

# 长盛成长价值证券投资基金 招募说明书（更新）

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

## 重要提示

本基金由基金管理人经中国证监会证监基金字[2002]57号文批准募集设立，核准日期为2002年8月19日。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本更新招募说明书。

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。

本基金的基金合同已根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其它有关规定进行修订。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2005年4月18日，有关财务数据和净值表现截止日为2005年3月31日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、绪言.....	4
二、释义.....	4
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	11
五、相关服务机构.....	14
六、基金的募集.....	17
七、基金合同的生效.....	17
八、基金份额的申购与赎回.....	17
九、基金的投资.....	21
十、基金的业绩.....	29
十一、基金财产.....	30
十二、基金资产估值.....	30
十三、基金的收益与分配.....	32
十四、基金的费用与税收.....	33
十五、基金的会计与审计.....	35
十六、基金的信息披露.....	35
十七、风险揭示.....	38
十八、基金的终止与基金财产的清算.....	39
十九、基金合同的内容摘要.....	40

二十、基金托管协议的内容摘要 .....	51
二十一、对基金份额持有人的服务 .....	54
二十二、其他应披露事项.....	55
二十三、招募说明书的存放及查阅方式 .....	56
二十四、备查文件.....	56

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》等有关法规以及《长盛成长价值证券投资基金基金合同》编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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》、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。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 基金合同：指《长盛成长价值证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
- 招募说明书、本招募说明书：指《长盛成长价值证券投资基金招募说明书》及根据法律法规定期作出的更新
- 发行公告：指《长盛成长价值证券投资基金发行公告》
- 《证券法》：指1998年12月29日经第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过，并于1999年7月1日正式颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订
- 《基金法》：指2003年10月28日第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，并于2004年6月1日正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

元：	指人民币元
基金账户：	指基金注册登记机构为投资者开立的记录其持有长盛基金管理有限公司所管理的开放式基金的基金权益和客户资料情况的账户
基金或本基金：	指依据《基金合同》所设立的长盛成长价值证券投资基金
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、赎回和其它基金业务的代理机构
基金注册登记机构：	指长盛基金管理有限公司
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体
个人投资者：	指具有中国国籍的，有完全民事行为能力的自然人
机构投资者：	指经有关政府部门批准设立并在中国境内合法注册的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织
基金成立日：	指自招募说明书公告之日起三个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元，且基金份额持有人的人数不少于 200 户的条件下，基金发起人可以依据《基金法》、《运作办法》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、赎回或其它交易的申请日
日常申购：	指基金投资者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份额的请求。基金的日常申购从基金成立后不超过 1 个月开始办理
日常赎回：	指基金投资者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份额的请求。基金的日常赎回从基金成立后不超过 1 个月开始办理
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它收益

基金资产总值：	指基金所购买的各种证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其它投资所形成的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值
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份额资产净值的过程
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
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、基金管理人

#### (一)基金管理人概况

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：凤良志

电话：(010) 64689198

传真：(010) 64689475

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6 号文件批准，于 1999 年 3 月成立，注册资本为人民币 10000 万元。目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券有限责任公司 49%、安徽省创新投资有限公司 26%、安徽省投资集团有限责任公司 25%。截至 2004 年 12 月 31 日，基金管理人共管理四支封闭式基金、三支开放式基金和社保基金委托资产，管理资产规模约 140 亿元。

#### (二) 主要人员情况：

##### 1、基金管理人董事会成员：

凤良志先生，董事长，51 岁，博士，高级经济师。曾历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、安徽省国际信托投资公司副总经理、安徽省证券管理办公室主任、安徽省政府驻香港窗口公司(黄山有限公司)董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理（主持工作）、安徽国元控股（集团）有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长，现为国元证券有限责任公司董事长。

钱进先生（342301194601110231），董事，58 岁，学士，高级工程师。曾历

任安徽省全椒柴油机厂厂长、党委书记，全椒县政府副县长，全椒县委副书记、书记，滁州市常务副市长、市长，安徽省经贸委副主任，现为安徽省投资集团有限责任公司总经理、党委书记。

蔡咏先生，董事，44岁，学士，高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国（塞班）分公司任财务经理，历任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司（黄山有限公司）总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理，现为国元证券有限责任公司董事、总裁。

叶斌先生，董事，45岁，学士，高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任，历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理，现为安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省创新投资有限公司总经理。

陈平先生，董事，42岁，硕士研究生。曾在合肥工业大学管理系任教，历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理，现为国元证券有限责任公司副总裁。

钱进先生（340104650425209），董事，39岁，硕士研究生。曾历任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理，现为安徽省投资集团有限责任公司资本运营部经理。

蒋月勤先生，董事、总经理，38岁，硕士。曾历任中信证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、交易部副总经理、总经理、中信证券股份有限公司证券交易室首席交易员，现为长盛基金管理有限公司董事、总经理。

徐经长先生，独立董事，38岁，博士，教授；中国人民大学商学院MPAcc中心主任，会计系副主任。财政部教材编审委员会委员；香港中文大学和清华大学FMBA项目特聘教授；香港理工大学MPAcc项目特聘教授。已主持国家社科基金、国家自然科学基金、财政部重点会计科研课题四项；主要研究领域为国际比较会计、证券市场会计监管。已公开出版专著两部，主编教材五本；在《经济理论与经济管理》、《财贸研究》、《会计研究》等核心期刊中发表论文100余篇。

荣兆梓先生，独立董事，55岁，经济学学士，教授；兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学院副主编，现为安徽大学经济学院院长，校学术委员会委员，产业经济学和工商管理硕士点学科带头人；武汉大学商学院博士生导师，安徽省政府特邀咨询员；全国马经史学会常务理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会常务理事。

陈华平先生，独立董事，39岁，博士毕业，教授，博士生导师。曾历任中国科技大学商学院信息管理与决策研究室主任、中国科技大学商学院商务智能实验室主任，现为中国科技大学商学院副院长，中国科技大学“管理科学与工程”

一级学科博士点的学科带头人。

李伟强先生，独立董事，45岁，美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士，美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾历任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁，现为花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁。

## 2、基金管理人监事会成员：

钱正先生，监事，51岁，学士，高级经济师。曾历任安徽省人大常委办公厅副处长、处长，安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记，安徽省国有资产管理局分党组书记，现为安徽省创新投资有限公司董事长。

陶炜先生，监事，39岁，学士，经济师。曾历任海南联合租赁公司总经理助理、中山集团财务公司证券营业部经理、南京民生租赁有限公司董事长，现为江南模塑科技股份有限公司董事长、国元证券有限责任公司副董事长。

肖强，监事，37岁，学士。曾历任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理，中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师，中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司，历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理，现为长盛基金管理有限公司投资部副总监。

