

长盛货币市场基金 招募说明书（更新）

重要提示

本基金于2005年10月25日经中国证监会证监基金字[2005]176号文批准募集。

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。

本基金的基金合同已根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《货币市场基金管理暂行规定》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2007年6月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2007年3月31日（财务数据未经审计）。

目 录

一、绪言.....	2
二、释义.....	2
三、基金管理人.....	5
四、基金托管人.....	13
五、相关服务机构.....	16
六、基金的募集.....	22
七、基金合同的生效.....	22
八、基金份额的申购与赎回.....	23
九、基金的非交易过户、转托管、基金转换、冻结与解冻.....	28
十、基金的投资.....	29
十一、基金业绩.....	37
十二、基金的财产.....	38
十三、基金资产的估值.....	39
十四、基金的收益与分配.....	43
十五、基金的费用与税收.....	45
十六、基金的会计与审计.....	47
十七、基金的信息披露.....	48
十八、风险揭示.....	51
十九、基金的终止与基金财产的清算.....	53
二十、基金合同的内容摘要.....	54
二十一、基金托管协议的内容摘要.....	67
二十二、对基金份额持有人的服务.....	74
二十三、其他应披露事项.....	77
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....	78
二十五、备查文件.....	78

一、绪言

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《暂行规定》等有关法规以及《长盛货币市场基金基金合同》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：

基金或本基金：	指依据《基金合同》所设立的长盛货币市场基金
基金合同：	指《长盛货币市场基金基金合同》及对该合同的任何修订和补充
招募说明书：	指《长盛货币市场基金招募说明书》及根据法律法规定期所作的更新
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛货币市场基金基金托管协议》
份额发售公告：	指《长盛货币市场基金份额发售公告》
《证券法》：	指 2005 年 10 月 27 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议修订，并于 2006 年 1

	月 1 日正式实施的《中华人民共和国证券法》
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《运作办法》：	指《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》：	指《证券投资基金信息披露管理办法》
《暂行规定》：	指《货币市场基金管理暂行规定》
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会
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
基金管理人：	指长盛基金管理有限公司
基金托管人：	指兴业银行股份有限公司
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
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
《基金合同》生效日：	指本基金依《基金合同》规定的条件募集，达到《基金合同》生效条件，并由基金管理人依照《基金法》的规定向中国证监会办理基金备案手续，并获得中国证监会书面确认之日
《基金合同》终止日：	指《基金合同》规定的终止事由出现后按照《基金合同》规定的程序并经中国证监会批准终止《基金合同》的日期

募集期：	指自基金份额开始发售之日起计算，最长不超过3个月的期限。基金募集期的具体起止日期将在本基金的发售公告中列明
存续期：	指《基金合同》生效日至《基金合同》终止日之间的不定期期限
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
开放日：	指为基金投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
T日：	指日常申购、赎回或其它交易的申请日
T+n日：	指自T日起第n个工作日
元：	指人民币元
认购：	指在基金募集期内，基金投资者购买本基金基金份额的行为
申购：	指在本基金合同生效后，投资人申请购买本基金份额的行为
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为
销售服务费用：	指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用。本基金对基金份额计提销售服务费，该笔费用从基金资产中扣除，属于基金的营运费用
摊余成本法：	指估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益
每万份基金份额净收益：	指每万份基金份额的日收益或者每万份基金份额净收益累计值
基金七日收益率：	指以最近七日（含节假日）收益所折算的年收益率
基金收益：	指基金投资所得债券利息、买卖证券差价、银行

	存款利息以及其它收益
基金资产总值：	指基金所购买各类证券价值、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单位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

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 1211 室

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

法定代表人：凤良志

电话：(010) 82255818

传真：(010) 82255988

联系人：叶金松

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。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券有限责任公司占注册资本的 41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的 33%；安徽省创新投资有限公司占注册资本的 13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的 13%。截至 2007 年 3 月 31 日，基金管理人共管理三只封闭式基金、六只开放式基金和四只社保基金委托资产，公募基金管理资产规模约

284.94 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，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。

杜长棣先生，董事，学士。历任安徽省第一轻工业厅研究室副主任、安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长、安徽省巢湖市市委常委、常务副市长、安徽省发改委副主任，现任安徽省投资集团有限责任公司党委书记、总经理。

蔡咏先生，董事，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总裁。

叶斌先生，董事，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，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、国元证券有限责任公司副总裁。

钱进先生（340104650425209），董事，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。

徐经长先生，独立董事，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，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，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，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、花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁，现任香港国际资本管理有限公司董事长。

2、基金管理人监事会成员

钱正先生，监事，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，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。

肖强先生，监事，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、投资管理部副总监，现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（原基金同智）基金经理。

3、管理层成员

陈礼华先生：硕士，高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员，华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理，南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监，长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

周兵先生：硕士，经济师，历任中国银行总行综合计划部副主任科员，香港南洋商业银行内地融资部副经理，香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理，广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理（期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人），北京朝阳门大街证券营业部总经理等职。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

宋炳山先生：清华大学工学硕士。历任国家科技部基础研究高技术司主任科员；博时基金管理有限公司研究部研究员，裕隆基金经理助理，基金裕阳基金经理，基金裕华基金经理，交易部总经理；富国基金管理有限公司投资副总监兼基金汉兴基金经理；东方基金管理有限责任公司分管投资副总经理兼东方龙基金经理；2006年3月起，加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生：大学，会计师，历任美菱股份有限公司财会部经理，安徽省信托投资公司财会部副经理，国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理等职，现任长盛基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

王茜女士：工商管理硕士。曾先后就职于武汉市商业银行，任信贷管理部交易员、副经理、总经理助理和中信证券固定收益部。2002年9月至今，就职于长盛基金管理公司，先后协助管理封闭式基金债券组合、开放式基金债券组合和全国社保基金债券资产组合。自2005年12月12日起至今任本基金基金经理，自2003年10月25日起至今兼任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理。

刘静女士：经济学学士。2000年7月至2003年6月就职于北京证券有限责任公司，2003年7月加入长盛基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、首席债券交易员，负责公司旗下基金和组合的债券资产的交易管理，自2006年11

月 29 日起至今任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

陈礼华先生：硕士，高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员，华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理，南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监，长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

叶金松先生，大学，会计师。历任美菱股份有限公司财会部经理，安徽省信托投资公司财会部副经理，国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理等职，现任长盛基金管理有限公司督察长。

宋炳山先生：清华大学工学硕士。历任国家科技部基础研究高技术司主任科员；博时基金管理有限公司研究部研究员，裕隆基金经理助理，基金裕阳基金经理，基金裕华基金经理，交易部总经理；富国基金管理有限公司投资副总监兼基金汉兴基金经理；东方基金管理有限责任公司分管投资副经理兼东方龙基金经理；2006 年 3 月起，加入长盛基金管理有限公司。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

