

长盛中信全债指数增强型 债券投资基金招募说明书

基金发起人：长盛基金管理有限公司

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

重要提示

基金发起人/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作出的任何决定，均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。

基金管理人承诺诚实信用、勤勉尽责地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。

投资有风险，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资人认购基金时应认真阅读本招募说明书。

长盛中信全债指数增强型债券投资基金资料摘要

- 基金名称：长盛中信全债指数增强型债券投资基金
- 基金类型：契约型开放式
- 投资目标：本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求当期收益和基金资产超过比较基准的长期稳定增值。
- 投资范围：本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发发行、上市或拟上市的各种债券、股票及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金，本基金主要投资于各种债券品种，品种主要包括：国债、金融债、企业债与可转换债券。本基金对目标指数的投资在资产配置中的比例最低为 64%，股票投资在资产配置中的比例不超过 16%。
- 收益分配：在符合分红条件的前提下，每年至少一次，投资人可以选择现金分红或红利再投资。本基金基金单位的默认分红方式为红利再投资
- 基金单位面值：1.00 元人民币
- 认购费用：不超过认购金额的 1%
- 销售对象：中华人民共和国境内的个人投资人和机构投资人（有关法律、法规禁止的投资人除外）
- 销售渠道：通过长盛基金管理有限公司的直销网点以及中国农业银行、交通银行、中信实业银行、深圳发展银行、中信证券股份有限公司、华夏证券有限公司、长江证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、国泰君安股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、天同证券有限责任公司、广发证券股份有限公司的代销网点公开发售。
- 设立募集期限：自招募说明书公告之日起不超过 3 个月
- 申购开始时间：自本基金成立后不超过 30 个工作日的时间开始办理申购
- 赎回开始时间：自本基金成立后不超过 30 个工作日的时间开始办理赎回
- 申购费用：可在申购或赎回时收取，在申购时收取最高不超过申购金额（含申购费）的 1.5%，在赎回时收取按照持有期限

递减，最高不超过申购金额（含申购费）的 1.5%
赎回费率：按持有期递减，最高不超过赎回金额的 0.3%
认购最低投资限制：1,000 元
申购最低投资限制：1,000 元
基金单位净值：T 日的基金单位净值在当天收市后计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，于 T+1 日公告
基金份额精确度：保留到小数点后两位，剩余部分四舍五入
会计期间：公历 1 月 1 日至 12 月 31 日
基金发起人：长盛基金管理有限公司
基金管理人：长盛基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行
基金登记注册人：中国证券登记结算有限责任公司
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司
律师事务所：北京市信利律师事务所
签署日期：2003 年 8 月 12 日

上述内容仅为基金基本资料摘要，详细资料须以本招募说明书正文所载的内容为准。

长盛中信全债指数增强型债券投资基金产品说明（概要）

投资目标：本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求当期收益和基金资产超过比较基准的长期稳定增值。

投资范围：本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行人、上市或拟上市的各种债券、股票及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金，本基金主要投资于各类债券品种，品种主要包括：国债、金融债、企业债与可转换债券。本基金对目标指数的投资在资产配置中的比例最低为64%，股票投资在资产配置中的比例不超过16%。

投资理念：以指数化投资为基础，通过一定程度低风险的积极性投资，结合对投资组合的动态管理，实现基金资产的长期增值。

债券资产配置策略：本基金将债券资产配置分为战略性资产和战术性资产两部分。战略性资产体现指数化投资策略，其配置的最低比例为基金净资产的64%；战术性资产配置则体现指数化的增强性投资。

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

个股选择标准：公司发展战略清晰，管理科学稳健，处于行业领先地位；业绩优良，有持续分红记录；流通市值大于市场平均水平且市净率较低的股票；其他价值被低估的股票。

业绩比较基准：基金业绩衡量基准 = 中信全债指数收益率 × 92% + 中信综合指数收益率 × 8%

风险收益特征：本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

风险管理工具：本基金利用长盛基金管理有限公司风险控制和绩效评估系统进行风险管理。

目 录

一、绪言.....	1
二、释义.....	1
三、基金的设立.....	2
四、管理与组织.....	3
五、基金的募集安排.....	7
六、基金的成立.....	11
七、基金管理.....	11
八、基金管理人的风险管理和内部控制制度	19
九、基金托管.....	21
十、基金的投资.....	24
十一、风险揭示.....	29
十二、费用概览.....	33
十三、基金资产	35
十四、基金资产估值.....	35
十五、基金税收.....	37
十六、基金的收益与分配.....	37
十七、基金的会计与审计.....	39
十八、基金的申购与赎回.....	39
十九、基金的非交易过户、转托管与冻结	46
二十、基金的登记注册.....	46