## 3、本基金基金经理

吴刚先生：1969年出生，毕业于南开大学数学系数理统计专业，获理学硕士学位。1994年7月至1995年7月在君安资产管理公司工作；1995年7月至1996年10月就职于太平洋保险公司深圳分公司；1996年10月至2002年4月在中国信证券有限公司任投资经理；2002年4月至2003年1月在中融基金管理公司任基金经理；2003年2月加入长盛基金管理有限公司，现任长盛成长价值基金基金经理。

## 4、投资决策委员会成员

蒋月勤先生：硕士。历任中信证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、交易部副总经理、总经理、中信证券股份有限公司证券交易室首席交易员。现任长盛基金管理有限公司董事、总经理。

陈礼华先生：硕士，高级经济师。1983年至1988年大学任教，1991年至1998年国务院财税物价大检查办公室、财政部国债司、财政部国债金融司工作；1998年至2000年华泰保险公司投资部工作，2000年至2004年底任南方基金管理公司投资总监、投资交易总监、总经理助理；2005年1月起任长盛基金管理公司副总经理。

梁建敏先生，学士学位。历任原化工部经济信息研究中心副处长、原化工部行业指导司协会管理处副处长、处长；国泰君安证券股份有限公司一级研究员，

2002年6月加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司研究发展部副总监。

闵昱先生：硕士。1999年加入长盛基金管理有限公司投资管理部，历任基金同智、基金同德基金经理助理、基金同智基金经理，兼任长盛基金管理有限公司机构理财部副总监。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制基金季度报告、中期和年度基金报告；

7、计算基金资产净值并公告基金份额资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### （四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规的行为发生；

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

### 3、基金经理承诺

（1）依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有

人谋取最大利益；

(2) 不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

(4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制制度概述

本公司所有工作流程均有相应的规章制度。这些规章制度是按照 ISO9000 的标准撰写成稿的，与公司真正工作情况完全符合。

本公司的内部控制制度就是在上述各项管理制度的基础上完成的，涉及公司管理的各个方面：人事、研究发展、投资管理、业务营运、市场发展、战略发展、信息技术、监察稽核和公司后勤、财务。

##### 2、内部控制制度具备的要素

###### (1) 控制环境

公司建立了保证公司具备内部会计控制和风险管理控制的制度，建立了有公司高管监督的控制和已明确规定控制的责任。

公司的风险控制由董事长总体负责，董事长下设专门向其汇报工作的督察长。督察长的日常工作就是负责公司营运的合规审查。此外，董事会下设由独立董事任主任的三个专门委员会：合规控制委员会、资格审查委员会和薪酬委员会。总经理负责公司的日常管理，其中风险控制是其工作的重要内容之一。总经理主要通过以下两个机构的协助来完成风险控制。一为总经理直接挂帅的风险控制委员会，另一为监察稽核部。风险控制委员会由总经理、副总经理，各部门总监组成。主要职能是：通过定期会议的形式，交流各部门运作中的风险控制情况。监察稽核部则由总经理直接领导，向总经理负责，主要负责公司日常营运中的流程合理性的控制。

###### (2) 控制的性质和范围

内部会计控制包括基金会计账簿建立、基金会计档案的保管、净值计算及公告、基金会计岗位设置及职责等方面，保证及时、准确地进行基金交易清算及会计核算。公司已建立完善的风险控制体系，由风险控制委员会负责风险控制制度与风险控制目标的控制，其中授权制度下的限额交易成为重要的事前风险控制点。投资部具体执行日常的投资风险管理，绩效与风险评估小组定期评估投资组合风险，并由监察稽核部进行动态监控以及公司内部风险管理。公司通过严格的投资控制程序、资产配置决策及调整制度、通过股票池制度强调对个股的研究等控制措施来实现对投资过程面临的市场风险和操作风险的防范。同时通过

数量化的风险监控方法控制流动性等风险。

### (3) 实施

公司已建立详细、书面化的内部控制指引，使内部控制制度和各项控制措施能够得以有效实施。

### (4) 检查

公司已建立了一套严格检验程序，以检验控制制度建立后能得到执行，主要由监察稽核部定期或不定期地检查各个部门的工作流程，以纠正不符合公司规章制度的情况，对制度中存在的合理情况，监察稽核部有权提请相关部门修改。上述文书同时抄报总经理和公司督察长，以保证多重检查复核。

同时，公司的内部控制制度会随着市场的发展和金融创新来进行相关调整。一般而言，当市场有变化或主管部门有新的规章制度时，相关制度会相应更改。公司的规章制度由监察稽核部负责，每年进行检查更新。

### (5) 报告制度

公司已经建立了一套报告制度。报告制度能将内部控制制度中的实质性不足或控制失效及时向公司高级管理层和监管部门进行报告。公司的督察长定期向中国证监会和公司董事长出具监察稽核报告，指出近期存在的问题，提出改进的方法和时间。监察稽核部总监负责公司的日常监察稽核工作，定期向总经理出具工作报告。

## 3、基金管理人内部控制制度声明书

- 1) 本管理人以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- 2) 本管理人将根据市场变化来不断完善内控制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行

注册地址：北京市复兴路甲 23 号

办公地址：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：杨明生

成立时间：1979 年 2 月 23 日

注册资本：1338.65 亿元人民币

存续期间：持续经营

发展概况及财务状况：

中国农业银行是我国最大的商业银行之一，目前在国内有 37 家分行、营业机构遍布城乡，是我国营业网点最多、机构覆盖面最广的金融机构。同时，中国农业银行拥有全国最大的电子化网络，拥有先进的银行清算系统和安全、高效的清算、交割能力，已实现先进的电子联行、资金汇划的实时清算和汇划、对账、清算三位一体，能保证客户资金在同城或异地的安全、高效的清算、交割。2003 年，英国《银行家》杂志评选的全球 1,000 家大银行中中国农业银行位列第 25 名。

## 2、托管业务部的部门设置及员工情况

1998 年 5 月，中国农业银行证券投资基金托管部经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设营运中心、技术保障处、风险管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、投资银行处和综合管理处，拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统，现有员工 50 名。

## 3、主要人员情况

杨明生先生：中国农业银行党委书记、行长。49 岁，硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行辽宁省分行办公室副主任，农行沈阳市分行副行长、党组成员，农行工业信贷部主任助理、副主任、主任，农行天津市分行副行长、党组副书记（主持工作），农行天津市分行行长、党组书记，农行副行长、党委副书记，现任农行党委书记、行长。

杨琨先生：中国农业银行副行长。46 岁，硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行人事部劳动工资处处长，农行人事教育部副主任，农行市场开发部总经理，农行安徽省分行行长、党委书记，中国农业银行行长助理。现任中国农业银行副行长。

张军洲先生：托管业务部总经理，42 岁，博士，高级经济师，曾任中国农业银行信托投资公司总经理助理、副总经理，农行总行法律事务部副总经理、总经理，现任托管业务部总经理。