李骥先生：博士，历任中体改研究会研究秘书，嘉实基金管理公司分析师、副总监。现任长盛基金管理公司研究发展部副总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金日收益、基金七日收益率；

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、内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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

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

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

（4）相互制约原则。公司及各部门在内部组织结构和岗位的设置上要权责分明、相互制衡。

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

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

2、完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”（董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部）内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况，组织指导公司监察稽核工作，对基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法进行监察稽核；公司风险控制委员会定期对基金资产运作的风险进行评估，对存在的风险隐患或发现的风险问题进行研究；监察稽核部负责日常的风险监控工作，对公司各部门业务流程的风险控制工作进行监察稽核，并通过全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度，从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面及时和全面揭示风险控制要素，明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法，使得对各风险点的监控真正落到实处。

3、内部控制制度的内容

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

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

（2）公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、投资管理制、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财

务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

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

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。

4、内部控制实施

（1）建立了详细、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；

（2）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。

（3）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。

5、基金管理人关于内部控制的声明

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

四、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

注册日期：1988 年 7 月 20 日

注册资本：50 亿元人民币

托管部门联系人：赵建明

电话：(021) 62159219

传真：(021) 62159217

2、发展概况及财务状况

兴业银行股份有限公司成立于1988年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于福建省福州市，注册资本50亿元。

自开业以来，兴业银行始终坚持与客户“同发展、共成长”和“服务源自真诚”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2006 年末，兴业银行资产总额为 6177.04 亿元，股东权益为 162 亿元，2006 年实现净利润 37.98 亿元。根据英国《银行家》杂志于 2006 年 6 月首次发布的中国银行 100 强排行，兴业银行平均资本利润率列各家全国性银行首位，一级资本和资产总额均列全国第十位；在该杂志同年 7 月公布的全球银行 1000 强的最新排名中，本行按总资产排名列第 164 位，较上年提升 46 位，首次跻身全球 200 强行列；按一级资本排名列第 297 位，较上年提升 28 位。

3、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处等处室，共有员工28人，平均年龄30岁，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格，基金托管业

务批准文号：证监基金字[2005]74号。截至2006年12月31日，兴业银行已托管开放式基金六只——兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金，托管基金财产规模66.04亿元。

（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

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，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。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（2）独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

（5）防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

4、内部控制制度及措施

（1）制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

（2）建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

（3）风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

（4）相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

（5）人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

（6）应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

（三）基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金的申购与赎回、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

基金托管人每日按时通过托管业务系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况，严密监视，及时提醒基金管理人；发现违规行为，与基金管理人进行情况核实，并向基金管理人发出书面通知，督促其纠正，同时报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时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应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金

托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）长盛基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

电话：(010) 82255818 转 263、288

传真：(010) 82255981、82255982

联系人：银晓莉

客户服务电话：(010) 62350088、4008882666

（2）长盛基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 15 楼 F 座

电话：(021) 68869285、(021) 68869286

传真：(021) 68869287

联系人：冯岩

2、代销机构

（1）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：(021) 62677777

联系人：苏健

客户服务电话：95561

（2）中国农业银行

住所：北京海淀区复兴路甲 23 号

办公地址：北京海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人：杨明生

电话：(010) 68298560、68297268

传真：(010) 68297268

联系人：蒋浩

（3）国元证券有限责任公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

开放式基金业务传真：(0551) 2634400-3612

联系人：李蔡

（4）中信证券股份有限公司

住所：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：(010) 84864818 转 63266

传真：(010) 84865560

联系人：陈忠

（5）广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87557985

联系人：肖中梅

（6）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：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

电话：(010) 66568047

传真：(010) 66568536

联系人：李洋

（7）国泰君安证券股份有限公司

住所：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：祝幼一

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

联系人：芮敏祺

（8）广发华福证券有限责任公司

住所：福州市新天地大厦 8 层

办公地址：福州市新天地大厦 8 层

法定代表人：王比

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

联系人：张腾

（9）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943237

联系人：黄健

（10）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 18 层

法定代表人：兰荣

电话：(021) 68419974

传真：(021) 68419867

联系人：杨盛芳

（11）恒泰证券有限责任公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号

办公地址：上海松林路 357 号通贸大厦 20 楼

法定代表人：李庆阳

电话：(021) 68405392

客户服务电话：(021) 68405392

传真：(021) 68405181

联系人：吴夕芳

（12）德邦证券有限责任公司

住所：沈阳市沈河区小西路 49 号

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：王军

电话：(021) 68761616

传真：(021) 68767880

联系人：罗芳

（13）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 53594566 - 4125

传真：(021) 53858549

联系人：金芸

（14）中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

联系人：权唐

（15）光大证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 14 楼

法定代表人：王明权

电话：(021) 68816000

客户服务咨询电话：(021) 68823685

传真：(021) 68815009

联系人：刘晨

（16）长江证券有限责任公司

住所：武汉市新华下路特 8 号

办公地址：武汉市新华下路特 8 号

法定代表人：明云成

电话：(027) 65799560

传真：(027) 85481532

联系人：毕艇

（17）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：谢平

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54035333

联系人：王序微

（18）联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼

办公地址：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼

法定代表人：王政

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492062

联系人：范雪玲

客户服务电话：400-8888-555，（0755）25125666

（19）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：（0755）83195834，82090060

传真：（0755）83195049，82090817

联系人：朱虹、刘薇

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（二）注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 1211 室

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：（010）82255818

传真：（010）82255988

联系人：戴君棉

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：北京市广盛律师事务所

住所：北京市建国路 99 号中服大厦 25 层

办公地址：北京市建国路 99 号中服大厦 25 层

法定代表人：夏善胜

电话：(010) 65813529

传真：(010) 65816534

经办律师：吴军

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：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：薛竞、陈宇

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》、《暂行规定》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2005年10月25日证监基金字[2005]167号文批准募集。募集期为2005年11月16日到2005年12月6日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，募集期共募集 3,601,835,236.63份基金份额，有效认购户数12,676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2005年12月12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，其有效持有人数量连续20个工作日达不到100人，或者连续20个工作日最低基金资产净额低于5000万元的，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。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：2005年12月19日

赎回开始日：2005年12月19日

2、开放时间：

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。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期和时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。

（三）申购与赎回的限制

1、申购的数额限制

（1）投资人每笔申购申请不得低于1,000元。

（2）投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规、中国证监会、本招募说明书另有规定的除外。

（3）根据市场情况，基金管理人可以调整申购基金份额的最低金额限制，基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

2、赎回数额的限制

本基金无赎回最低份额限制。

3、在销售机构保留的基金份额最低数量限制

本基金无基金份额最低持有余额限制。

根据市场情况，基金管理人可以调整在销售机构保留的基金份额的最低份额数量限制，基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

