

**长盛动态精选**

**证券投资基金基金合同**

**基金发起人：长盛基金管理有限公司**

**基金管理人：长盛基金管理有限公司**

**基金托管人：中国农业银行**

## 目 录

一、前 言.....	1
二、释 义.....	2
三、基金合同当事人.....	3
四、基金合同当事人的权利义务 .....	4
五、基金份额持有人大会.....	8
六、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 .....	8
七、基金的基本情况.....	16
八、基金的募集.....	17
九、基金的成立.....	18
十、基金的日常申购和赎回.....	18
十一、基金的托管.....	22
十二、基金的销售与服务代理 .....	23
十三、基金的登记注册.....	23
十四、基金的投资管理.....	24
十五、基金的资产.....	31
十六、基金资产估值.....	31
十七、基金的费用与税收.....	38
十八、基金的收益与分配.....	40
十九、基金的会计与审计.....	41
二十、基金的信息披露.....	41
二十一、基金的终止与清算.....	43
二十二、违约责任.....	45
二十三、争议的处理.....	45
二十四、通知与送达.....	45
二十五、《基金合同》的效力 .....	46
二十六、《基金合同》的修改和终止 .....	47
二十七、其他事项.....	47

## 一、前 言

(一) 订立《长盛动态精选证券投资基金基金合同》的目的、依据和原则

- 1、 订立《长盛动态精选证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“本基金合同”)的目的是保护基金投资人合法权益、明确本基金合同当事人的权利与义务、规范长盛动态精选证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)的运作。
- 2、 订立本基金合同的依据是 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》(以下简称《暂行办法》)、2000 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的《开放式证券投资基金试点办法》(以下简称《试点办法》)及其他有关规定。
- 3、 订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

(二) 本基金由基金发起人/基金管理人依照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定发起设立。

中国证监会对本基金设立的批准,并不表明其对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。

基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

(三) 本基金合同的当事人按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定享有权利,同时须承担相应义务。

(四) 本基金投资人自取得依本基金合同所发行的基金单位,即成为基金份额持有人和本基金的当事人,其持有基金单位的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定享受权利、承担义务。

## 二、释 义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 本合同、《基金合同》：指《长盛动态精选证券投资基金基金合同》
- 《暂行办法》：指 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布并施行的《证券投资基金管理暂行办法》
- 《试点办法》：指 2000 年 10 月 8 日由中国证监会发布并施行的《开放式证券投资基金试点办法》
- 元：指人民币元
- 基金或本基金：指依据本《基金合同》所设立的长盛动态精选证券投资基金
- 招募说明书：指《长盛动态精选证券投资基金招募说明书》
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 基金管理人：指长盛基金管理有限公司
- 基金发起人：指长盛基金管理有限公司
- 基金托管人：指中国农业银行
- 基金销售代理人：指依据有关代理销售协议办理本基金申购、赎回和其他基金业务的代理机构
- 基金登记注册人：指中国证券登记结算有限责任公司
- 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体
- 个人投资人：指具有完全民事行为能力的自然人
- 机构投资人：指经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 基金成立日：指自招募说明书公告之日起三个月内，在基金净销售额超过人民币 2 亿元，且认购户数达到或超过 100 户的条件下，基金发起人可以依据《试点办法》和实际发行情况停止发行，并宣告基金成立的日期
- 募集期：指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段，最长不超过 3 个月
- 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
- T 日：指日常申购、赎回或其他交易的申请日
- 基金销售网点：指基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点

- 日常申购：指基金投资人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人提出购买基金单位的请求。基金的日常申购从基金成立后不超过 40 个工作日开始办理
- 日常赎回：指基金投资人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人提出卖出基金单位的请求。基金的日常赎回从基金成立后不超过 40 个工作日开始办理
- 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益
- 基金资产总值：基金资产总值是指基金所拥有的各类证券价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其它投资等所形成的资产总和
- 基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值。
- 基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金单位净值的过程
- 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网网站，包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

### 三、基金合同当事人

#### (一) 基金发起人：

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区华富路航都大厦 13C

办公地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271

法定代表人：王其华

成立时间：1999 年 3 月

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】6 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：10000 万元

存续期间：持续经营

#### (二) 基金管理人

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区华富路航都大厦 13C

办公地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271

法定代表人：王其华

成立时间：1999 年 3 月

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】6 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：10000 万元

存续期间：持续经营

### （三）基金托管人

名称：中国农业银行

地址：北京市复兴路甲 23 号

法定代表人：杨明生

成立时间：1979 年 2 月（恢复）

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发（1979）056 号

组织形式：国有独资

注册资本：1338.65 亿元

存续期间：持续经营

### （四）基金份额持有人

基金投资人自取得依本基金合同所发行的基金单位，即成为基金份额持有人，其持有基金单位的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人成为本基金合同的当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。

## 四、 基金合同当事人的权利义务

### （一）基金发起人的权利与义务

#### 1、 基金发起人的权利

- （1） 申请设立基金；
- （2） 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### 2、 基金发起人的义务

- （1） 遵守基金合同；
- （2） 公告招募说明书和发行公告；
- （3） 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- （4） 基金不能成立时在法定的时间内退还所募集资金本息并承担发行费用；
- （5） 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

- (1) 自本基金成立之日起，依据本基金合同及有关法律的规定运用本基金资产；
- (2) 依照《暂行办法》、《试点办法》及其他有关规定，代表基金对被投资的上市公司行使股东权利；
- (3) 依据本基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律的规定对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，必要时应采取保护措施保护基金投资人的利益；
- (4) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；
- (5) 直接销售基金单位，获取认购（申购）费用；
- (6) 依据本基金合同及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- (7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理基金单位的申购和赎回；
- (8) 依据基金合同的规定获得基金管理费收入；
- (9) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