刘树军先生：托管业务部副总经理。45 岁，工商管理硕士，高级经济师、高级记者。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书，农行总行信贷部工业信贷处处长，现任托管业务部副总经理。

王勇先生：托管业务部副总经理。50 岁，大学，高级经济师，曾任财政部国债金融司处长、中央国债登记公司总经理，现任托管业务部副总经理。

## 4、证券投资基金托管情况

截止 2004 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式基金如下：基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景博、基金景福、

基金兴业、基金天华、基金同德、基金景业、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛中信债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、天同保本增值、大成精选增值开放式基金，托管基金规模达 414 亿份基金份额。

## （二）基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## （三）基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将法律法规、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户，基金管理人的基金划款指令书等监督基金管理人的其他行为，同时记录工作日志。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、长盛基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市朝阳区北三环东路8号静安中心2072

电话：（010）64689198—245、211

传真：（010）64689520、64689521、64689522

联系人：关威

客户服务电话：010-84510088

#### 2、长盛基金管理有限公司上海直销中心

地址：上海浦东新区世纪大道1600号浦项广场2014室

电话：（021）50580120、50580122

传真：（021）50580121

联系人：冯岩

#### 3、中国农业银行

注册地址：北京市复兴路甲23号

法定代表人：杨明生

电话：（010）68298560、68297268

传真：（010）68297268

联系人：蒋浩

客户服务电话：95599

#### 4、中信实业银行

注册地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：窦建中

电话：（010）65541089

传真：（010）65542178

联系人：官玫

#### 5、招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：秦晓

电话：（0755）82090060

传真：（0755）82090817

联系人：刘薇

6、深圳发展银行

注册地址：深圳市深南东路 5047 号

法定代表人：周林

电话：（0755）82088888-8811

传真：（0755）82080714

联系人：周勤

7、中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

法定代表人：王东明

电话：（010）84864818 转 63266

传真：（010）84865560

联系人：陈忠

8、华夏证券有限公司

注册地址：北京市东城区新中街68 号

法定代表人：周济谱

电话：（010）65186758

传真：（010）65185322

联系人：权唐

9、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

法定代表人：祝幼一

联系电话：（021）62580818-177

传真：（021）62583439

联系人：顾文松

客户服务热线：4008888666

10、广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

法定代表人：王志伟

联系电话：（020）87555888

传真：（020）87557985

联系人：肖中梅

11、国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012 号国信证券大厦16-26 层

法定代表人：李南峰

联系电话：（0755）82133296、82130833-2117

传真：（0755）82133302

联系人：鞠玮

12、联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、14、24、25楼

法人代表人：王世宏

联系电话：（0755）82493583

传真：（0755）82492187

联系人：杨军

13、中国银河证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：朱利

联系电话：（010）66568587

传真：（010）66568536

联系人：郭京华

14、中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

联系电话：（0532）5022026

传真：（0532）5022511

联系人：陈向东

（二）注册登记机构

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：凤良志

成立时间：1999年3月

电话：（010）64689198

传真：（010）64689475

（三）出具法律意见书的律师事务所

律师事务所：北京信利律师事务所

注册地址：北京市建国门内大街18号恒基中心1座609室

法定代表人：江山

电话：（010）65515885

传真：（010）65515889

经办律师：谢思敏、丁志钢

（四）审计基金财产的会计师事务所

法定名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区沈家弄325号

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：Kent Watson

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

经办注册会计师：汪棣、陈玲

## 六、基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2003年6月17日证监基金字[2003]80号文批准募集。募集期为2002年8月26日到2002年9月13日。经普华永道中天会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，设立募集期共募集3,166,886,000份基金份额，有效认购户数为6,325户。

## 七、基金合同的生效

（一）基金合同生效（原基金合同成立）

本基金合同已于2002年9月18日生效。

（二）基金存续期内基金份额持有人数量和资金量的限制

本基金合同生效后的存续期间内，基金份额持有人数量不满200户或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。法律、法规或证券监管部门另有规定的，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

（一）日常申购与赎回的场所

参见基金份额发售机构。

## （二）申购与赎回的开放日及开放时间

1、申购、赎回的开放日：指本基金为投资人办理基金份额申购、赎回等业务的工作日，为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购、赎回时除外）。

申购开始日：2002年10月18日

赎回开始日：2002年10月18日

### 2、营业时间：

上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日交易时间，即上午9:30-11:30，下午1:00-3:00。

若未来证券交易市场、证券交易所交易时间更改或根据实际情况需要，基金管理人可以对申购、赎回时间进行调整，但需报中国证监会备案，并在实施前3个工作日在至少一种证监会指定的媒体上刊登公告。

## （三）申购与赎回的数额限制

1. 本基金直销网点和代销网点单笔最低申购金额为1,000元。
2. 本基金赎回份额为不超过余额的任意份额。
3. 基金管理人可视市场情况对以上限制进行调整并报中国证监会备案。
4. 申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额资产净值为基准计算，保留到小数点后两位，剩余部分四舍五入。
5. 赎回支付金额的处理方式：赎回支付金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额资产净值为基准并扣除相应的费用，保留到小数点后两位，剩余部分四舍五入。

## （四）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销售网点规定的程序，在工作日的交易时间内向基金销售网点提出申购或赎回的申请。

### 2、申购和赎回申请的确认

注册登记机构应以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并进行权益登记。投资者可在T+2工作日之后（包括该日）向基金销售网点进行成交查询。

### 3、申购和赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式。投资者在代销机构办理申购时，必须在指定资金账户存有足额的申购款项，若资金不足则申购不成功。

在直销机构办理申购时，以投资者资金到账并提交申请为原则办理申购

业务，申购申请在三个工作日内有效。若资金到账日先于投资者提交申购申请日，则以投资者申购申请日为申请受理日；若资金到账日迟于投资者提交申购申请日，则以投资者资金到账日为申请受理日。

投资者赎回申请成交后，成功赎回的款项将在T+7个工作日之内向基金份额持有人（赎回申请人）指定账户划出。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

#### 4、日常申购与赎回的登记注册

正常情况下，投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1工作日自动为投资者登记权益并办理登记注册手续，投资者在T+2工作日（含该日）可以进行成交确认，并有权赎回该部分基金。投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在T+1工作日自动为投资者扣除权益并办理相应的登记注册手续。

### （五）申购和赎回的数额和价格

#### 1. 本基金申购份额的计算：

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

申购费用=申购金额×申购费率

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份数=净申购金额/ T日基金份额资产净值

基金份额数额四舍五入，保留小数点后两位。

#### 2. 本基金赎回支付金额的计算：

本基金的赎回支付金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T日基金份额资产净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

支付金额 = 赎回金额-赎回费用

赎回金额和支付金额四舍五入，保留小数点后两位。

3. T日的基金份额资产净值在当天收市后计算，并在T+1工作日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （六）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

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. 证券交易所在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、基金销售代理人和注册登记机构的一方或多方