二十一、基金持有人.....	48
二十二、对持有人的服务.....	53
二十三、基金的信息披露.....	54
二十四、基金终止.....	55
二十五、基金清算.....	56
二十六、基金专用交易席位的选用	57
二十七、招募说明书存放及查阅方式	58
二十八、备查文件.....	58

一、绪言

基金发起人/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。本基金根据本招募说明书所载明资料申请发行。本基金发起人/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契约编写，并经中国证监会核准。基金契约是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资人取得依基金契约所发行的基金单位，即成为基金持有人，其持有基金单位的行为本身即表明其对基金契约的承认和接受，并按照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其它有关规定享受权利、承担义务；基金投资人欲了解基金持有人的权利和义务，应详细查阅基金契约。

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：

基金契约：	指《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金契约》
招募说明书：	指《长盛中信全债指数增强型债券投资基金招募说明书》
发行公告：	指《长盛中信全债指数增强型债券投资基金发行公告》
《暂行办法》：	指 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布并施行的《证券投资基金管理暂行办法》
《试点办法》：	指 2000 年 10 月 8 日由中国证监会发布并施行的《开放式证券投资基金试点办法》
元：	指人民币元
基金账户：	指基金登记注册人为投资人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《基金契约》所设立的长盛中信全债指数增强型债券投资基金
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

直销机构:	指长盛基金管理有限公司
基金登记注册人:	指中国证券登记结算有限责任公司
基金契约当事人:	指受基金契约约束,根据基金契约享受权利并承担义务的法律主体
个人投资人:	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,在基金净销售额超过人民币2亿元,且认购户数达到或超过100户的条件下,基金发起人可以依据《试点办法》和实际发行情况停止发行,并宣告基金成立的日期
募集期:	指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段,最长不超过3个月
存续期:	不定期
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
认购:	指在本基金募集期间,投资人申请购买本基金单位的行为
申购:	指在本基金成立后,投资人申请购买本基金单位的行为
赎回:	指基金持有人按基金契约规定的条件要求基金管理人购回基金单位的行为
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:	基金资产总值是指基金所拥有的各类证券价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其它投资等所形成的资产总和
基金资产净值:	指基金资产总值减去负债后的价值
基金资产估值:	指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金单位净值的过程
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、基金的设立

(一) 基金设立的依据

本基金由基金发起人/基金管理人依照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其它有关规定,并经中国证监会证监基金【2003】90号文批准发起设立。

(二) 基金类型

契约型开放式基金

(三) 基金的存续期间

不定期

四、管理与组织

(一) 基金管理人

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区华富路航都大厦 13C

办公地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271

法定代表人：王其华

电话：(010) 64689198

传真：(010) 64689475

(二) 基金托管人

名称：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) 68424199

传真：(010) 68424181

(三) 基金发起人

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区华富路航都大厦 13C

办公地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271

法定代表人：王其华

电话：(010) 64689198

传真：(010) 64689475

(四) 销售机构

1、直销机构：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区华富路航都大厦 13C

办公地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271

法定代表人：王其华

电话：(010) 64689198

传真：(010) 64689475

客户服务电话：(010) 84510088

2、销售代理人：

(1) 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

(2) 交通银行

注册地址：上海市仙霞路 18 号
办公地址：上海市银城中路 188 号
法定代表人：方诚国
电话：(021) 58781234
传真：(021) 58408842
联系人：王玮

(3) 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

(4) 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) 82080714
传真：(0755) 82080714
联系人：李谨豪

(5) 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 63538、63706
传真：010-84865560
联系人：马永、马泽承