（四）申购与赎回的原则

1、本基金采用“确定价”原则，即申购、赎回基金的份额价格以1.00元人民币为基准进行计算；

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、投资者在全部赎回本基金份额时，基金管理人自动将投资者账户内待结转的基金收益全部结转并与赎回款一起支付给投资者；投资者部分赎回，且赎回后可用余额足以弥补负的待结转收益的，不进行待结转收益的结转。投资者部分赎回，且赎回后可用余额不足以弥补负的待结转收益的，进行待结转收益的结转；

4、当日的申购、赎回申请可以在当日交易时间结束以前撤销，在当日的交易时间结束以后不得撤销；

5、本基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则。本基金管理人必须于新规则开始实施之日的3个工作日之前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

（五）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，在开放时间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份额余额，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日晚对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2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。

投资者T日的赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定将赎回款项于T+1日从基金托管账户划出，基金管理人通过各销售机构划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同及招募说明书有关规定处理。

（六）申购与赎回份额的计算方式

1、本基金申购份额的计算：

申购份额 = 申购金额 / 每基金份额申购价格

2、本基金赎回金额的计算：

赎回金额 = 赎回份额 × 每基金份额赎回价格

3、本基金申购和赎回的价格为每基金份额1.00元，且不收取申购和赎回费用。

（七）拒绝或暂停申购与赎回的情况

1、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人不能接受申购；

（2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）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；

（4）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

（5）法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

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、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- (2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 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；
- (4) 基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金赎回申请的；
- (5) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(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下一个开放日办理，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。

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

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。

(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每万份基金净收益和七日年化收益率。

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每万份基金净收益和七日年化收益率。

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每万份基金净收益和七日年化收益率。

九、基金的非交易过户、转托管、基金转换、冻结与解冻

（一）非交易过户

非交易过户是指由于司法强制执行、继承、捐赠等原因，基金登记注册人将某一基金账户的基金份额全部或部分直接划转至另一账户。

1、继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人或受遗赠人继承。

2、捐赠仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

3、司法强制执行是指司法机构依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户时，必须按基金登记注册人的要求提供相关资料，到基金登记注册人的柜台办理。

投资者办理非交易过户应按基金登记注册人规定的标准缴纳过户费用。

（二）转托管

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购(认购)基金份额，但必须在原申购(认购)的销售机构赎回该部分基金份额。

投资者申购(认购)基金份额后可以向原申购(认购)基金的销售机构发出转托管指令，缴纳转托管手续费，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

转托管在转出方进行申报，基金份额转托管经一次申报便可完成。投资者于T日转托管基金份额成功后，投资者可于T+2日起赎回该部分基金份额。

投资者在转出方办理转托管手续之前，应先到转入方办理基金账户注册确认手续。投资者办理转托管应按基金登记注册人和销售机构规定的标准缴纳转托管费用。

（三）基金转换

本基金份额持有人可以按规定申请将所持有的基金份额与管理人所管理的其它基金份额相互转换。具体规定请参见本基金管理人公告。

（四）冻结与解冻

基金登记注册人只受理司法机构依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份

额的冻结手续、冻结方式按照基金登记注册人的相关规定办理。

十、基金的投资

（一）投资目标

在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的收益。

（二）投资范围

本基金将投资于以下金融工具：

- 1、现金；
- 2、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
- 3、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；
- 4、期限在一年以内（含一年）的债券回购；
- 5、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
- 6、剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的资产支持证券；
- 7、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

（三）投资理念

- 1、确保基金投资的低风险特点，力争为投资者保证本金安全

本基金在投资中将严格按照合同规定将投资范围限定在短期债券投资品种上，以持有到期作为主要基金增值手段，将力争规避市场价格波动的风险；同时通过滚动期限资产配置策略，控制平均到期期限，实现利率风险最小化的目标；在投资品种选择上，严格控制在高信用等级品种上，力争将信用风险控制最低水平。

- 2、保持基金资产的高流动性

本基金由于定位于一种现金管理工具，将切实保证本基金资产在任何时点上资产都具有较高流动性。在资产管理中，将采用动态期限结构管理的技术，实现基金资产流动性在时间上的均衡，实现流动性与收益性的最优化配置。

- 3、在控制风险的前提下，为投资人实现收益最大化

为了给投资人带来最大化收益，实现基金资产的保值增值，本基金在资产管

理中将采用现代金融工程技术与数量化分析方法，通过实时计算机化分析系统，一方面实现资产的动态最优化配置，另一方面及时准确把握市场机会，实现无风险套利。

（四）投资策略

1、投资决策依据

（1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。

（2）宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；

（3）策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

2、投资决策程序

（1）投资组合计划的拟定

基金管理小组每月月末拟定下月资产配置计划，报投资决策委员会审批。投资组合计划制定的依据未来宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化的研究与分析，以及据此作出的对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率的积极判断，在此基础上基金管理小组制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，并报投资决策委员会审批。投资组合计划是未来一段时间投资的基础与纲领。

如果基金管理小组认为影响各期限、品种收益率的因素产生了重大变化，还可以临时提出新的投资计划，并由投资决策委员会审批。

（2）投资计划的实施

基金管理小组在投资委员会通过的投资组合计划规定限制下，根据市场的实际情况，按照投资策略实施步骤，采用积极投资策略，通过动态调整优化投资组合，追求当期收益最大化。在动态调整的过程中，基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征，实现收益与风险的平衡。

在组合调整过程中，基金管理小组将根据未来可预测资金流动状况，合理管理组合现金头寸，保证组合流动性。

（3）交易执行

交易部负责执行基金管理小组下达的交易指令，同时履行一线监控的职能。

在交易指令执行前，交易部对交易指令进行复核，确保交易指令执行后基金各项投资比例符合法律法规以及基金合同、招募说明书的各项规定。

（4）组合监控与调整

基金经理与公司的风险管理人员将密切关注宏观经济和市场变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量情况，每日对组合的风险和流动性进行监控，确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平，确保组合的流动性能够满足投资者的赎回要求。当组合中货币市场工具价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时，或当组合中货币市场工具信用评级调整导致信用等级不符合要求时，基金管理小组应采取有效的措施，在合理的时间内调整组合。

3、投资管理的方法

本基金在投资组合管理中采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。本基金的核心投资策略由四部分组成：短期市场利率预期策略、期限结构的滚动配置策略、投资组合优化策略、无风险套利操作策略。

（1）短期市场利率预期策略

短期利率预期策略是指基金管理人根据对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化作出研究与分析，对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率进行积极的判断，并以此为依据制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，期限结构与品种配置计划是未来一段投资的基础。

（2）期限结构的滚动配置策略

为了保证组合资产高流动性，组合资产在到期期限配置上采用滚动配置的策略，即在一个相对固定的投资周期中，将各期限品种的投资均衡分布在不同时间上，从而保证在投资周期内的任何时刻都有稳定的到期现金流，最大限度地提高到期期限约束条件下的流动性。

（3）投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下，在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益