### 2、基金管理人的义务

- (1) 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- (2) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
- (3) 配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；
- (4) 配备足够的专业人员进行基金的登记注册或委托其他机构代理该项业务；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- (6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人运作基金资产；
- (7) 接受基金托管人的监督；
- (8) 按规定计算并公告基金资产净值及基金单位资产净值；
- (9) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定，

## 履行信息披露及报告义务；

- (10) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、《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；
- (11) 依据《基金合同》规定向基金份额持有人分配收益；
- (12) 按照法律法规和本《基金合同》的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回及分红款项；
- (13) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (14) 依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会；
- (15) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- (16) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资人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，并得到有关资料的复印件；
- (17) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (19) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，采取适当合理的方式向基金投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；
- (20) 因估值错误导致投资人的损失，属管理人责任的，应承担赔偿责任，并采取适当、合理的方式向投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；
- (22) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

## (三) 基金托管人的权利与义务

## 1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金资产；
- (2) 依本《基金合同》约定获得基金托管费；
- (3) 监督本基金的投资运作；
- (4) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- (1) 依法持有基金资产；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并保管基金资产；

- (3) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (5) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；
- (6) 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；
- (7) 以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来；
- (8) 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》、《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；
- (9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值；
- (10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；
- (11) 采取适当、合理的措施，使开放式基金单位的认购、申购和赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；
- (12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金单位认购、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；
- (13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定；
- (14) 在定期报告内出具基金托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (15) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- (16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (17) 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；

- (18) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；
- (20) 因过错导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (21) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金管理人追偿；
- (22) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

#### (四) 基金份额持有人

##### 1、基金份额持有人的权利

- (1) 取得基金收益；
- (2) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；
- (3) 监督基金运作状况，获取基金业务及财务状况的资料；
- (4) 申购、赎回及其他对基金单位处分权利，并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金单位；
- (5) 因基金管理人、托管人、销售机构、登记注册机构的错误导致基金份额持有人利益受损害的情况下，依法提起诉讼或要求赔偿的权利；
- (6) 参与基金清算后的剩余资产的分配；
- (7) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

每份基金单位具有同等的合法权益。

##### 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- (3) 以其持有的基金份额为限承担基金亏损或者终止的责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；
- (5) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

## 五、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

## (二) 召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10% 以上（不含 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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 提前终止基金合同；
- (2) 基金扩募或延长基金合同期限；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；
- (5) 基金管理人、基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的基金合同修改，但基金合同及法律、法规另有规定的除外；
- (8) 《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，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；
- (2) 因相应的法律、法规（包括证券监督管理部门的要求，下同）发生变动必须对基金合同进行修改、变更；
- (3) 对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (4) 对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (5) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

## (三) 会议召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召

集，基金份额持有人大会的开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定，在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；

- 2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；
- 3、代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有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十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（不含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；
- 4、代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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。

#### (四) 通知

- 1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

(1) 会议召开时间、地点、方式；

- (2) 会议审议事项、议事程序、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) 代理投票委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话；
- (6) 其他注意事项。

2、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

#### (五) 会议的召开方式

##### 1、会议方式

- (1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
- (2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
- (3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
- (4) 会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜或转换基金运作方式必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 2、基金份额持有人大会召开条件

###### (1) 现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

- 1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；
- 2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的

规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 15 个工作日后)和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## (2) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

- 1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；
- 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占在权益登记日基金总份额的 50%以上（不含 50%）；
- 4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表，同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在15个工作日后)，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## (六) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

- (1) 议事内容仅限于本基金合同“五、基金份额持有人大会(二)召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；
- (2) 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；
- (3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提

案进行审核：

- 1) 关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明；
- 2) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10%以上(不含 10%)的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上(不含 50%)多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前10日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形

成决议。

### (七) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议

(1) 一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50% (不含 50%) 以上通过方为有效；除下列(2)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：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、提前终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

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。

### (八) 计票

1、现场开会

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

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当

场公布计票结果；

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，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（若基金托管人担任召集人，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。

### (九) 生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告。

## 六、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一) 基金管理人和基金托管人的更换条件

#### 1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，可更换基金管理人：

- (1) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；
- (2) 基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金份额持有人利益的；
- (3) 代表 50% 以上基金份额的基金份额持有人要求基金管理人退任的；
- (4) 中国证监会充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责的。

## 2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的,经中国证监会和中国人民银行批准,可更换基金托管人:

- (1) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的;
- (2) 基金管理人认为有充分理由认为更换基金托管人符合基金份额持有人利益的;
- (3) 代表50%以上基金份额的基金份额持有人要求基金托管人退任的;
- (4) 中国人民银行有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

## (二) 基金管理人和基金托管人的更换程序

### 1、基金管理人的更换程序

- (1) 提名:新任基金管理人由基金托管人提名;
- (2) 决议:基金份额持有人大会对被提名的基金管理人形成决议;
- (3) 批准:新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任,原任基金管理人经中国证监会批准方可退任;
- (4) 公告:基金管理人更换后,由基金托管人在中国证监会批准后5个工作日内公告。新任基金管理人与原基金管理人进行资产管理的交接手续,并与基金托管人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换,由基金发起人在中国证监会批准后5个工作日内公告;