(6) 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

(7) 长江证券有限责任公司
注册地址：武汉市新华下路特 8 号
法定代表人：明云成
电话：021-63291352
传真：021-68670702
联系人：任蕙

(8) 国元证券有限责任公司
注册地址：合肥寿春路 179 号
法定代表人：凤良志
电话：(0551) 2634400
传真：(0551) 2626941
联系人：李蔡

(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
法人代表人：祝幼一
联系电话：(021) 62580818-213
传真：(021) 62583439
联系人：芮敏祺

(10) 海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路 98 号
法定代表人：王开国
联系电话：021-53594566-6507
传真：021-53858549
联系人：李莹莹

(11) 申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路 171 号
法定代表人：王明权
电话：021-54033888
传真：021-64738844
联系人：王序微

(12) 招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943234
传真：0755-82943237
联系人：王玉亭

(13) 天同证券有限责任公司

注册地址：山东济南泉城路 180 号齐鲁国际大厦五层

法定代表人：段虎

电话：0531-6019999

传真：0531-6019999-6704

联系人：罗海涛

(14) 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：陈云贤

联系电话：020-87555888-875

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

基金管理人可根据《暂行办法》、《试点办法》和基金契约等的规定，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。在证券交易所开放式基金交易技术条件成熟时，本管理人可增加证券交易所作为本基金申购、赎回渠道，并另行公告。

(五) 登记注册机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街 27 号投资广场 22、23 层

法定代表人：陈耀先

电话：(0755) 25938091

传真：(0755) 25987538

联系人：刘春长

(六) 律师事务所和经办律师

名称：北京市信利律师事务所

注册地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 609 室

办公地址：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

(七) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号

办公地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼

法定代表人：Kent Watson

电话：(021) 63863388

传真：(021) 63863300

经办注册会计师：肖峰、陈玲

五、基金的募集安排

(一) 募集方式

- 1、直销：长盛基金管理有限公司北京、上海直销中心。
- 2、代销：中国农业银行、交通银行、中信实业银行、深圳发展银行、中信证券股份有限公司、华夏证券有限公司、长江证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、国泰君安股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、天同证券有限责任公司、广发证券股份有限公司办理本基金销售的营业网点。

(二) 募集期限

自本招募说明书公告之日起不超过 3 个月。

自 2003 年 8 月 18 日到 2003 年 9 月 29 日，本基金同时对个人投资人和机构投资者公开发售（详见发行公告）。

根据《试点办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金成立的法定条件，本基金可在设立募集期内继续销售。

具体发行时间以发行公告为准，请投资人就发行和认购事宜仔细阅读本基金的发行公告。

(三) 募集对象

中华人民共和国境内的个人投资人和机构投资者（法律、法规和其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）。

(四) 募集场所

1、直销机构：

(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 20 层 2072

电话：(010) 64689198-245、211

传真：(010) 64689520、64689521、64689522

联系人：关威

(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：刘奇伟

2、销售代理人

(1) 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

(2) 交通银行

注册地址：上海市仙霞路 18 号
办公地址：上海市银城中路 188 号
法定代表人：方诚国
电话：(021) 58781234
传真：(021) 58408842
联系人：王玮

(3) 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

(4) 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) 82080714
传真：(0755) 82080714
联系人：李谨豪

(5) 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 63538、63706
传真：010-84865560
联系人：马永、马泽承

(6) 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

(7) 长江证券有限责任公司
注册地址：武汉市新华下路特 8 号
法定代表人：明云成
电话：021-63291352
传真：021-68670702
联系人：任蕙

(8) 国元证券有限责任公司
注册地址：合肥寿春路 179 号
法定代表人：凤良志
电话：(0551) 2634400
传真：(0551) 2626941
联系人：李蔡

(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
法人代表人：祝幼一
联系电话：(021) 62580818-213
传真：(021) 62583439
联系人：芮敏祺

(10) 海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路 98 号
法定代表人：王开国
联系电话：021-53594566-6507
传真：021-53858549
联系人：李莹莹

(11) 申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路 171 号
法定代表人：王明权
电话：021-54033888
传真：021-64738844
联系人：王序微

(12) 招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943234
传真：0755-82943237
联系人：王玉亭