最大化，约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约束等。

（4）无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同，市场中常常存在无风险套利机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高，无风险套利的机会与收益会不断减少，但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会，基金管理人将贯彻谨慎的原则，充分把握市场无风险套利机会，为投资人带来更大收益。

同时，随着市场的发展、新的货币投资工具的推出，会产生新的无风险套利机会，本基金将加强对市场前沿的研究，及时发现市场中新的无风险套利机会，扩大基金投资收益。

为了保证上述投资策略的顺利实施，基金管理人根据货币市场基金的特点，开发了货币资产组合优化管理系统，以提高投资决策的科学化与实时化。

4、投资品种的选择标准

在上述组合管理的基础上，基金管理小组也将充分重视根据市场形势灵活把握投资品种的主动选择，具有下列一项或多项特征的投资品种是本基金重点投资的对象：

- （1）在相似到期期限和信用等级下，收益率较高的债券、票据或债券回购；
- （2）相似条件下，流动性较高的债券、票据；
- （3）相似条件下，交易对手信用等级较高的债券、票据或债券回购。

（五）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率（税后）。

（六）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

（七）建仓期

本基金管理人自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

（八）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。为了实现投资目标，贯彻投资理念，本基金投资组合遵循下列规定：

1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票
- (2) 可转换债券
- (3) 剩余期限超过三百九十七天的债券
- (4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券
- (5) 以定期存款为基准利率的浮动利率债券
- (6) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、投资组合遵循如下投资限制

(1) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的百分之十；

(2) 存放在具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的百分之三十；存放在不具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的百分之五；

(3) 除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应在 5 个工作日内进行调整。

(4) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 180 天。

(5) 持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。

(6) 通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天。

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

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

(9) 本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

(10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

(11) 因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之

内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。

（12）法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。

3、投资组合平均剩余期限计算方法

平均剩余期限的计算公式

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{期限} + \text{债券正回购} \times \text{期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产（含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金）、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、期限在一年以内（含一年）的逆回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内（含一年）的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

（九）禁止行为

本基金禁止以下投资行为：

- 1、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券或进行证券回购；
- 2、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 3、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 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、从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 7、投资于与基金托管人或基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
- 8、与管理人的股东进行交易，通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数；
- 9、法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

（十）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。

本基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 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。

本报告所载数据内容截止日为 2007 年 3 月 31 日，相关财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额（人民币元）	占基金总资产的比例
债券投资	427,039,747.52	93.64%
买入返售证券	0.00	0.00%
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	23,058,359.64	5.06%
其中：定期存款	0.00	0.00%
其他资产	5,945,477.75	1.30%
合计	456,043,584.91	100.00%

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	4,847,192,000.00	14.19%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	30,000,000.00	7.05%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%

注：（1）上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

（2）本报告期内货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值 20%的情况

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例	原因	调整期（日）
1	2007-1-1	23.11%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
2	2007-1-2	23.10%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
3	2007-1-3	23.10%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
4	2007-1-4	23.97%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
5	2007-1-5	24.25%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
6	2007-1-6	24.25%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
7	2007-1-7	24.25%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
8	2007-1-8	24.26%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
9	2007-1-24	20.27%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 30 日调整完毕

10	2007-1-25	20.41%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 30 日调整完毕
11	2007-1-26	20.42%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 30 日调整完毕
12	2007-1-27	20.42%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 30 日调整完毕
13	2007-1-28	20.42%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 30 日调整完毕
14	2007-1-29	20.28%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 30 日调整完毕
15	2007-2-7	20.89%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 2 月 13 日调整完毕
16	2007-2-8	21.35%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 2 月 13 日调整完毕
17	2007-2-9	21.21%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 2 月 13 日调整完毕
18	2007-2-10	21.21%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 2 月 13 日调整完毕
19	2007-2-11	21.21%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 2 月 13 日调整完毕
20	2007-2-12	21.04%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 2 月 13 日调整完毕

3、基金投资组合平均剩余期限

(1) 投资组合平均剩余期限基本情况

项 目	天 数
报告期末投资组合平均剩余期限	129
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	163
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

报告期内无投资组合平均剩余期限超过 180 天情况。

(2) 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例	各期限负债占基金资产净值的比例
1	30 天内	5.42%	7.05%
2	30 天(含) - 60 天	23.42%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	7.02%	0.00%
3	60 天(含) - 90 天	14.04%	0.00%
4	90 天(含) - 180 天	42.02%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.34%	0.00%
5	180 天(含) - 397 天(含)	20.86%	0.00%
	合计	105.76%	7.05%

4、报告期末债券投资组合

(1) 债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(人民币元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	189,757,288.73	44.58%
	其中：政策性金融债	150,024,554.36	35.25%
3	央行票据	158,128,193.17	37.15%
4	企业债券	79,154,265.62	18.60%
5	其他	0.00	0.00%

合计	427,039,747.52	100.33%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	69,593,969.26	16.35%

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

（2）基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量		成本(人民币元)	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	06 国开 27	700,000	0.00	69,808,291.33	16.40%
2	06 央行票据 35	600,000	0.00	59,741,530.42	14.04%
3	04 国开 15	500,000	0.00	50,355,028.14	11.83%
4	06 美丰 CP01	400,000	0.00	39,992,374.35	9.40%
5	05 工行 03	400,000	0.00	39,732,734.37	9.34%
6	06 天士力 CP01	400,000	0.00	39,161,891.27	9.20%
7	06 国开 08	300,000	0.00	29,861,234.89	7.02%
8	06 央票 46	300,000	0.00	29,783,216.68	7.00%
9	07 央行票据 22	300,000	0.00	29,194,872.50	6.86%
10	06 央行票据 53	200,000	0.00	19,829,599.17	4.66%

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

5、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1160%
报告期内偏离度的最低值	-0.0503%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0545%

6、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明：本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

（2）本报告期内，本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过日基金资产净值 20%的情况。

序号	日期	比例	原因	调整期
1	2007-1-10	20.06%	基金规模波动导致超标	到 2007 年 1 月 11 日调整完毕
2	2007-3-19	20.72%	基金规模波动导致超标	到 2007 年 3 月 20 日调整完毕

（3）本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

（4）报告期末其他资产构成

序号	其他资产	金额（人民币元）
1	应收利息	1,862,841.86
2	应收申购款	4,082,635.89
	合 计	5,945,477.75

(5) 报告期末基金持有的资产支持证券明细

本基金期末未持有资产支持证券。

十一、基金业绩

	2005.12.12- 2005.12.31	2006.1.1- 2006.12.31	2007.1.1- 2007.3.31	自成立至 2007.3.31
基金份额净值增长率	0.1058%	1.9641%	0.5715%	2.6553%
同期业绩比较基准收 益率	0.0986%	1.8799%	0.5048%	2.4833%
超额收益率	0.0072%	0.0842%	0.0667%	0.1720%