基金管理人更换后,如果长盛基金管理有限公司或基金托管人要求,应按其要求替换或删除基金名称中“长盛”的字样。

### 2、基金托管人的更换程序

- (1) 提名:新任基金托管人由基金管理人提名;
- (2) 决议:基金份额持有人大会对被提名的基金托管人形成决议;
- (3) 批准:新任基金托管人经中国证监会和中国人民银行审查批准方可继任,原任基金托管人经中国证监会和中国人民银行批准方可退任;
- (4) 公告:基金托管人更换后,由基金管理人在中国证监会和中国人民银行批准后5个工作日内公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理的交接手续,并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换,由基金发起人在获得中国证监会批准后5个工作日内进行公告。

## 七、基金的基本情况

- (一) 基金的名称：长盛动态精选证券投资基金
- (二) 基金的类型：合同型开放式
- (三) 基金投资目标：本基金为开放式股票型基金。积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的 50 家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。
- (四) 基金预期发行规模：本基金不设目标发行规模。
- (五) 基金单位每份面值和认购费用
  - 1、基金单位面值为 1.00 元。
  - 2、认购费用及计算公式见第八章。
- (六) 基金存续期限：不定期

## 八、基金的募集

除法规另有规定外，任何与基金单位发行有关的当事人不得预留和提前发售基金单位。

- (一) 基金单位的募集期限、募集方式、募集对象
  - 1、募集期限：自招募说明书公告之日起不超过 3 个月。
  - 2、募集方式：通过本公司的直销网点和销售代理机构的代销网点进行公开募集。
  - 3、募集对象：中华人民共和国境内的个人投资人和机构投资人（法律、法规和有关规章另有规定的除外）。

- (二) 募集资金利息的处理方法

募集资金利息在基金募集期结束时归入投资者认购金额中，折合成基金份额，归投资者所有。

- (三) 基金单位面值、认购费用及计算公式

- 1、基金单位面值为 1.0000 元。
- 2、认购费用

本基金认购费用最高不超过认购金额的 3%，认购费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书和发行公告中列示。认购费用用于本基金的市场推广、销售等设立募集期间发生的各项费用。

- 3、认购份数的计算

认购份数的计算方法如下：

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} \times \text{认购费率}$$

净认购金额=（认购金额-认购费用）+认购利息

认购份数=净认购金额/基金单位面值

基金单位面值为1.0000元。基金单位份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

#### （四）募集规模

本基金不设目标发行规模，在设立募集期内，基金发起人可以根据认购情况，在符合基金成立的条件下，随时宣布基金成立。

#### （五）基金单位的认购限额

- 1、本基金销售网点的单笔最低认购金额为 1,000 元。
- 2、投资人在发行期内可多次认购本基金。
- 3、认购申请一经提出，不得撤销。
- 4、发行期间，销售机构为投资人办理认购手续仅代表对投资人认购申请的受理，投资人认购成功与否应以基金募集结束后登记注册人的认购确认为准。其他事项由基金管理人在招募说明书或发行公告中进行规定。

## 九、基金的成立

### （一）基金的成立条件

本基金自招募说明书公告之日起三个月内，在基金净销售额超过人民币2亿元，且认购户数达到或超过100户的条件下，基金发起人依据《试点办法》及招募说明书可以停止发行，并宣告基金成立；如三个月后仍未满足成立条件，则本基金不成立。本基金成立前，投资人的认购款项只能存入商业银行，不作它用。

### （二）基金不能成立时募集资金的处理方式

本基金不成立时，本基金发起人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在设立募集期结束后30天内退还基金认购人。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金成立后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续20个工作日达不到100人，或连续20个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。

## 十、基金的日常申购和赎回

### （一）日常申购与赎回的场所

- 1、基金管理人的直销网点；
- 2、基金管理人委托的销售代理人的营业网点；

本公司直销中心及销售代理人信息由招募说明书具体规定。基金管理人有权增加符合条件的销售代理人，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加其销售城市（网点），并另行公告。条件成熟时，投资者可通过基金管理人或者指定的基金销售代理人以电话、传真或互联网等形式进行申购与赎回。

## （二）申购与赎回的开放日期及时间

### 1、申购与赎回的开始时间

基金的日常申购、赎回自本基金成立日后不超过四十个工作日开始办理。在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

2、基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。

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

## （三）申购与赎回的原则

1、未知价原则，即本基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金单位净值为基准进行计算；

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人赎回时，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回；

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

5、申购费用按单笔申购申请金额对应的费率乘以单笔确认的申购金额计算；

6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上予以公告。

## （四）日常申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售代理人规定，在开放日的交易时间段内提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。投资者申购本基金，须按销售

机构规定的方式备足申购资金。基金份额持有人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）及登记注册机构必须有足够的基金单位余额，否则会因所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

## 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2个工作日起到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询；T日申购成功的基金份额T+2个工作日起可以赎回。

## 3、申购和赎回款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项在不超过7个工作日之内划往赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照第（八）项有关条款处理。

### （五）日常申购与赎回的数额规定

本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书或公开说明书中规定。

### （六）申购和赎回的价格和费用

1、申购费率最高不超过3%，赎回费率不超过1%。本基金的赎回费用由赎回人承担，用于支付相关手续费后余额归入基金资产。赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。基金管理人对部分基金投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