(13) 天同证券有限责任公司

注册地址：山东济南泉城路 180 号齐鲁国际大厦五层

法定代表人：段虎

电话：0531-6019999

传真：0531-6019999-6704

联系人：罗海涛

(14) 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：陈云贤

联系电话：020-87555888-875

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

以上代销机构办理本基金业务的城市或营业网点的具体情况和联系方法，请参见本基金的发行公告以及以上代销机构相关的业务公告。

(五) 募集资金利息的处理方法

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

(六) 认购费用及计算公式

1、认购费用

本基金认购费率为不超过认购金额的 1%。

认购费用用于本基金的市场推广、销售等设立募集期间发生的各项费用。

2、认购份数的计算

认购份数的计算方法如下：

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

$$\text{净认购金额} = (\text{认购金额} - \text{认购费用}) + \text{认购利息}$$

$$\text{认购份数} = \text{净认购金额} / \text{基金单位面值}$$

基金单位面值为 1.00 元。基金单位份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

例：假定某投资人认购金额为 10,000 元，其认购利息为 3 元，则该投资人认购负担的认购费用和获得的基金份额计算如下：

$$\text{认购费用} = 10,000 \times 1\% = 100 \text{元}$$

$$\text{净认购金额} = (10,000 - 100) + 3 = 9,903 \text{元}$$

$$\text{认购份数} = 9,903 / 1.00 = 9,903 \text{份}$$

(七) 募集规模

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

(八) 投资人对基金单位的认购

1、认购程序

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售代理人规定，在募集期的交易时间段内提出认购申请，并办理有关手续。投资者认购本基金，须按销售机构规定全额缴纳认购款项。

2、投资人办理认购需提交的文件详见发行公告。

3、认购的方式及确认

- (1) 本基金代销网点和直销中心的单笔最低认购金额为 1,000 元。
- (2) 投资人在发行期内可多次认购本基金。
- (3) 认购申请一经提出，不得撤销。
- (4) 发行期间，销售机构为投资人办理认购手续仅代表对投资人认购申请的受理，投资人认购成功与否应以基金募集结束后登记注册人的认购确认为准。

六、基金的成立

(一) 基金的成立条件

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

基金管理人将在指定媒体公告本基金成立信息。

(二) 基金不能成立时募集资金的处理方式

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

(三) 基金存续期内的基金持有人数量和资金额

本基金成立后的存续期间内，有效基金持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。

七、基金管理

(一) 基金管理人概况

本基金管理人由中信证券股份有限公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券有限责任公司、长江证券有限责任公司共同发起，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，法定代表人：王其华，注册地址为：深圳市福田区华富路航都大厦13C，办公地址为：北京市朝阳区北三环东路8号静安中心2271。截至2002年12月31日，基金管理人共管理四只封闭式基金和一只开放式基金，基金资产规模达73.26亿元。

公司设立了两个专门机构：投资决策委员会和风险控制委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评价公司在运营管理和投资过程中的各项风险，并提出防范措施。

公司下设九个部门，分别是：投资管理部、研究发展部、策划发展部、市场发展部、监察稽核部、业务运营部、信息技术部、综合管理部和财务会计部。投资管理部负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行股票选择和组合管理。研究发展部负责完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。策划发展部负责公司战略规划、新产品开发、机构客户关系等工作。市场发展部负责市场开发及销售、客户服务等工作。监察稽核部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行全方位的监察稽核，并向公司管理层提供独立、客观、公正的意见和建议，保证公司业务流程的顺畅及公司运作的合法合规。业务运营部负责基金核算和开放式基金登记注册。信息技术部负责公司的计算机设备的维护、系统的开发以及网络运行和维护工作。综合管理部负责公司综合行政事务、人事劳资管理、后勤保障等。财务会计部负责公司会计和财务管理。