技术系统出现故障或其它原因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它情形。

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。

#### (七) 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者的赎回申请：

1. 证券交易所交易时间非正常停市；
2. 因市场剧烈波动或其它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、基金销售代理人和注册登记机构的一方或多方技术系统出现故障或其它原因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、规章允许的其它情形或其它在《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) 巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若一个工作日内的基金份额净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额）超过上一日基金份额总额的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，基金管理人可以根据投资者的选择进行顺延赎回。

- (1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时，将按正常赎回程序处理投资者赎回申请。
- (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者的赎回申请或全部兑付投资者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份额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。但投资者在

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代销机构的网点在 3 个证券交易所交易日内刊登公告，并说明有关处理方法。

本基金连续三个开放日发生巨额赎回，为连续巨额赎回。如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经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。

#### (九) 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份额资产净值。

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份额资产净值。

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份额资产净值。

## 九、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金为平衡型基金，通过管理人的积极管理，在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长，谋求基金资产的长期稳定增值。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

在股票资产中，本基金投资于成长类股票和价值类股票。本基金按以下方法确定成长、价值类股票：先按照流通市值大小将样本股的所有股票分成大、中、小盘三组，然后在大、中、小盘股票中分别按照市净率（P/B 值）从大到小排序，

以累积流通市值占该组总流通市值的百分比达到 50% 为界, 以流通市值在前 50% 的股票为成长类股票, 后 50% 的股票为价值类股票。

### (三) 投资理念

本基金的投资理念基于管理人对市场有效性和市场结构的认识, 进行主动性管理, 通过动态配置股票、债券和现金三类资产, 在不同的风格资产之间, 包括成长类股票和价值类股票、大中小盘股票之间, 进行相机地周期性轮替操作, 从而实现风险收益的长期稳定增长。

### (四) 投资组合

#### 1、战略性资产配置策略

通过宏观经济、行业周期、股票市场状况和趋势分析来判断债券市场和股票市场投资机会, 进行现金、债券和股票资产的配置。

#### 2、战术性资产配置策略

根据市场环境、投资者情绪和成长价值各类资产的风险-收益状况, 确定股票投资在成长和价值类资产间的配置比例。在成长和价值类资产配置过程中, 根据市值大小进行二次资产配置, 在大盘成长、中盘成长、小盘成长、大盘价值、中盘价值和小盘价值六类资产间进行配置, 具体配置比例限制如下表所示:

	投资下限	投资上限		投资下限	投资上限
大盘成长	5%	40%	大盘价值	5%	40%
中盘成长	5%	50%	中盘价值	5%	50%
小盘成长	5%	40%	小盘价值	5%	40%
成长类合计	30%	70%	价值类合计	30%	70%

#### 3、股票选择策略

##### 1) 确定股票的初选范围

根据中信指数确定的六类风格资产, 删除本公司《投资管理制度》中禁止买入和限制性买入的股票。在此基础上, 确定投资股票的初选范围。

##### 股票风格分类

	高 P/B 值	低 P/B 值
高流通市值	大盘成长	大盘价值
中流通市值	中盘成长	中盘价值
低流通市值	小盘成长	小盘价值

禁止买入的股票, 是指在任何情况下, 都不得买入的股票, 包括:

- a) 严重资不抵债;
- b) ST、PT 公司;
- c) 严重违规的上市公司。

限制买入的股票，是指除特殊情况下，一般不得买入的股票。所称特殊情况，是指投资该上市公司具备以下条件：

- a) 投资该股票具有投资决策委员会认可的特殊充分理由；
- b) 有详细的公司调研报告和投资建议书。

限制买入的股票包括：

- a) 购买时近两年涨幅超过两市综指按总市值加权平均涨幅 100%的上市公司；
- b) 涉嫌违规的上市公司；
- c) 与本公司在股权、债权和人员等方面有重大关联关系的公司发行的证券。

## 2) 确定股票池《备买备卖股票表》

研究员在股票初选范围内，根据对上市公司发展战略、管理水平、业务规模、竞争优势、发展潜力、财务状况和市场表现等方面的研究，提交股票投资建议书，符合规定条件的推荐股票可以纳入股票池《备买备卖股票表》。

## 3) 投资组合构建

基金经理根据股票池推荐的股票和个人选股意见，决定基金的投资品种和投资数量，制定投资计划。

## 4、债券投资策略

基于对国家财政政策、货币政策的深刻理解以及对宏观经济数据的动态跟踪，通过科学的数量分析构造有效的国债投资组合，获取稳定的投资收益。同时关注可转换债等新品种中可能存在的市场套利机会，适时投资获取超额利润。

## （五）基金投资决策

### 1、决策依据

- (1) 国家宏观经济环境；
- (2) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；
- (3) 货币政策、利率走势；
- (4) 地区及行业发展状况；
- (5) 上市公司研究；
- (6) 证券市场的走势。

### 2、决策程序

基金管理人内部设立投资决策委员会和风险控制委员会，基金管理实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策程序如下：

- (1) 研究发展部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告，并在此基础上进行投资论证，作出投资建议提交给基金经理，并

为投资决策委员会提供资产配置的依据。

- (2) 基金经理对研究发展部提交的投资建议进行初步筛选，形成股票初选方案，提交投资决策委员会。
- (3) 投资决策委员会依照研究发展部提供的研究分析报告和基金经理提交的股票初选方案，制定投资决策，其中包括确定投资原则与方向，确定股票、国债和现金的配置比例，确定股票投资的备选范围等。
- (4) 基金经理根据投资决策委员会的投资决策，制定相应的投资组合方案，报投资决策委员会审议批准。
- (5) 投资组合方案经投资决策委员会批准后，由基金经理制定具体的操作计划并以投资指令的形式下达至交易部集中交易室。
- (6) 集中交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。
- (7) 风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提出总结报告。

#### (六) 股票选择标准与程序

- 1、 根据中信指数风格资产分类标准，将所有股票（禁止买入股票除外）分为六类风格资产：小盘价值、小盘成长、中盘价值、中盘成长、大盘价值、大盘成长。
- 2、 在每类风格资产中，按照中国证监会的行业分类标准，将股票分为 13 个大类：农、林、牧、渔业；采掘业；制造业；电力、煤气及水的生产和供应业；建筑业；交通运输、仓储业；信息技术业；批发和零售贸易业；金融、保险业；房地产业；社会服务业；传播与文化产业；综合类。
- 3、 在每个行业中，由负责该行业的研究员选出行业中的优秀公司。其中，在小盘价值、中盘价值、大盘价值等三类价值型资产中选择行业优秀公司时主要考察预期 P/E 指标；在小盘成长、中盘成长、大盘成长等三类成长型资产中选择行业优秀公司时主要考察预期收益增长指标。预期指标的考察周期为未来三年。
- 4、 各行业研究员根据对企业素质的综合考察来预测企业的预期 P/E 或预期收益增长指标。研究员在考察企业素质时主要考虑以下要素：
  - (1) 公司背景及管理
    - 沿革、体制与效率
    - 决策层的素质和能力