2、本基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金单位净值为基准进行计算。

3、T日的基金单位净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （七）拒绝或暂停申购与赎回的情况

#### 1、拒绝或暂停申购的情形与处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请：

（1）基金资产规模过大，使基金管理人认为继续扩大基金规模会影响基金

投资业绩，从而损害现有基金份额持有人的利益；

- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，或因不可抗力导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 登记注册人的一方或多方技术系统出现故障导致无法正常进行工作；
- (4) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的申购；
- (5) 因不可抗力事件造成基金的申购事实上无法办理；
- (6) 经中国证监会同意的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人立即在指定媒体上刊登暂停公告。

## 2、拒绝或暂停赎回的情形及处理方式

除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资人的赎回申请：

- (1) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- (2) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；
- (3) 基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 登记注册人的一方或多方技术系统出现故障导致无法正常进行工作；
- (4) 因不可抗力事件导致基金无法正常运作或基金的赎回无法进行；
- (5) 法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

除上述情形外，发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金赎回时，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停公告。

### (八) 巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的情形及处理方式

##### (1) 巨额赎回的认定

若一个工作日内的基金单位净赎回申请(赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额)超过上一日基金单位总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### (2) 巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人将根据本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兑付投资人的赎回申请时，将按正常赎回程序处理投资人赎回申请。
- 2) 部分延期赎回：当基金管理人认为没有能力全部兑付投资人的赎回申请或全部兑付投资人的赎回申请可能对基金的资产净值造成较大波动时，

基金管理人在不低于上一日基金总份额的 10%，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至第二开放日办理，并以第二开放日的基金单位资产净值为依据计算赎回金额，直至将申请赎回份额全部赎回为止。投资人在申请赎回时有权对当日未获受理部分份额选择延迟赎回或放弃延迟赎回。

- 3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售代理人的网点在 3 个证券交易所交易日内刊登公告，并说明有关处理方法。

## 2、连续巨额赎回成立的条件及处理方式

### (1) 连续巨额赎回的认定

本基金连续三个开放日发生巨额赎回，为连续巨额赎回。

### (2) 连续巨额赎回的处理方式

1) 发生连续巨额赎回时，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延迟支付时间不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

2) 重新开放申购或赎回的公告：如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个工作日的基金单位资产净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金单位资产净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金单位资产净值。

## 十一、基金的托管

基金托管人与基金管理人必须按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及有关规定订立《长盛动态精选证券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金资产的保

管、基金资产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十二、基金的销售与服务代理

本基金的认购、申购、赎回及相关的客户服务等业务由基金管理人和基金管理人委托其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金上述业务的，应与代理人按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定就本基金的销售和服务事项签订《长盛动态精选证券投资基金销售和服务代理协议》。订立代理协议的目的是为了明确基金销售代理人和基金管理人之间在基金单位认购、申购、赎回以及相关的客户服务等事宜中的权利、义务和职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十三、基金的登记注册

### （一）委托

基金管理人应委托中国证监会认定的机构办理本基金的登记注册业务。基金管理人委托上述机构办理登记过户业务，应与其签订委托代理协议，以明确基金管理人与其在投资人基金账户管理、基金交易确认、基金单位登记过户、基金清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

基金管理人目前委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的登记注册业务，并已签定《长盛动态精选证券投资基金注册与登记过户委托代理协议》。

### （二）基金登记注册人概况

基金登记注册人：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：陈耀先

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

中国证券登记结算有限责任公司是经国务院同意、中国证券监督管理委员会批准，在国家工商行政管理局登记注册的中国唯一的证券登记结算机构。由上海证券交易所、深圳证券交易所共同出资组建，公司设在北京。

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

- 1、 证券账户和结算账户的设立和管理；
  - 2、 证券登记与过户；
  - 3、 证券托管与转托管；
  - 4、 证券和资金的清算与交收；
  - 5、 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- 1、 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

### （三）更换

登记注册人的更换程序如下：

- （1）提名：由基金管理人提名。
- （2）审批：新任登记注册人报中国证监会审查资格并批准后，原任登记注册人方可退任；
- （3）公告：基金登记注册人更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。
- （4）交接：原基金登记注册人应做出处理基金登记注册事务的报告，并与新任基金登记注册人完成业务移交手续，向新任基金登记注册人提交完整的书面材料和电子数据；新任基金登记注册人与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金登记注册人仍有义务保留本基金正式移交日之前的登记注册业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金登记注册人处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金登记注册人业务移交产生的问题，原基金登记注册人仍有协助解决之义务。

## 十四、基金的投资管理

### （一）投资目标

本基金为开放式股票型基金。将通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的 50 家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。

## （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，主要包括国内依法发行、上市或拟上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资占基金资产净值的比例为 20%--95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

在有关法律法规许可时，基金资产除 5%左右以现金形式持有，其余基金资产可全部用于股票投资。

## （三）投资理念

股票选择重于时机选择；在经济发展的不同阶段，各行业表现的景气度会出现显著差异；只有少数上市公司能充分分享中国经济的未来增长。

## （四）投资策略

本基金为主动管理的股票型基金，投资策略上偏重选股能力的发挥，时机的选择放在次要位置。

### 1、资产配置策略

本基金将采用自上而下的两个层次资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，然后进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例。

#### （1）资产配置比例

本基金股票资产在基金净值中的配置比例将保持在 20% - 95%的范围中，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

资产配置比例由基金决策委员会根据市场状况确定，基金经理在资产配置比例范围内选择具体基金投资品种。

#### （2）资产配置模型

资产配置比例的确定程序中在坚持定量分析与定性判断相结合的原则下，强调定量技术辅助决策的作用。

在资产配置过程中，将充分研究宏观经济周期以及股票市场周期变化，做出判断，适当控制股票仓位。当股票市场中股票呈现平均意义上价值被高估的迹象的时候，适当降低股票配置比例，反之适当增加股票仓位。