十二、基金的财产

（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）基金财产的账户

本基金财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财产账户严格分开、相互独立。

（四）基金财产的保管和处分

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、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、基金管理人、基金托管人、基金销售代理人、注册登记机构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。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、除法律法规、《基金合同》的规定处分外，非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十三、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映资产的价值。

（二）估值日

基金合同生效后，基金资产估值日为相关的证券交易所的正常交易日。

（三）估值对象

本基金依法持有的银行存款、各类有价证券等。

（四）估值方法

本基金按以下方法进行估值：

1、本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

本基金目前投资工具的估值方法如下：

（1）基金持有的短期债券采用折溢价摊销后的成本列示，按票面利率计提应收利息；

（2）基金持有的贴现债券采用购入成本和内含利息列示，按购入移动成本和到期兑付之间的收益，在剩余期限内每日计提应收利息；

（3）买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，

若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值。

2、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生不利影响，基金管理人应于每一估值日，采用市场利率和交易价格，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的0.5%时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人在与基金托管人商定后，经批准根据实际情况按最能反映公允价值的方法估值。

4、如有新增事项，按有关国家法律法规规定估值。

（五）估值程序

基金的日常估值由基金管理人和基金托管人共同进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照《基金合同》规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后加盖业务公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）估值错误的确认与处理

基金资产估值、每万份基金净收益或基金7日年化收益率计算出现错误时，基金管理人和基金托管人应当予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。基金资产估值错误偏差达到或超过基金资产净值的0.5%时，基金管理人应编制并披露临时报告，并报中国证监会备案。

基金日每万份基金净收益保留小数点后四位，第五位采用去尾的方式。基金7日年化收益率以四舍五入的方式保留至小数点后三位。国家另有规定的服从其规定。当基金资产的估值导致基金日收益小数点后四位或基金七日收益率小数点

后三位以内发生差错时，视为估值错误。

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代理销售机构或投资者自身的过错造成差错，导致其它当事人遭受损失的，过错的相关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”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无法预见、无法避免、无法抗拒，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它差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其它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，由此造成或扩大的损失，由差错责任方和未更正方根据各自的过错程度分别各自承担相应的赔偿责任。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）因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权根据过错原则，向过错人追偿。

（3）如基金管理人和基金托管人对基金资产净值的计算结果不能达成一致时，为避免不能按时公布的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，基金管理人应在对外公告基金财产净值计算结果时注明基金托管人复核情况，而基金托管人有权将有关情况向中国证监会报告，由此给基金投资者和基金造成的损失，由责任方赔偿；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，不对任何第三方负责。

（4）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它当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（5）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。

（6）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错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，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和基金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，由基金管理人和基金托管人共同负责向差错方追偿。

（7）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出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（8）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规或其他规定，基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金托管人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（9）由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误以及不可抗力因素，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误的，基金管理人和基金托管人可以免于承担赔偿责任。基金管理人和基金托管人应当积极采取一切必要的措施消除由此造成的影响。

（10）按法律法规规定的其它原则处理差错。

（六）暂停估值的情形及处理

1、与本基金投资有关的证券交易场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；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金投资者的利益，已决定延迟估值并征得基金托管人同意的；
- 4、出现基金管理人认为属于紧急事件的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产，经基金托管人同意的；
- 5、中国证监会认定的其他情形。

（七）特殊情形的处理

1、基金按本条第 4 款第 2、3 项规定进行估值时，所造成的差异不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易市场及登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力原因，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资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免于承担赔偿责任。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。

十四、基金的收益与分配

（一）基金收益的构成

基金收益包括基金投资所得债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

（二）基金收益分配原则

1、本基金的基金份额采用人民币 1.00 元的固定份额净值交易方式，每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按月结转到投资人基金账户，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元；基金投资当期亏损时，相应调减基金份额持有人持有份额，基金份额净值始终为 1.00 元。

2、本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资

者每日计算当日收益并分配到投资者收益账户。每月累计收益采用红利再投资（即红利转基金份额）方式结转为基金份额，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将缩减投资者基金份额。若投资者赎回时，收益为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除。

3、基金收益分配采用复利分配的方式，即投资者当日分配的收益，在下一工作日享受收益分配。每月集中结转当前累计收益，本基金收益结转时截尾的方式保留小数点后两位，剩余部分保留在投资者收益账户。

4、每一基金份额享有同等分配权。

5、当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。

在符合相关法律、法规及规范性文件的规定，并且不影响投资者利益情况下，经与基金托管人协商一致并得到批准后，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

（三）收益分配方案的确定与公告

1、本基金每工作日公布前一工作日的基金日收益与基金七日收益率。基金收益公告由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，公告前报中国证监会备案，每工作日公告一次，披露公告截止日前一个工作日（含节假日）每万份基金份额收益及以最近七日收益所折算的年资产收益率。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。

2、计算方法

本基金按日分配收益，基金管理人另行公告。基金收益计算方法为：

（1）日每万份基金净收益=当日基金净收益/当日基金份额总额×10000；

其中，单个基金账户当日分配的基金收益自其下一工作日起享有分红权益，纳入基金份额总额的计算。

每万份基金净收益保留至小数点后第4位，第五位舍去。期间每万份基金净收益=

$$\sum_{w=1}^n (r_w / S_w) \times 10000 ;$$

其中， r_1 为期间首日基金净收益， S_1 为期间首日基金份额总额， r_w 为第 w

日基金净收益， S_w 为第 w 日基金份额总额， r_n 为期间最后一日基金净收益， S_n 为期间最后一日基金份额总额。

$$(2) \text{按日结转份额的七日年化收益率} = \left\{ \left[\prod_{i=1}^7 \left(1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{\frac{365}{7}} - 1 \right\} \times 100\%$$

其中， R_i 为最近第 i 个自然日(包括计算当日)的每万份基金净收益。

七日年化收益率四舍五入保留至小数点后第 3 位。

(3) 法律法规另有规定的，从其规定，基金管理人应当在变动以上计算方式前 3 个工作日在指定媒体披露。

十五、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

1、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) 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 0.33% 年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

（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0.10%的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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首日起两个工作日内从基金资产中一次性支取。

（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。基金合同生效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。

（4）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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1、基金销售服务费

基金销售服务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为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人可以调整销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构。

2、基金认购费用

本基金不收取认购费用。

3、申购费

本基金不收取申购费用。

4、赎回费

本基金不收取赎回费用。

5、转换费

本基金可以与基金管理人所管理的长盛成长价值基金之间进行转换。转换费率如下：

（1）由本基金转换为长盛成长价值基金，转换费如下表所示：

长盛货币基金转长盛成长价值基金转换金额（M）	费率
M < 100 万元	1.5%
100 M < 500 万元	1.2%
500 M < 1000 万元	0.6%
M 1000 万元	0.2%