- 部门合作与协调
  - 激励机制
  - 凝聚力
  - 公司的主要优势和劣势
- (2) 行业背景
- 行业特性
  - 行业近年来的发展动态
  - 行业发展前景（替代产品的发展、国家特殊的行业政策、国际市场的变化情况）
  - 公司在行业中的地位和竞争优势（如市场占有率变化等）
  - 公司有关经济效益指标与行业平均水平或可比相关公司的比较
- (3) 业务分析
- 主要影响因素分析（原材料供应及市场情况、销售情况、产品技术含量和科研开发、主要竞争对手分析、产品价格分析）
  - 成本及利润分析（分析主要产品或项目的成本、生产能力、实际产销量、利润及毛利率、增长速度等）
  - 投资项目分析（分析在建及计划投资项目的产品市场、收益预测及主要影响因素、未来3年内新项目的利润贡献预测等）
  - 其它对外投资分析
  - 特殊损益分析（税收政策变化、特殊转让收益、财政补贴、会计调整等）
- (4) 财务分析
- 公司财务比率分析
  - 财务结构分析
  - 财务趋势分析
- (5) 发展战略评估

5、各行业研究员通过对以上要素的综合分析，得出企业未来三年的赢利预测，按照预期 P/E 或预期收益增长指标，选出各行业前 35% 的股票进入股票池作为投资备选股票。

#### (七) 业绩比较基准

本基金业绩衡量基准 = 中信综合指数收益率 × 80% + 中信国债指数收益率 × 20%

中信综合指数作为按流通股本加权的综合指数，其指数选股样本覆盖了上交所和深交所上市的所有 A 股，具有较强的指代作用。

#### (八) 风险收益特征

本基金属平衡型基金，在承担适度风险的前提下，获得长期稳定的收益。

#### (九) 投资限制

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。

本基金投资组合应遵循下列规定：

- (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) 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；
- (4) 本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%；
- (5) 本基金持有的股票资产比例为35%-75%，债券资产比例为20%-60%，现金资产比例不低于5%；
- (6) 本基金持有的成长类股票和价值类股票资产的比例均不低于股票资产的30%，不高于股票资产的70%；
- (7) 中国证监会规定的其它比例限制。

#### (十) 禁止行为

禁止用本基金资产从事以下行为：

- 1、 投资于其它证券投资基金；
- 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基金投资；
- 4、 将基金资产用于担保、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、 《基金法》及相关法律法规禁止从事的其它行为。

#### (十一) 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，保护基金投资者的利益；
- 4、 基金管理人按照有关规定代表基金行使股东权利。

#### (十二) 基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2005 年 4 月 19 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。

基金季度报告中的财务资料无须审计，因此本报告期的财务资料未经审计。

本报告会计期间：2005 年 1 月 1 日至 2005 年 3 月 31 日。

1、2005 年 3 月 31 日基金资产组合情况

	金额（人民币元）	占总资产比例
股票市值	823,178,228.34	63.75%
债券市值	296,260,546.01	22.95%
银行存款和清算备付金	88,622,224.52	6.86%
其他资产	83,178,082.15	6.44%
资产合计	1,291,239,081.02	100.00%

2、2005 年 3 月 31 日按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市值（人民币元）	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
2	采掘业	83,072,000.00	6.77%
3	制造业	321,752,801.63	26.22%
	其中：食品、饮料	129,142,053.70	10.52%
	纺织、服装、皮毛	4,576,899.11	0.38%
	木材、家具	0.00	0.00%
	造纸、印刷	3,102,000.00	0.25%
	石油、化学、塑胶、塑料	23,489,188.62	1.92%
	电子	0.00	0.00%
	金属、非金属	101,150,004.76	8.24%
	机械、设备、仪表	42,107,844.44	3.43%
	医药、生物制品	18,184,811.00	1.48%
	其他制造业	0.00	0.00%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	27,058,189.00	2.20%
5	建筑业	494,103.54	0.04%
6	交通运输、仓储业	247,283,684.40	20.15%
7	信息技术业	15,022,772.16	1.22%
8	批发和零售贸易	10,847,013.75	0.88%
9	金融、保险业	51,900,000.00	4.23%
10	房地产业	60,004,804.18	4.89%
11	社会服务业	5,742,859.68	0.47%
12	传播与文化产业	0.00	0.00%
13	综合类	0.00	0.00%
	合 计	823,178,228.34	67.07%

3、2005 年 3 月 31 日按市值占基金资产净值比例大小排序前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（人民币元）	市值占净值比例
1	600583	海油工程	3,200,000	83,072,000.00	6.77%
2	600009	上海机场	5,000,000	82,500,000.00	6.72%
3	600887	伊利股份	4,700,000	60,254,000.00	4.91%
4	000039	中集集团	1,892,486	52,043,365.00	4.24%
5	600036	招商银行	6,000,000	51,900,000.00	4.23%
6	000895	双汇发展	3,210,810	44,469,718.50	3.62%
7	600029	南方航空	10,000,000	39,000,000.00	3.18%
8	600026	中海发展	3,252,000	30,731,400.00	2.50%
9	600012	皖通高速	4,012,287	29,650,800.93	2.42%
10	000089	深圳机场	3,800,000	28,766,000.00	2.34%

## 4、2005年3月31日按券种分类的债券投资组合

	债券市值（人民币元）	市值占净值比例
国家债券投资	189,793,293.23	15.47%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	98,925,000.00	8.06%
可转换债投资	7,542,252.78	0.61%
债券投资合计	296,260,546.01	24.14%

## 5、2005年3月31日按市值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细

序号	债券名称	债券市值（人民币元）	市值占净值比例
1	00 国债 12	50,580,000.00	4.12%
2	03 国债 10	50,000,000.00	4.07%
3	99 国开 13	49,870,000.00	4.06%
4	02 国开 08	49,055,000.00	4.00%
5	20 国债 04	33,710,711.30	2.75%

## 6、投资组合报告附注

(1) 2004年6月22日下午，中国证监会内蒙古监管局组成核查小组进入伊利股份，对该公司进行专项核查。2004年12月22日，伊利股份公告：“2004年12月17日，内蒙古自治区检察院对公司个别高管人员的经济问题正式进行立案调查。因涉嫌挪用公款，目前董事长郑俊怀先生、副董事长杨桂琴女士、董事郭顺喜先生、财务负责人兼董事会秘书张显著先生及证券代表李永平先生已被刑事拘留。”

截至2005年3月31日，本基金共持有伊利股份4,700,000股，主要买入时间在中国证监会内蒙古监管局组成核查小组进入伊利股份之前。买入理由是该股为研究员调研后推荐的股票池中的备选股票且为市场公认的蓝筹股，该公司作为行业龙头，优势明显，参照国际同类公司的估值水平，也具备相当的投资价值。伊利高管的被捕，凸现了该公司法人治理结构存在不完善之处，对其