在分析股票市场投资价值水平方面，本基金将参考 FE 股票市场估值模型，结合对宏观经济周期数据的判断，作为衡量股票市场价值水平的基础。

FE 股票市场估值模型的核心思想是依据整个投资市场其他投资产品的收益率来判断股票市场平均价格水平是否被高估的理论方法。根据中国经济的具体情况，FE 股票市场估值模型的基本形式确定为：

$$CEY = a + b \cdot TBY + c \cdot RP - d \cdot LTEG$$

其中，CEY 为市场组合中平均市值收益率；

TBY 为用 7 年期国债收益率代表的债券投资收益率；

RP 为信用风险补偿，用企业债与国债收益率差额计算获得；

LTEG 为上市公司平均收益增长率，估计中用 GDP 增长率代替。

在资产配置决策中，如果实际 CEY 小于理论 CEY，表示目前股票市场价值被高估了，反之表示股票市场价值被低估了。

如果结合理论模型分析与定性判断得出股票市场价值被高估的结论，在资产配置决策中，将不再扩大股票投资比例。如果股票市场价值高估程度较高的时候，可以选择降低股票持仓比例的策略，实现收益。

## 2、股票组合的构建与调整

本基金采用自上而下的投资策略，即首先根据国家政策、国内外经济形势以及各产业的生命周期，编制行业景气度指标体系，对各主要行业投资价值进行优先排序，确定各行业的投资比重。然后采用长盛股票综合评级体系，对优选行业内的上市公司进行综合评级，精选出 50 只最有投资价值的股票。具体选股顺序如下：

(1) 股票选择范围：剔除下列股票后的所有 A 股股票：

- 1) 暂停上市股票；
- 2) 经营状况异常或最近财务报告严重亏损且短期内扭亏无望的股票；
- 3) 价格发生异常波动的股票；
- 4) 其他经本公司研究员认定应该剔除的股票。

(2) 股票数量：50 只股票。

(3) 选股标准和步骤：

依据行业景气度及行业优势地位、财务稳健性、公司管理水平和信息透明度、流通市值及换手率等条件进行选股。具体步骤如下：

1) 初始行业分类

本基金的行业分类标准主要参照证监会的行业分类标准，并借鉴摩根斯坦利和标准普尔公司联合发布的全球行业分类标准(GICS)，结合我国上市公司实际情况进行调整。根据我们的基金产品设计，对可供投资的行业划分为三类，即稳定性、成长性和周期性行业。本基金关于行业稳定性、成长性和周期性的判断，有别于一般传统意义上的行业划分，而主要依据行业规模的增长和行业主导产品价格的波动等指标来进行类别归属。基本情况如下表 6 所示：

表 6 行业分类及举例

行业类别	划分标准	投资研究思路	主要行业举例
稳定性行	主导产品价格	以绝对价值法分	电力、煤气及水的生产供应业；交通

业	比较稳定、产量上下波动不大	析为主、相对价值法比较为辅	运输、仓储业；食品、饮料。
成长性行业	规模、收入和利润增长明显高于经济增长速度	通过研究员的独立分析判断和对国际证券市场的相对比较	电子、信息技术；传播与文化产业；医药与生物制品；批发和零售贸易；金融、保险业。
周期性行业	价格波动较大、受宏观经济和国家产业政策影响较大	充分紧盯行业景气度指标的变化，进行波段操作	石油化工；金属、非金属；建筑业；房地产业。

## 2) 行业优选

在行业归类的基础上，按照不同类别行业的不同特性，按照国家政策、国内宏观经济形势和各产业发展情况，进行行业的筛选。具体步骤是：

A、编制行业景气度数据。根据国家统计局和国家信息中心等权威机构统计的数据编制各行业的景气度数据，然后根据过去四个季度行业景气度的历史数据，由行业研究员对未来四个季度行业景气度做出预测。然后按照行业景气度的绝对值和变化情况选出绝对值最高和上升速度最快的部分行业。

B、将选出的行业与国际同行业进行比较，比较的内容主要包括所选行业与发达国家相同行业的周期性差异，与国外同行业上市公司的平均市盈率和市净率水平比较，有代表性公司的市盈率、市净率水平比较。

C、确定各行业的投资比例。在不超过该行业流通市值所占沪深市场总流通市值比例3倍的范围内，基金经理可以根据研究报告决定在单个行业上的投资比重，超过3倍的投资建议必须提交公司投资决策委员会讨论。本基金在单个行业上的投资比例不超过该行业流通市值占全市场流通市值的5倍。

## 3) 股票精选标准

在确定行业投资比例后，本基金将根据以下几个方面最终确定所选股票：

### A、公司在行业中的地位：

主要用以下几个标准来衡量，一是公司的核心竞争力，主要包括技术水平、营销能力等；二是产品的市场占有率；三是主要产品的销售收入增长率；四是净利润增长率。先对各指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为股票的综合排名。