（2）由长盛成长价值基金转换为本基金，转换费率为 0.5%，其中的 25% 归入长盛成长价值基金资产。

基金转换的具体业务规则详见基金管理人相关业务公告。

（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。

十六、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：如果基金合同生效至本年度末少于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（原始凭证由基金托管人保管）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。

十七、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》、《运作办法》、《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》、《运作办法》、《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，基金管理人 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》应在公告的十五日前向中国证监会报送，并就有关更新内容提供书面说明。

2、基金运作定期信息披露

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净值收益公告等，由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《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）基金净值收益公告：

货币市场基金收益公告的内容包括但不限于：基金日收益和基金七日收益率。

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重大事件时，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) 开放式基金暂停申购或暂停赎回；
- (25) 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- (26) 开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- (27) 中国证监会规定的其他事项。

4、澄清公告

在《基金合同》期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

5、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、托管协议、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、基金净值收益公告等信息披露文件在编制完成后，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。

招募说明书及基金定期报告还应置备于基金托管人的住所，供公众查阅、复制；基金合同、基金托管协议还应由基金托管人登载在网站上。

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。

十八、风险揭示

本基金属于风险较低的产品类型，但是并不意味着投资本基金不承担任何风险，基金管理人在投资管理中将采用审慎的原则以规避投资风险，同时也提醒投资人注意以下几方面的投资风险。

（一）利率风险

当市场利率上升时，基金持有的短期金融工具的市场价格将下降，从而引起基金净值的降低。由于基金投资范围严格控制在短期货币市场工具中，并且组合的平均剩余期限不超过 180 天，所以市场利率上升导致基金本金损失的风险很小。

当市场利率下降时，基金再投资的短期金融工具的利息水平将下降，导致基金的当期收益随之降低。

（二）信用风险

当基金持有的债券、票据的发行人违约，不按时偿付本金或利息时，将直接导致基金资产的损失。同时当基金持有的债券、票据或其发行人的信用等级下降时，会因违约风险的加大而导致市场价格的下降，从而导致基金资产的损失。由于本基金将主要投资于高信用等级的短期金融工具，所以承担的上述信用风险很小。

在基金投资债券、票据或债券回购的交易过程中，当发生交易对手违约时，将直接导致基金资产的损失；或是导致基金不能按时收回投资资金，从而造成当期收益的下降。本基金将在投资决策中充分考虑交易对手的信用状况，尽可能避免上述信用损失。

（三）流动性风险

当基金面临投资者集中赎回时，需迅速变现组合资产，从而承担交易成本和变现成本的损失。本基金将通过合理滚动的期限匹配与优化技术，将流动性风险降到最低。

为满足投资者的赎回需要，基金可能保留一定比例的现金，而现金的投资收益最低，从而造成基金当期收益下降。

（四）积极管理风险

基金管理人可能因信息不全等原因导致判断失误，影响基金的收益水平。

（五）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致基金资产损失，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

（六）法律风险

基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规及基金合同的有关规定的风险。

（七）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人的利益受损。

十九、基金的终止与基金财产的清算

（一）基金的终止

1、出现下列情况之一的，本基金经中国证监会批准后终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

2、本基金终止后，须按法律法规和基金合同对基金进行清算。清算报告报中国证监会备案并予以公告后本基金终止。

（二）基金财产的清算

1、基金财产清算小组

（1）基金管理人应当自基金合同终止之日起30个工作日内组织成立基金财产清算小组。基金财产清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、基金财产的清算程序

（1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

- (2) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行评估和变现；
- (4) 基金财产清算小组做出清算报告；
- (5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算报告报中国证监会备案；
- (8) 公布基金财产清算公告；
- (9) 对基金财产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金财产清算后剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金财产清算的公告

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立进行公告；

清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组公告；

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财产清算小组经中国证监会批准后3个工作日内公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存15年以上。

二十、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) 分享基金财产收益；

- 2) 参与分配清算后的剩余基金资产；
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 依照相关法律法规和本合同的规定，要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 按相关法律法规的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查询或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作，
- 8) 要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制定的其他法律文件的规定履行其义务，对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 在不同的基金直销或代销机构之间转托管；
- 10) 法律、法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制定的其他法律文件规定的其他权利。

每份基金份额享有同等的合法权益。

（2）基金份额持有人的义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- 5) 返还持有基金过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- 6) 法律法规及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，基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金资产；
- 2) 根据本基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、质押、收益分配等方面的业务规则；
- 3) 根据法律法规和本基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方

式，获得基金管理费，亲自或委托其他机构向投资者收取事先公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

4) 根据本基金合同规定销售基金份额；

5) 提议召开基金份额持有人大会；

6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

7) 依据本基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定，并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银行监管机构，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取其它必要措施保护基金投资者的利益；

8) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金销售代理人的作为或不作为违反了法律法规、本基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、本基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益；

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) 自行担任基金注册登记代理机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册与过户登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

11) 根据国家有关规定在法律法规允许的前提下依法为基金融资；

12) 依据本基金合同的规定，决定基金收益的分配方案；

13) 按照《基金法》、《运作办法》、《暂行规定》代表基金行使因投资于证券所产生的权利；

14) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

15) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

（2）基金管理人的义务

1) 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；

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财产；

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

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

5) 依法接受基金托管人的监督；

6) 采取适当合理的措施使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；

7) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；按照规定计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金日收益和基金七日收益率；

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

9) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项和分红款项；

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

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

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

13) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

14) 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他机构代理该项业务；

15) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业

务；

16) 对所管理的不同基金资产分别设账、进行基金会计核算，编制基金的财务会计报告；

17) 保管基金的会计账册、报表、记录15 年以上；

18) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；

19) 保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

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所在地中国证监会派出机构并通知基金托管人；

21) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

22) 公平对待所管理的不同基金财产；

24) 负责为基金聘请注册会计师和律师；

25) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

(1) 基金托管人的权利

1) 依照基金合同的约定获得基金托管费和其他法律法规允许或监管部门批准的收入；

2) 监督基金管理人对本基金的运作，如认为基金管理人违反了基金合同的有关规定，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

3) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

4) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

5) 法律、法规、基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

(2) 基金托管人的义务

1) 遵守《基金法》、《运作管理办法》、《暂行规定》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金资产；

2) 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；

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

4) 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；

5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

6) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

7) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

8) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

9) 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；

10) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

11) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

12) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

13) 建立健全内部控制制度，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相互独立，保证其托管的基金资产与其托管的其他基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

14) 负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的基金划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

15) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金日收益和基金七日收益率；

16) 采取适当、合理的措施，使本基金的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定，并使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

- 17) 按规定保存有关基金托管事务的完整记录15 年以上；
- 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银监会，并通知基金管理人；
- 20) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。
- 21) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；
- 22) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人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。

1、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）变更基金类别；
- （5）变更基金份额持有人大会程序；
- （6）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）；
- （7）更换基金管理人、基金托管人；
- （8）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；
- （9）《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。