声誉造成了较大负面影响。事件发生前后，我们多次对该公司进行了实地调研，认为该公司仍然是国内乳品行业最具竞争力的公司之一。此次事件可能成为公司治理结构等多方面改善的契机，近期公司的一系列行为也显示出这种积极迹象，我们会密切关注公司后续经营及管理方面的变化。

(2) 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

	金额（人民币元）
交易保证金	1,000,000.00
证券清算款	4,459,455.72
应收利息	4,183,466.43
应收申购款	55,160.00
其他应收款	73,480,000.00
合计	83,178,082.15

(4) 2005年3月31日持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券市值（人民币元）	市值占净值比例
1	110037	歌华转债	1,983,778.20	0.16%
2	126002	万科转2	5,558,474.58	0.45%

## 7、基金份额变动

2004年12月31日基金总份额：1,410,728,476.34份

本期申购总份额：2,885,527.31份

本期赎回总份额：183,951,429.19份

2005年3月31日基金总份额：1,229,662,574.46份

## 十、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

	2002年度	2003年度	2004年度	2004.12.31- 2005.3.31	自成立至 2005.3.31
基金份额净值增长率	-2.00%	17.47%	-0.05%	1.73%	17.06%
同期业绩比较基准收 益率	-13.74%	-2.31%	-13.84%	-5.34%	-31.27%
超额收益率	11.74%	19.78%	13.79%	7.07%	48.33%

注：本基金曾修改过业绩基准，表中各年度比较基准收益率以目前采用的比较基准计算

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。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

## 十一、基金财产

### （一）基金财产的构成

基金财产由下列项目构成：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其它投资及其估值调整；
- 9、其它财产。

### （二）基金财产的账户

本基金财产以“长盛成长价值证券投资基金”的名义开立基金专用银行存款账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册登记机构自有的财产账户以及其它基金财产账户相独立。

### （三）基金财产的保管与处分

1、本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

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

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

4、说明非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额资产净值，是计算基金申购与赎回的基础。

(二) 估值日

本基金成立后，每个工作日对基金资产进行估值。

(三) 估值对象

运用基金资产所购买的一切有价证券。

(四) 估值方法

- 1、任何上市流通的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌交易的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。
- 2、未上市的股票应区分两种情况处理：
  - (1) 送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；
  - (2) 首次公开发行的股票，按成本估值。
- 3、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价低于配股价，则估值增值额为零。
- 4、如有确凿证据表明按上述方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。即使存在上述情况，基金管理人若采用 1、2、3 款规定的方法对基金资产进行估值，仍应被认为采用了适当的估值方法。
- 5、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

(五) 估值程序

基金资产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加盖业务章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(六) 暂停公告净值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

(七) 基金份额资产净值错误的处理方式

基金份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后三位。当基金资产的估值导致基金份额资产净值小数点后三位以内发生差错时，视为基金份额资产估值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金份额资产净值出现错误时，基金管理人应当立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；净值错误偏差达到基金资产净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

因基金份额资产净值错误给投资者造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任，其具体赔偿方法应依照《长盛成长价值证券投资基金业务规则》及其附件的规定执行。

#### （八）特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第四种方法进行估值时，所造成的误差不作为基金份额资产净值错误处理；
- 2、由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或由于其它不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 十三、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、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 3、基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 4、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；
- 5、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个月则不进行收益分配；

- 6、基金收益分配后基金份额资产净值不能低于面值；
- 7、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份额净值自动转为基金份额再投资于本基金。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份额的默认分红方式为现金红利；
- 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。

## 十四、基金的费用与税收

### （一）与基金运营有关的费用

#### 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0.25%的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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(7)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。

## (二) 基金的申购费与赎回费

1、申购费率按照单笔申购金额递减，最高为不超过申购金额的1.5%，具体费率如下：

申购金额	申购费率
100 万以内	1.5%
满 100 万不满 500 万	1.2%
满 500 万不满 1000 万	0.6%
满 1000 万以上	0.2%

本基金申购费用由申购人承担，不列入基金资产。

2、本基金的赎回费率为赎回金额的0.5%。本基金的赎回费用由赎回人承担，赎回费的25%归入基金财产，余额为注册登记费和其他手续费。

3、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率和收费方式在更新的招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟将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) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十五、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3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、本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所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。

## 十六、基金的信息披露

### （一）信息披露的形式

本基金的信息披露严格按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同及其它有关规定进行。

本基金的信息披露事项将在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （二）信息披露的种类、披露时间和披露形式

#### 1、基金募集信息披露

##### （1）基金招募说明书、基金合同、托管协议

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制招募说明书，并在基金份额发售的三日前将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站

上；同时，基金管理人、基金托管人将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

(2) 基金份额发售公告

基金管理人就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

(3) 基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

(4) 更新的招募说明书

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、基金运作信息披露

基金运作信息披露包括年度报告、半年度报告、季度报告等定期报告和基金资产净值、基金份额资产净值公告等，由基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》等相关法律法规进行编制，在指定媒体予以公告，并报中国证监会备案。

(1) 年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，编制完成基金年度报告，并在指定媒体上进行披露。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

(2) 半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，编制完成基金半年度报告，并在指定媒体上进行披露。

(3) 季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，并在指定媒体上进行披露。

(4) 基金份额资产净值公告：

基金管理人应于每开放日的次日披露该开放日本基金的基金份额资产净值和基金份额累计净值。

3、基金临时信息披露

基金发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止基金合同；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- (7) 基金募集期延长;
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过50%;
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%;
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- (14) 重大关联交易事项;
- (15) 基金收益分配事项;
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- (17) 基金份额资产净值计价错误达基金份额资产净值0.5%;
- (18) 基金改聘会计师事务所;
- (19) 变更基金份额发售机构;
- (20) 基金更换注册登记机构;
- (21) 开放式基金开始办理申购、赎回;
- (22) 开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- (23) 开放式基金发生巨额赎回并延期支付;
- (24) 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- (25) 开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- (26) 中国证监会规定的其他事项。

4、当法律法规发生变化时,上述基金信息披露的规定将按届时合法有效的法律法规予以修改,在报中国证监会备案后由基金管理人依法进行公告。

### (三) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、招募说明书或更新的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告、基金份额资产净值公告等文本文件在编制完成后,通过基金管理人网站、指定信息披露报纸公布,投资人可通过上述渠道进行查阅,也可到基金管理人所在地在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件,基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 十七、风险揭示

本基金投资存在的风险主要有：

### （一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益率水平的不确定性，从而导致可能的损失。主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策等）发生变化，导致市场波动而产生的风险。

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，市场的平均收益水平也呈周期性波动，基金所投资证券的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率波动会导致证券市场价格和收益率的变动，从而直接影响证券价格；另一方面，利率变化也影响企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，收益水平亦会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业发展和竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。