### B、财务稳健性：

公司财务稳健性主要从盈利能力（包括成长性）和偿债能力两方面考虑。

由于本基金主要投资于那些能够充分分享中国经济增长的、行业景气度不断

提升、有良好业绩记录和较高业绩增长预期的上市公司的股票，所以对上市公司财务状况的关注主要集中在公司盈利能力的历史纪录以及变化趋势方面，这方面的指标主要包括净资产收益率、总资产收益率、销售收入增长率、主营业务收入增长率、净利润增长率五个指标，在给上市公司财务状况评分过程中这 5 个指标的权重最高；与此同时，本基金对上市公司的财务风险也比较关注，如果公司销售收入的快速增长是建立在大量举债的基础上，那么公司的业绩增长就缺乏可持续性，因此，本基金对上市公司偿债能力的分析指标（如资产负债率、流动比率）也给予了一定的权重。对于其他方面的财务指标，如每股经营活动现金流、净资产周转率等则作为参考指标，在具体的财务状况评分中基本不计入权重。

公司研究员按照上述的方法，对候选公司的财务状况进行综合打分，作为反映公司财务稳健性的指标。为了保证上述评分方法的有效性，本基金将每半年对评分体系进行检讨，必要时适当调整指标所占的权重。

#### C、公司的管理水平和信息透明度：

本基金选择的上市公司的管理能力参考指标主要包括企业家能力、企业发展战略、组织\控制\激励体系三类指标。在上市公司信息透明度方面，主要参考信息披露、投资者沟通、内部人控制等指标。通过对上述两类指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为股票的综合排名。

#### D、流动性：

主要考虑流通市值和换手率指标。首先剔除过去一年日平均换手率低于 1% 的个股，然后根据过去一年的日均流通市值和换手率数据，先对各指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为股票的综合排名。

按照以上步骤，我们按照一定的权重加权排名作为股票的综合排名，最终精选出 50 只股票，组成本基金持仓股票组合。

#### （4）股票调整

依据本基金选股指标体系进行动态调整，调整范围如下：本基金定期公告的重点关注股票；拟上市股票；公司基本面发生重大改变的股票；其他经过投资决策委员会依据研究报告认定的股票。以上这些股票一起构成本基金股票的候选股票组合。

股票的调整根据安全边际的大小进行。即：研究员每周对持仓股票及候选股票的安全边际进行排名比较，对于落入后 10% 的持仓股票将于下周适当时机卖出，对于进入后 20%-10% 之间的候选股票将于下周适当时机买入，但持仓股票数量始终维持在 50 只不变。其中：

股票安全边际=股票内在价值-股票市场价格

本基金对股票内在价值的计算主要依据 DCF 模型和市盈率定价模型。

### 3、债券组合的构建与调整

本基金为主动管理的股票型基金，债券投资收益是基金投资收益的来源之一，债券组合的构建与调整依据下列标准进行：

- (1)类似信用等级和期限的债券中选择到期收益率较高的债券；
- (2)类似信用等级、久期及到期收益率水平的债券中选择凸性较大的债券；
- (3)流动性较高的债券；
- (4)可获得较好当期收益的债券；
- (5)其他价值被低估、有增值潜力的债券。

### (五) 投资决策流程

#### 1、研究过程

研究部门通过对宏观经济形势及证券市场走势的研究与分析，向投资决策委员会提交资产配置研究报告。

#### 2、决策机制与决策过程

##### (1)决策依据

国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定是本基金进行投资的前提；宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势是本基金投资决策的基础；投资对象收益和风险的科学合理配比是本基金维护投资者利益的重要保障。

##### (2)决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的报告对基金的资产配置下达指导性意见，基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责。

### 3、投资组合的构建

通过自上而下地进行行业优选和个股选择，适度集中投资，相对长期持有，构建本基金的投资组合。

#### A、股票投资组合的构建。

通过自上而下地进行行业优选和个股选择，适度集中投资，相对长期持有，构建本基金的股票投资组合。

#### B、债券投资组合的构建。

本基金的债券投资作为股票投资的有益补充，可以提高投资组合收益并适当分散风险。

### 4、交易过程

基金经理通过投资管理系统向集中交易室下达投资指令。中央交易室负责交易执行和一线监控。

## 5、投资组合调整过程

基金经理密切关注宏观经济及市场形势,结合基金申购赎回情况和组合调整情况等,对投资组合进行动态监控和调整。

6、业绩与风险评估过程:基金经理小组和公司专职投资评估员按照投资决策委员会指导性方针和投资实施方案对投资业绩进行评估。

## (七)投资限制

### 1、投资组合管理的限制

本基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定,运作管理本基金。本基金投资组合必须遵循下列规定:

- 1) 本基金投资于股票、债券的比例,不低于本基金资产总值的80%;
- 2) 本基金持有一家上市公司的股票,不超过本基金资产净值的10%;
- 3) 本基金投资于股票的比例不低于本基金资产净值的20%;
- 4) 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%,并按有关规定履行信息披露义务;
- 5) 中国证监会规定的其它比例限制。

在本基金成立六个月内,应达到上述比例限制。因基金规模或市场剧烈变动导致投资组合不符合上述规定时,本基金管理人将在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。

### 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

- 1) 投资于其他基金;
- 2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;
- 3) 动用银行信贷资金从事证券买卖;
- 4) 将基金资产用于非法担保、资金拆借或者贷款;
- 5) 从事证券信用交易;
- 6) 以基金资产进行房地产投资;
- 7) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资;
- 8) 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券;
- 9) 违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格;
- 10) 进行内幕交易、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为;
- 11) 通过股票投资取得对上市公司的控制权;
- 12) 因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他

持有 5%以上投票权的股东恶意串通，致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法权益；

13) 证券法规规定禁止从事的其他行为。

(八) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全和增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；
- 4、基金管理人按照有关规定代表基金行使股东权利。