2、召集人和召集方式

（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。

3、通知时间、内容和方式

（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) 基金份额持有人出席会议需准备的文件和需履行的手续；
- 6) 会务常设联系人姓名、电话；
- 7) 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。

4、基金份额持有人出席会议的方式

（1）会议召开方式

- 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：

a、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%）；

b、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：

a、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；

b、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；

c、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%）；

d、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。

5、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：

a、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；

b、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。

6、决议形成的条件、表决方式和程序

（1）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。

（2）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采取记名方式进行投票表决。

3) 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。

4) 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。

7、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。

8、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）基金合同解除和终止的事由、程序

出现下列情况之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

（四）争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，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。

（五）基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理机构和注册登记机构的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅；也可按工本费购买基金合同复印件或复印件，但应以基金合同正本为准。

二十一、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

住所：深圳市福田区华富路航都大厦 13C

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

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

营业期限：持续经营

2、基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

注册日期：1988年7月20日

注册资本：39.99亿元人民币

基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人投资运作的监督

1、根据《基金法》、《运作办法》、《暂行规定》、《基金合同》和有关证券法律法规的规定，基金托管人的监督内容包括但不限于：对基金的投资范围、基金财产的投资组合比例、投资限制、基金投资组合平均剩余期限及其计算、基金资产估值、基金资产净值计算与会计核算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配

等行为。

基金托管人的监督标准为：基金投资范围、投资组合比例和组合平均剩余期限等是否符合《基金法》及相关配套法律法规以及《基金合同》中关于投资范围、投资组合比例、平均剩余期限等规定内容；是否存在法律法规及监管机关规定禁止从事的投资行为；基金管理人对于基金资产的估值、净值计算与会计核算、每万份基金净收益和7日年化收益率的计算、各类费用的计提和支付、基金收益分配等行为是否符合《基金法》及相关配套法律法规以及《基金合同》的规定。

上述约定内容，如因相关法律法规、规章另有明确规定使得此部分内容不符或冲突的，基金管理人与基金托管人应当对此进行修改并遵照执行。

2、基金托管人发现基金管理人的投资运作行为违反《基金法》、《运作办法》、《暂行规定》、《基金合同》和有关证券法律、法规规定的行为，应及时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应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、《暂行规定》、《基金合同》和有关法律、法规规定的行为，可以拒绝执行，通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

3、基金托管人发现基金管理人具有重大违规行为，严重损害基金投资人利益的，应立即报告中国证监会，同时以书面形式通知基金管理人限期纠正。

基金管理人具有义务积极配合和协助基金托管人依照托管协议对基金业务执行核查。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议的规定行使核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效核查，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人在此情形下，有权召集基金份额持有人大会，提请更换基金管理人、代表基金对因基金管理人的过错造成基金财产的损失向基金管理人索赔。

（三）基金管理人

1、根据《基金法》、《运作办法》、《暂行规定》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部财产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金财产实行分账管理等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

2、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《暂行规定》、《基金合同》及其他有关规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

3、基金管理人发现基金托管人有挪用基金财产、延迟支付赎回款项等重大违规行为，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。

基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照托管协议对基金业务执行核查。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议的规定行使核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效核查，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人在此情形下，有权召集基金份额持有人大会，提请更换基金托管人、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人应遵守《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益安全保管基金财产。基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金财产。

（2）基金托管人应当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；建立健全内部风险监控制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

（3）基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施

（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

（4）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金托管人应按照规定开立基金财产的资金账户和证券账户。本基金财产与基金托管人的其他财产及其他基金的财产实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。基金托管人应安全、完整地保管基金财产，未经基金管理人的正当指令，基金托管人不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（5）对于基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日没有到达基金托管人处的基金申购款项，基金托管人应及时通知基金管理人，由基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿。

（6）对于因为基金投资产生的应收资产，由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行处理，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿。

2、基金募集期满时募集资金的验证

基金募集期满，基金管理人将净认购资金及认购资金在认购期产生的认购利息划至基金托管账户。募集的基金份额总额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人在十日内聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签名有效。基金托管人在收到资金当日出具基金财产接收报告，开始履行托管人基金财产保管职责。若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

3、投资人申购资金的归集和赎回资金的派发

基金托管人应及时查收基金份额持有人的申购资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知基金管理人，基金管理人负责处理。因申购资金未及时到账而给基金造成损失的，基金托管人不存在过错的，基金托管人对此不承担任何责任。

投资人赎回的资金，基金托管人应根据基金管理人的通知进行划拨。基金托

管人未按约定时间划拨，给投资人造成损失的，基金托管人应承担赔偿责任。

4、基金银行账户的开设和管理

（1）基金的银行账户的开设和管理由基金托管人办理，基金管理人予以配合并提供相关资料。基金托管人要确保所托管基金全部存款的安全。

（2）基金托管人根据基金管理人的指令办理资金支付。本基金的预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金的银行账户进行。

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

（4）基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

5、基金证券账户、证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立托管人与基金联名的证券账户，用于本基金证券投资的清算和存管，并对证券账户业务发生情况进行如实记录。基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。基金托管人负责基金证券账户的开立和证券账户卡的保管。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立基金证券交易资金的结算备付金账户，用于证券资金清算。

6、债券托管账户的开设和管理

（1）《基金合同》生效后，由基金管理人负责代基金向中国证监会、中国人民银行提出申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算，基金管理人予以配合并提供相关资料。

（2）基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间国债市场回购主协议，基金托管人保管协议正本，基金管理人保存协议副本。

7、基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券可以存放于基金托管人的保管库，但要与存放于基金托管人处的非本基金的其他实物证券分开保管，也可存入中央国债登记结算公司或中国证券登记结算公司或其他由基金托管人选定的代保管库中。保管凭证由基金托管人保存。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。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

（1）与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本且该正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。保管期限按照国家有关规定执行。

（2）与基金资产有关的重大合同，根据基金运作管理的需要由基金托管人以基金的名义签署的，由基金管理人以加密传真方式下达签署指令（含有效授权内容），合同原件由基金托管人保管，但基金托管人应将合同原件的复印件加盖基金托管人公章（骑缝章）后，交基金管理人一份。如该等合同需要加盖基金管理人公章，则基金管理人至少应保留一份合同原件。

（3）因基金管理人将自己保管的本基金重大合同在未经基金托管人同意的情况下，用于抵质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金资产损失，由基金管理人负责，基金托管人予以免责。

因基金托管人将自己保管的本基金重大合同在未经管理人同意的情况下，用于抵质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金资产损失，由基金托管人负责，基金管理人予以免责。

9、其他账户的开立和管理

（1）因业务需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定办理和使用。

（2）法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（五）基金资产净值、每万份基金净收益、基金七日收益率的计算、复核与完成的时间及程序