长盛基金管理有限公司现有正式员工 76 名，所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

（二）基金经营业绩及主要财务指标：

本基金系初次发售，基金成立运作后将开始披露基金的运作业绩。请投资人关注本基金的后续公告。

截至 2002 年 12 月 31 日，基金管理人管理四只封闭式和一只开放式基金，基本情况如下：

基金名称	基金同益	基金同盛	基金同智	基金同德	长盛成长价值
成立时间	1999 年 4 月 8 日	1999 年 11 月 1 日	2000 年 3 月 8 日	2000 年 10 月 20 日	2002 年 9 月 18 日
基金类型	契约型封闭式				契约型开放式
基金经理	肖强、罗文军	邓瑞祥	闵昱	陈剑平	丁楹、王新艳、常昊
基金单位总数	20 亿份	30 亿份	5 亿份	5 亿份	20.11 亿份
基金单位净值	0.8929	0.8785	0.8888	0.8769	0.980
累计净值	1.7069	1.1710	0.9917	0.8769	0.980
历年净值增长率	1999 年:30.36% 2000 年:52.74% 2001 年:-10.42% 2002 年:-12.55%	1999 年:-0.88% 2000 年:41.77% 2001 年:-9.89% 2002 年:-12.85%	2000 年:19.88% 2001 年:-5.38% 2002 年:-11.43%	2000 年:10.98% 2001 年:-3.55% 2002 年:-11.01%	2002 年:-2.00%
历年分红情况 (元/份)	1999 年:0.1670 元 2000 年:0.4515 元 2001 年:0.1955 元	2000 年:0.2164 元 2001 年:0.0761 元	2000 年:0.0461 元 2001 年:0.0568 元		

基金代码	184690	184699	184702	500039	080001
基金托管人	中国工商银行	中国银行	中国银行	中国农业银行	中国农业银行

（三）主要人员情况：

1、基金管理人董事会成员：

王其华先生：董事长。经济学硕士。高级统计师。历任天津北方国际信托投资股份有限公司投资银行部经理、开信基金管理部经理、副总经济师、副总经理。现任长盛基金管理有限公司董事长。

蒋月勤先生：董事、总经理。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总经理。

王东明先生：董事。高级经济师。历任北京华远经济建设公司副总经理、加拿大枫叶银行证券公司部门副总经理、华夏证券公司部门总经理、南方证券公司副总裁、中信证券有限责任公司副总经理、总经理，现任中信证券股份有限公司董事长。

张佑君先生：董事。经济学硕士。历任深圳平安保险公司证券部经理、中信实业银行深圳分行证券部经理、中信证券有限责任公司副总经理、长盛基金管理有限公司董事总经理，现任中信证券股份有限公司常务董事、总经理。

明云成先生：董事。高级经济师。历任湖北省黄石市财办副主任、中国人民银行湖北省分行副行长、中国农业银行四川省分行行长、海南省分行行长、中国人民银行湖北省分行行长，现任长江证券有限责任公司董事长兼党委书记。

凤良志先生：董事。博士，高级经济师。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、香港黄山有限公司(安徽省政府驻港窗口公司)董事长、安徽省国元控股(集团)有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长，现任国元证券有限责任公司董事长。

李格平先生：董事。博士研究生在读，高级经济师。历任湖北证券公司董事会秘书、上海业务部副经理、证券发行二部副经理、深圳业务部经理、资产管理部总经理、国际业务部总经理、研究所所长、投资银行总部总经理、长江证券副总裁，现任长江证券有限责任公司董事、总裁。

张宏久先生：独立董事。法学硕士。历任中信律师事务所金融法部主任、中信律师事务所主任，现任北京市竞天公诚律师事务所合伙人。

李扬先生：独立董事。经济学博士，教授，博士生导师。现任中国社会科学院财贸经济研究所副所长、金融研究中心主任、“自然科学和社会科学交叉研究中心”学术委员会委员、太平洋经济合作委员会（PECC）中国金融市场发展委员会委员、中国金融学会常务理事、副秘书长、学术委员会委员、国家外汇管理局外汇政策顾问、中国财政学会常务理事、中国人民银行货币政策委员会货币政策咨询委员会委员。

冼国明先生：独立董事。经济学博士，博士生导师。现任南开大学泰达学院

院长、国际经济研究所所长、跨国公司研究中心主任，南开大学学术委员会秘书长。

徐经长先生：独立董事。博士，博士生导师。现任中国人民大学会计财务理论研究所副所长、国际会计教研室主任、财政部中华会计函授学校教材编审委员会委员、永信现代会计理论研究所研究员、中国会计学会、中国中青年财务成本研究会会员。