## 十五、基金的资产

(一) 基金资产总值

基金资产总值是指基金所拥有的各类证券价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其它投资等所形成的资产总和。

(二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(三) 基金资产的账户

本基金资产按有关规定开立基金专用资金账户、证券账户，与基金管理人、基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户严格分开、相互独立。

(四) 基金资产的保管和处分

本基金资产独立于基金管理人、基金托管人、基金销售代理人和登记注册人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、登记注册人以其自有的资产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押或其它权利。除依《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其它有关规定处分外，基金资产不得被处分。

## 十六、基金资产估值

(一) 估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

(二) 估值日

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

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法：

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

#### （2）未上市股票的估值：

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

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；

非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

#### （4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的

收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，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估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

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

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值办法：

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

因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

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

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。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。

#### (六) 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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同

行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

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

## 2、差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

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

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法

规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金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

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。

基金份额净值出现错误时，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；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；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、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，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。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

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

（4）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （七）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、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投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （八）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工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。

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,由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

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。

#### (九) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(4)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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十七、基金的费用与税收

### (一) 基金运营过程中,从基金资产中支付的费用

#### 1、费用种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 证券交易费用;
- (4) 基金信息披露费用;
- (5) 基金份额持有人大会费用;
- (6) 与基金相关的会计师费和律师费;
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

#### 2、费用计提方法、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## (2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 上述(一)项1中(3)至(8)项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金成立前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

## 3、不列入基金费用的项目

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

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，经中国证监会核准公告后，无需召开基金份额持有人大会决议通过。

## (二) 申购和赎回费用

1、本基金申购费用最高为不超过申购金额的3%。申购费用由申购人承担，不列入基金资产。

2、本基金赎回费用最高为不超过赎回金额的1%。赎回费由赎回人承担，在扣除登记注册费用和基本手续费后，剩余部分归入基金资产。如赎回费率采用按持有期递减的方式，持有期达一定期限后，则赎回费率仅收取返还基金资产部分。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## (三) 基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务依照国家税收法律、法规的规定予以确定和履行。

## 十八、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、 买卖证券差价；
- 2、 基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、 银行存款利息；
- 4、 已实现的其它合法收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

- 1、 本基金的收益以现金形式进行分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金单位净值自动转为基金单位再投资于本基金。红利再投资免收手续费，并不受最低申购金额限制；除非基金份额持有人成功办理了选择取得红利再投资，否则其持有本基金基金单位的默认分红方式为现金红利。
- 2、 每一基金单位享有同等分配权；
- 3、 基金收益分配比例按有关规定制定；
- 4、 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 5、 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 6、 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满3个月则可以不进行收益分配；
- 7、 基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值；
- 8、 法律法规以及中国证监会的其它规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

#### (六) 收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收申购费用；
- 1、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

### 十九、基金的会计与审计

#### (一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任人；
- 2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；基金募集的会计年度按如下原则处理：如果基金成立少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、凭证（原始凭证由托管行保管）并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

#### (二) 基金审计

- 1、本基金管理人聘请具有证券从业资格的注册会计师对基金进行年度审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案；
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在5个工作日内公告。

### 二十、基金的信息披露

本基金的法定信息披露按照相关法律法规的要求执行。

本基金采取主动披露的方式增加对外信息披露的内容。

#### (一) 法定信息披露

- 1、法定信息披露的形式

本基金通过至少一种中国证监会指定的全国性报刊和本公司互联网网站进行信息披露。

## 2、法定信息披露的内容及时间

### (1) 招募说明书

本基金合同生效后，应按有关规定于每六个月结束之日起四十五日内编制并公告《更新的招募说明书》。《更新的招募说明书》应按规定报中国证监会审核，并在指定媒体公告。

### (2) 成立公告书

在募集期间内，若基金募集满足成立条件时，管理人应于基金成立日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上刊登基金成立公告书。

### (3) 年度报告、半年度报告、季度报告

基金成立后，年度报告在每个会计年度结束后 90 日内公告；半年度报告在每个会计年度前 6 个月结束后 60 日内公告；季度报告在每个季度结束后 15 个工作日内公告。

### (4) 基金份额净值公告

每开放日的次日披露该开放日本基金的基金份额净值和基金份额累计净值。

### (5) 临时公告

基金在运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益产生重大影响的事项时，基金管理人须按照法律法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告：

- 1) 基金份额持有人大会决议；
- 2) 基金管理人、基金托管人或登记注册人变更；
- 3) 基金管理人或基金托管人的董事、监事和高级管理人员变动；
- 4) 基金管理人或基金托管人主要业务人员一年内变更达30%以上；
- 5) 基金经理更换；
- 6) 重大关联事项；
- 7) 基金管理人或基金托管人及其董事、监事和高级管理人员受到重大处罚；
- 8) 重大诉讼、仲裁事项；
- 9) 基金终止；
- 10) 基金发生巨额赎回并延期支付；
- 11) 基金暂停申购或赎回；
- 12) 暂停期间需要公告的其它情形；
- 13) 开始或者重新开始申购、赎回等一项或多项业务的办理；
- 14) 基金转换等其他业务的推出；
- 15) 基金费用的调整；

- 16) 基金投资限额的调整；
- 17) 增加或减少销售代理人；
- 18) 基金所投资的上市公司或发债主体发生重大事项；
- 19) 基金或为基金提供服务的相关机构出现有关事项，有可能影响投资人对基金风险和未来表现的评估；
- 20) 其他重大事项。