1、基金资产净值、每万份基金净收益、七日年化收益率的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

每万份基金净收益=当日基金净收益/当日基金份额总额×10000

$$\text{七日年化收益率} = \left\{ \left[\prod_{i=1}^7 \left(1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{\frac{365}{7}} - 1 \right\} \times 100\%$$

2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式发送给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核；经基金托管人复核无误后，加盖业务公章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公告。

如基金管理人和基金托管人对基金资产净值、每万份基金净收益和基金7日年化收益率的计算结果有差异，且双方在平等基础上充分讨论后仍无法达成一致的意见，则按基金管理人计算的结果对外予以公告，并应在对外公告时说明基金托管人的复核情况，基金托管人有权将该等情况报相关监管机构备案。由此给基金投资者和基金造成的损失，由责任方赔偿；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，不对任何第三方负责。

（六）基金份额持有人名册的登记与保管

本基金份额的登记由基金登记注册人担任。基金份额持有人名册由基金登记注册人负责编制和保管。基金份额持有人名册保管期限不得低于15年。

（七）争议解决方式

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应先友好协商解决。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。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

（八）托管协议的修改与终止

1、本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会备案后生效，须经证监会核准的，经其核准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
- （3）基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生《基金法》、其他法律法规或《基金合同》规定的其他终止事项。

二十二、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，基金管理人根据基金份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，有权增加、修改服务项目。

（一）基金份额持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，基金份额持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

（二）红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该基金份额持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转基金份额，且不收取任何申购费用。

（三）定期定额投资计划

在条件成熟时，基金管理人可通过代销机构为基金份额持有人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，基金份额持有人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，该定期定额申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公

告为准。

（四）网上交易服务

为基金份额持有人提供网上交易平台。通过先进的网络通讯技术，为基金份额持有人提供高效安全的基金交易服务、及时迅捷的基金信息和理财服务。

（五）主动通知服务

通过邮寄、电子邮件、短信、主动致电等方式为基金份额持有人提供各项主动通知服务，包括邮寄季度对账单、发送月度电子对账单、基金份额持有人交易成交后发送电子通知单和短信通知信息、对账单寄送失败将进行电子邮件或短信通知、公司公告及重要信息将通过以上方式主动通知基金份额持有人等服务。

（六）查询服务

为方便基金份额持有人随时了解公司相关信息及投资资讯，基金管理人开通 24 小时自动语音服务、网上查询、短信查询。通过以上方式可进行公司信息查询和基金份额持有人账户信息查询。

具体查询内容：

自动语音及网上查询：最新活动公告、各基金介绍、公司介绍等公司信息；基金交易查询、投资现值查询、基金分红查询、对账单查询等账户信息

短信查询：基金净值情况、账户情况

或可直接致电客户服务热线转人工查询。

（七）多元资料索取

为向基金份额持有人提供详细的专业基金投资资料，便于办理各种交易手续，同时方便基金份额持有人索取，基金管理人提供了多元化的资料索取服务，索取途径多样，资料内容丰富详尽。

基金份额持有人可通过 24 小时客户服务热线的自动语音系统以传真与 EMAIL 形式索取公司最新文件：直销业务表格、封闭式及开放式基金公告、基金知识及公司相关信息。

所有对外公布之文件及各种相关历史文件均可向客户服务人员索取，客户服务人员可通过传真、EMAIL 及邮寄形式提供。

同时，公司网站上提供各种资料、业务表单及公告下载。

（八）资讯服务定制

为进一步提高基金运作的透明度，提升服务品质，使基金份额持有人及时了

解基金投资资讯，基金管理人推出全方位资讯服务定制项目。基金份额持有人可通过客服热线、公司网站、短信定制各种资讯，公司通过传真、EMAIL、短信等多渠道发送资讯定制服务。

基金管理人会按照基金份额持有人要求定期提供日报、周报、月报及月度电子对账单、电子交割确认单、短信成交通知、短信每周净值、公司旗下四只封闭式及开放式基金的中报、年报、投资组合公告、业绩表现、及各种投资研究报告和临时公告等。

基金管理人的资讯服务，在做到每天发送各种不同资讯同时，资讯内容全方位涵盖了公司全部可披露信息，并将市场的最新信息、具有深度的新闻资讯及基金管理人的市场判断、操作等。每月基金管理人向基金份额持有人提供电子邮件形式的电子对账单，以便更加及时的了解账户情况。

另外，基金管理人每季度还为基金份额持有人准备了精美的季刊，使基金份额持有人能深切体会长盛的公司文化、了解公司研究成果。

（九）投资业务咨询

基金管理人拥有一支训练有素、专业知识全面的投资顾问队伍，为更好地与基金份额持有人进行沟通，公司的专业客户服务代表在工作时间内回答客户提出的问题，提供关于基金投资全方位的咨询服务。

同时，还提供网上短信息交流及手机短信息交流。

（十）投诉建议受理

如果对基金管理人提供的各种服务感到不满或需求，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等各种方式随时向基金管理人提出，也可直接与客户服务人员联系，基金管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉；同时，基金份额持有人的合理建议是基金管理人发展的动力与方向。

（十一）语音留言服务

为加强沟通和联系，基金管理人在任何时间均提供语音留言服务，将基金份额持有人疑问或意见保存，客户服务人员将及时进行处理。

（十二）客服互动活动

基金管理人为基金份额持有人举办各种互动活动如基金份额持有人见面会、理财讲座、积分银行活动，以加强基金份额持有人与基金公司间的互动联系。

（十三）长盛客户服务中心联系方式

长盛基金管理有限公司客户服务热线：（010）62350088

400-888-2666

长盛基金管理有限公司网址：www.csfunds.com.cn

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

二十三、其他应披露事项

- （一）本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。
- （二）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。
- （三）2006年12月26日本基金管理人发布本基金元旦放假前暂停申购和转入的公告。
- （四）2007年1月4日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （五）2007年1月19日本基金管理人发布本基金2006年第4季度报告。
- （六）2007年2月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （七）2007年3月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （八）2007年3月2日本基金管理人发布电子系统升级暂停服务的公告。
- （九）2007年3月29日本基金管理人发布本基金2006年年度报告。
- （十）2007年4月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （十一）2007年4月19日本基金管理人关于公司股权变更和修改公司章程的公告。
- （十二）2007年4月19日本基金管理人发布2007年1季度报告。
- （十三）2007年4月25日本基金管理人发布关于“五一”长假前2个工作日暂停申购和转换转入的公告。
- （十四）2007年5月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （十五）2007年6月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。

二十四、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和营业场所，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。

二十五、备查文件

- （一）中国证监会批准长盛货币市场基金设立的文件
- （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）《长盛货币市场基金基金合同》
- （六）《长盛货币市场基金业务规则》
- （七）《长盛货币市场基金托管协议》
- （八）《长盛货币市场基金代理销售协议》
- （九）中国证监会规定的其它文件

长盛基金管理有限公司

二零零七年八月二十五日