部分“基金托管人”中，更新了基金托管人的信息。
- 4、在第五部分“相关服务机构”中，更新了直销机构、代销机构、基金注册登记机构的信息。
- 5、将原六、七部分合并为现在的第六部分“基金的募集与基金合同的生效”，并删除了基金合同生效前适用的内容。
- 6、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了基金的转换和定期定额投资的内容。
- 7、在第十一部分“基金的投资”中，增加了投资组合报告内容，披露截至2016年12月31日的数据。
- 9、增加了第十二部分“基金的业绩”数据，披露了截至2016年12月31日本基金的业绩数据。
- 10、在第十五部分“基金的费用与税收”中，增加了与基金销售有关费用的内容。
- 11、在第二十二部分“基金托管协议的内容摘要”中，更新了基金管理人的法定代表人信息。
- 12、在第二十四部分“其他应披露的事项”中，披露了本期已刊登的公告事项。
- 13、在附件“《保证合同》”中，更新了基金管理人的法定代表人信息。

长城基金管理有限公司

2017年3月4日