## (二) 主动信息披露

### 1、主动信息披露的形式

本基金通过本公司互联网网站或公众媒体进行信息披露。

### 2、主动信息披露的内容及时间

(1) 按季度公告全部投资组合。

(2) 按季度公告本基金下一季度所关注的股票（不超过十只）。

(3) 按季度主动披露的信息在每个季度结束后 15 个工作日内公告，且披露时间不早于法定披露。

## (三) 基金信息披露文件的存放与查阅

本基金定期更新的招募说明书及其摘要、年度报告、半年度报告、季度报告、临时报告、基金资产净值公告等公告文本存放于基金管理人、基金托管人、销售代理人的办公场所，在办公时间内可供免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十一、基金的终止与清算

### (一) 基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

1. 基金经持有人大会表决终止的；
2. 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
3. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；
4. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；
5. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

6. 中国证监会允许的其他情况。

## (二) 基金的清算

### 1、基金清算小组

- (1) 自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。
- (2) 基金清算小组成员由基金发起人、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。
- (3) 基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

### 2、清算程序

- (1) 基金终止后，由基金清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金资产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金资产进行估值；
- (4) 对基金资产进行变现；
- (5) 将清算结果报告中国证监会；
- (6) 公布基金清算公告；
- (7) 对基金资产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金资产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款(1)至(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后三个工作日内公告。

### 6、清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

## 二十二、违约责任

(一) 由于《基金合同》一方当事人的过错，造成《基金合同》不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属《基金合同》双方或多方当事人的过错，根据实际情况，双方或多方当事人分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

- 1、基金管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或现时有效的法律、法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；
- 2、在没有过错的情况下，基金管理人由于按照本《基金合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权利而造成的损失等。

(二) 《基金合同》当事人违反《基金合同》，给其他方造成直接损失的，应进行赔偿。

(三) 《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。

## 二十三、争议的处理

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，应由各方通过协商予以解决。协商自一方向其他各方发出书面协商通知之日开始。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权就该争议向有管辖权的人民法院提起诉讼。在争议处理期间，除争议事项外，《基金合同》的其他条款继续全面有效，各方当事人均应遵守、履行。

## 二十四、通知与送达

(一) 与本合同有关的任何事宜，如需书面告知本合同的当事人，应以下述方式作出书面通知：

- 1、如通知基金发起人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 2、如通知基金管理人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 3、如通知基金托管人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 4、如通知基金份额持有人：采用挂号邮寄、电子邮件、传真或公告的方

式。

(一) 上述通知应当送达至相关当事人的下述地址或号码：

- 1、基金份额持有人：在认购或申购基金时登记的通信地址或其更改后的通信地址，采用公告通知的方式除外。
- 2、基金发起人：长盛基金管理有限公司  
地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271，邮政编码：100028  
传真：010-64689475  
收件人：长盛基金管理有限公司
- 3、基金管理人：长盛基金管理有限公司  
地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271，邮政编码：100028  
传真：010-64689475  
收件人：长盛基金管理有限公司
- 4、基金托管人：中国农业银行  
地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦 邮政编码：100037  
传真：010-68424181  
收件人：中国农业银行托管部负责人

(二) 送达

- 1、以面呈递交方式作出的通知，面呈递交时即视为送达；
- 2、以挂号邮寄方式作出的通知，在邮件发出后第七日即视为送达；
- 3、以传真的方式作出的通知，在传真发出后即视为送达；
- 4、以公告方式作出的通知，在公告发布当日即视为送达，但法律法规另有规定的除外。

## 二十五、《基金合同》的效力

- (一) 本《基金合同》经基金发起人、基金管理人、基金托管人三方盖章以及三方法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。
- (二) 本《基金合同》的有效期限自其生效之日起至本基金清算结果报中国证监会批准并公告之日止。
- (三) 本《基金合同》自生效之日起对包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。
- (四) 本《基金合同》及其修订本正本一式五份，除上报有关监管机构二份外，基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律

效力。

- (五) 本《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资人可免费查阅；也可按工本费购买本《基金合同》印制件或复印件，但应以《基金合同》正本为准。

## 二十六、《基金合同》的修改和终止

### (一) 《基金合同》的修改

1. 本基金合同的修改应经基金发起人、基金管理人和基金托管人同意；
2. 修改本基金合同应召开基金份额持有人大会，基金合同修改的内容应经基金份额持有人大会决议通过；
3. 基金合同的修改应报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属本基金合同必须遵照进行修改的情形或基金合同的修改事项对基金份额持有人的利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### (二) 《基金合同》的终止

- 1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：
  - (1) 基金经持有人大会表决终止的；
  - (2) 因重大违法行为，基金被中国证监会责令终止的。
  - (3) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；
  - (4) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的托管机构承受其原有权利及义务；
  - (5) 中国证监会允许的其他情况。
- 2、《基金合同》的终止。本基金终止后，须依法和本《基金合同》对基金进行清算。本《基金合同》于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

## 二十七、其他事项

基金合同当事人应遵守《长盛动态精选证券投资基金业务规则》(以下称《业务规则》)。《业务规则》由基金管理人制订，并由其解释与修改。

本基金合同未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商

解决。如果协商的结果导致本基金合同的修改，则应召开持有人大会，对基金合同的修改达成决议。

(此页无正文, 仅用于长盛动态精选证券投资基金合同的签署)

基金发起人:(法定代表人或授权代表签字盖章)

基金管理人:(法定代表人或授权代表签字盖章)

基金托管人:(法定代表人或授权代表签字盖章)

签订地:中国北京

签订日:二零零 年 月 日