5、购买力风险。基金投资收益的一部分通过现金的形式来分配，而现金收益可能因为通货膨胀的影响而使实际购买力水平发生变动，从而导致风险的产生。

### （二）主动型投资管理风险

1、主动型投资理念的风险。基于对中国目前证券市场弱有效性假设的否定，本基金确定了主动型投资的基本操作理念。但是，证券市场的有效性会随着时间的变化而变化，如果国内市场的有效性特征在短期内发生显著变化，则本基金的投资理念将面临较大的不适用性的风险。

2、动态资产配置的风险。本基金将基于对不同市场周期的预测和判断，动态调整股票、债券和现金之间的比例，在此基础上，对大盘成长、大盘价值、中盘成长、中盘价值、小盘成长、小盘价值六类风格资产进行适时转换。在此过程中，本基金尽管运用计量投资模型作为辅助的投资决策参考，但在很大程度上依赖于基金经理和基金管理小组的主观分析和判断。因此，基金经理对市场周期和资产配置的判断失误可能导致基金投资的风险。

3、证券选择的风险。本基金的证券选择很大程度上基于研究员和投资管理人员的研究分析和价值判断，尽管其研究结果基于其勤勉尽责的精神和专业素

质，但不能保证不发生判断失误；同时，国内上市公司公开报表存在着一定程度的信息失真，也可能导致研究结果与公司实际投资价值发生偏离，从而导致投资风险。

### （三）流动性风险

中国的证券市场作为一个典型的新兴市场，其市场整体的流动性风险较高，同时，在某些情况下基金投资组合持仓股票也会因为各种原因使流动性风险水平增加，从而使股票交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。尽管本基金管理人通过一系列措施加强对流动性风险的防范和控制，但不能保证完全避免此类风险。

同时，开放式基金在国内尚处于初期发展阶段，市场波动加大时，投资者申购或赎回的需求可能在短时间内突然增加，从而使流动性风险突然增加。

### （四）技术风险

当计算机、通讯、交易和信息网络等技术保障系统出现异常而导致基金的申购、赎回、分红无法按时完成，登记注册和核算系统出现异常而导致无法按时显示净值、净值估算发生错误而导致的风险。

### （五）其它风险

基金受其它不可抗力事件（如战争、自然灾害等）的影响，可能导致基金资产的损失；内幕交易及欺诈行为、金融危机、违约行为等基金管理人自身无法控制的风险，也将影响相关的风险水平。

## 十八、基金的终止与基金财产的清算

### （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，而无其它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，而无其它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它情况。

### （二）基金财产的清算

#### 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、具有从事证券法律业务资格的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、基金清算程序

- (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、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 5、基金清算的公告

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。

## 十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务；

### 1、基金份额持有人的权利、义务；

(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、赎回及其它对基金份额处分的权利，并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金份额；
- 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，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。

每份基金份额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。

## 2、基金管理人的权利、义务

### (1) 基金管理人的权利

- 1) 自基金合同生效之日起，根据《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 2) 依照《基金合同》获得基金管理费；
- 3) 销售基金份额并获得基金申购（认购）费用；
- 4) 作为基金注册登记机构办理基金注册与过户登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- 5) 依据《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》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 7) 选择、委托、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。如认为基金销售代理人违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 8) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- 9) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 10) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定本基金除托管费以外的其他相关费率结构和收费方式；

- 11) 依照《基金法》等法律法规，代表基金对被投资上市公司行使股东权利；
- 12) 法律、法规和《基金合同》规定的其它权利。

(2) 基金管理人的义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 3) 配备足够的专业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；
- 4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其它机构代理该项业务；
- 5) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其它机构代理该项业务；
- 6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立,保证不同基金在基金财产运作、财务管理等方面相互独立；
- 7) 除依据《基金法》等法律法规、《基金合同》及其它有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；
- 8) 接受基金托管人的依法监督；
- 9) 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额资产净值；
- 10) 严格按照《基金法》等法律法规、《基金合同》及其它有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 11) 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》等法律法规、《基金合同》及其它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；
- 12) 按《基金合同》规定向基金份额持有人分配基金收益；
- 13) 按照法律和《基金合同》的规定受理申购和赎回申请，支付赎回款项；
- 14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 15) 依据《基金法》等法律法规、《基金合同》及其它有关规定召集基金份额持有人大会；
- 16) 保存基金的会计账册、报表、记录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内发出，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，并得到有关资料的复印件；
- 18) 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、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；

20) 因过错导致基金财产的损失时，承担赔偿责任，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财产损失时，应为基金利益向基金托管人追偿；

22) 因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿；

23) 不得违反法律法规从事有损基金及其它基金当事人合法利益的活动；

24) 法律、法规和《基金合同》规定的其它义务。

### 3、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财产；

2) 依《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) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

5) 法律、法规和《基金合同》规定的其它权利。

#### (2) 基金托管人的义务

1) 遵守基金合同；

2) 依法持有基金财产；

3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产；

4) 设立专门的基金托管部，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，负责基金财产托管事宜；

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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对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；

6) 除依据《基金法》等法律法规、《基金合同》及其它有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；

7) 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；

8) 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，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金

名下的资金往来；

- 9) 保守基金商业秘密，除《基金法》等法律法规、《基金合同》及其它有关规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值或基金份额资产净值；
- 11) 采取适当、合理的措施，使开放式基金份额的认购、申购、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；
- 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) 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、中国银行业监管机构；
- 15) 在定期报告内出具托管人意见，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；
- 16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等15年以上；
- 17) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 18) 依据基金管理人的指令或有关规定将基金份额持有人的收益和赎回款项划往指定账户；
- 19) 参加基金财产清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银行业监管机构，并通知基金管理人；
- 21) 因过错导致基金财产的损失时，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- 22) 基金管理人因过错造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；
- 23) 不得违反法律法规从事任何有损本基金及本基金其它当事人合法利益的活动；
- 24) 法律、法规和《基金合同》规定的其它义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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“十二、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。”

### (三) 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，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。

### (四) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资者可免费查阅；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。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### (一) 基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：长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

法定代表人：凤良志

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

#### 2、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

### (二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的监督和核查

##### (1) 监督和核查内容

基金托管人就基金资产的投资组合的比例、投资范围、基金管理人的报酬计提比例和支付方法、基金资产核算、基金资产净值的计算、收益分配、基金的申购和赎回等是否符合《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定，对基金管理人进行监督和核查。

##### (2) 处理方式和程序

基金托管人发现基金管理人的违规行为，应以书面形式通知基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人再对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中

国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）。

基金管理人发生重大违规行为时，基金托管人应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。

## 2、基金管理人对于基金托管人的监督和核查

### （1）监督和核查内容

基金管理人根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，就基金托管人是否及时执行基金管理人的基金划款指令书、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

### （2）处理方式和程序

基金管理人发现基金托管人的违规行为，应以书面形式通知基金托管人限期纠正；基金托管人收到通知后进行核对确认并回函；在限期内，基金管理人再对通知事项进行复查，如基金托管人未予纠正，基金管理人将报告中国证监会。

基金托管人发生重大违规行为时，基金管理人应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## （三）基金财产的保管

### 1、基金财产保管的原则

基金托管人应安全、完整保管本基金的全部资产。基金财产与基金管理人和基金托管人的资产严格分开，并应对基金财产运作情况严格保密（中国证监会要求披露的除外）。

### 2、基金成立的验资

基金发行期结束后，基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，并由其出具验资报告。

### 3、基金资金账户的开设和管理

（1）基金的银行账户的开设和管理由基金托管人承担。基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金的基本账户，在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——深圳分公司开设备付金账户（用于证券交易的资金清算）。

（2）除基金合同中另有规定以外，双方均不得以基金名义在其他银行或非银行金融机构开立任何基金银行账户。

（3）基金银行账户的管理要符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

（4）本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切

货币收付活动，均需通过本基金的银行账户进行。

#### 4、基金证券账户的开设和管理

基金托管人以本基金的名义在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——深圳分公司开设一个证券账户。

#### 5、基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于存管银行的保管库；也可以存入中央国债登记结算公司或中国证券登记结算有限责任公司——上海分公司、深圳分公司的代保管库中。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 6、与基金财产有关的重大合同的保管

基金管理人代表基金签署与基金财产有关的重大合同，在签署前应通知基金托管人。与基金财产有关的重大合同全部由基金托管人保管。

### (四)基金资产净值计算与复核

#### 1、基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### (1) 基金资产净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

每份基金份额资产净值等于计算日基金资产净值除以计算日基金份额总额后的价值。

基金资产净值每日计算，每个开放日的次日公告开放日基金份额资产净值。

##### (2) 复核程序

基金管理人每日对基金资产进行估值后，将估值结果（估值表）通过加密传真传送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行逐项复核；经基金托管人复核无误后，签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

因基金资产净值计算错误造成损失，由基金管理人和基金托管人共同承担责任；各自承担责任的具体比例根据有关法律法规、行业规则和权责一致的原则确定。

##### (3) 基金账册的建立和基金账册的定期核对

1) 账册的建立：基金管理人和基金托管人应指定经办本基金财务的会计人员负责编制、保管基金的会计账册；双方管理或托管的不同基金的会计账册，应完全分开，单独编制和保管。

2) 凭证保管及核对：证券交易凭证由基金管理人与基金托管人分别保管并据此建账。

基金托管人办理基金的资金收付、证券实物出入库所获得的凭证由基金托管人保管原件并记账，每月编制业务明细表并附指令回执和单据复印件交基金管理人记账。

(4) 基金财务报表的编制、复核的时间和程序

1) 财务报表的编制：基金财务报表，包括资产负债表、收益及收益分配表、基金净值变动表、证券投资明细表、基金估值表以及主管部门规定的其他报表，由基金管理人和基金托管人按月分别编制。

2) 报表复核：基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。核对无误后，在核对过的基金财务报表上加盖基金托管人和基金管理人印章，各留存一份。

3) 基金财务报表的编制与复核时间安排：月度报表每月终了后 5 日内完成；年中报表为基金会计年度半年终了后 30 日内完成；年度报表为基金会计年度结束后 45 日内完成。

(六) 争议解决方式

因本托管协议引起的或者与本托管协议有关的一切争议应由本托管协议双方当事人通过协商予以解决。协商自一方当事人向对方发出书面协商函件之日开始。如果协商开始后三十日内双方仍不能解决该争议，则任何一方当事人均有权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，本托管协议的其它条款仍继续全面有效，双方当事人仍应遵守、履行。

(七) 托管协议的修改与终止

1、对本托管协议的任何修改或补充，须经本协议双方当事人一致书面同意，修改后的托管协议报中国证监会批准后生效，并通过适当方式通知基金份额持有人。

2、发生以下情形，托管协议将终止：

- 1) 基金合同终止；
- 2) 基金托管人解散、撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3) 基金管理人解散、撤销、破产或由其他基金管理人接管其基金管理权；
- 4) 发生《基金法》及其他法律法规规定的基金终止之事项。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务项目，基金管理人根据持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，有权增加和修改服务项目：

### （一）通知服务

通知基金份额持有人的内容包括邮寄季度对账单等服务。季度对账单每季度提供，在每季度结束后的 10 个工作日内向投资者以书面形式寄出，投资者也可以选择不获取邮寄对账单服务。

### （二）查询

查询服务为投资者提供基金账户查询、基金状况查询，内容包括：申购与赎回的交易情况；基金账户余额；基金产品与服务及其它相关信息。

其实现方式为：自动电话查询、网上查询等。

客户服务中心电话：010-84510088

公司网站：<http://www.csfunds.com.cn>

### （三）咨询

咨询服务包括基本业务咨询、常见问题咨询。

咨询方式为：客户服务员人工咨询；客户经理专业咨询及基金经理会谈等。

客户服务中心电话：010-84510088 转人工座席。

### （四）投诉及处理

投诉方式分为人工热线投诉与网上投诉两部分，客户服务员将分别汇总投诉内容并予以及时处理；同时，充分做好与投资者的沟通工作，提高客户服务质量。

### （五）需求汇总及反馈

客户需求可通过人工热线电话或网上与客户服务中心进行沟通，我们也将及时汇总客户需求并与其它部门进行协调，并及时总结与反馈。

### （六）红利再投资服务

本基金收益分配时，基金份额持有人可选择将所得红利再投资于本基金，注册登记机构自动将其所获红利按分红除息日的基金份额资产净值转为基金份额，红利再投资不收取费用。

## 二十二、其他应披露事项

- 1、本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。
- 2、最近3 年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚。
- 3、2005年1月22日基金管理人发布本基金2004年第4季度报告（2004年第4号）。
- 4、2005年3月31日基金管理人发布本基金2004年年度报告

- 5、2005年4月2日基金管理人发布本基金2004年年度报告的补充公告。
- 6、2005年4月21日基金管理人发布本基金2005年第1季度报告（2005年第1号）。

### 二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人 and 登记注册人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

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。

### 二十四、备查文件

- （一） 中国证监会批准长盛成长价值证券投资基金设立的文件
- （二） 法律意见书
- （三） 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （四） 基金托管人业务资格批件和营业执照
- （五） 《长盛成长价值证券投资基金基金合同》
- （六） 《长盛成长价值证券投资基金业务规则》
- （七） 《长盛成长价值证券投资基金托管协议》
- （八） 《长盛成长价值证券投资基金代理销售协议》
- （九） 中国证监会规定的其它文件

长盛基金管理有限公司  
二零零五年五月二十日