2、基金管理人监事会成员：

蔡咏先生：监事。高级经济师。历任安徽省国际经济技术合作公司美国(塞班)分公司财务经理、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、证券总部副总经理、香港黄山有限公司(安徽省政府驻港窗口公司)总经理助理，现任国元证券有限责任公司董事、总裁。

霍津义先生：监事。高级经济师。历任天津开发区计划统计局副局长、天津开发区财政局、国资局局长兼天津开发区地税局局长、天津开发区总公司总会计师、现任天津北方国际信托投资股份有限公司董事长。

么恩正先生：监事。历任天津市证券公司业务部经理助理、中信证券天津管理总部副总经理、中信证券交易室副首席交易员，现任长盛基金管理有限公司总经理助理。

3、本基金基金经理

王茜女士：工商管理硕士，7年金融从业经验。历任武汉市商业银行信贷资金管理部交易员、副经理、总经理助理；现任职于长盛基金管理公司基金管理部，负责债券组合管理，并担任全国社保基金债券委托组合经理助理，具有7年债券投资经验。

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。

邓瑞祥先生，硕士，高级经济师。历任深圳蓝天基金管理公司证券投资部经理助理、信托资产管理一部经理、行政部经理及董事会秘书；大通证券有限责任公司投资部投资总监；现任长盛基金管理有限公司副总经理。

丁楹先生：硕士，历任中信证券交易部总经理助理、经理。现任长盛基金管理有限公司总经理助理、投资部总监兼长盛成长价值开放式基金基金经理。

赵虹女士：硕士，历任天津北方国际信托投资股份有限公司发行部副经理、长盛基金筹备组成员。现任长盛基金管理有限公司研究部总监。

基金经理列席会议。

(四) 基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

(1) 自本基金成立之日起，依据基金契约及有关法律运用本基金资产；

- (2) 依照《暂行办法》、《试点办法》及其它有关规定，代表基金对被投资的上市公司行使股东权利；
- (3) 依据基金契约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基金契约或国家有关法律的规定对基金资产或基金持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，必要时应采取保护措施保护基金投资人的利益；
- (4) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；
- (5) 直接销售基金单位，获取认购（申购）费用；
- (6) 依据基金契约及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- (7) 在基金契约约定的范围内，拒绝或暂停受理基金单位的申购和赎回；
- (8) 依据基金契约的规定获得基金管理费收入；
- (9) 法律法规及基金契约规定的其它权利。

2、基金管理人的义务

- (1) 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- (2) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
- (3) 配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购和赎回业务或委托其它机构代理该项业务；
- (4) 配备足够的专业人员进行基金的登记注册或委托其它机构代理该项业务；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- (6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其它有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人运作基金资产；
- (7) 接受基金托管人的监督；
- (8) 按规定计算并公告基金资产净值及基金单位资产净值；
- (9) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其它有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (10) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》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；
- (11) 依据《基金契约》规定向基金持有人分配收益；
- (12) 按照法律法规和《基金契约》的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回及分红款项；
- (13) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (14) 依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其它有关规定召集基金持有人大会；

- (15) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- (16) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金契约规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- (17) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (19) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，采取适当合理的方式向基金投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；
- (20) 因估值错误导致投资人的损失，属管理人责任的，应承担赔偿责任，并采取适当、合理的方式向投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；
- (22) 法律、法规和《基金契约》规定的其他义务。

(五) 基金管理人承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事以下违反《证券投资基金管理暂行办法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
 - (1) 基金之间相互投资；
 - (2) 基金管理人以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
 - (3) 基金管理人从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其它证券自营业务；
 - (4) 基金管理人从事资金拆借业务；
 - (5) 动用银行信贷资金从事基金投资；
 - (6) 将基金资产用于非法担保、资金拆借或者贷款；
 - (7) 从事证券信用交易；
 - (8) 以基金资产进行房地产投资；
 - (9) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
 - (10) 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；
 - (11) 证券法规规定禁止从事的其它行为。
- 3、基金管理有限公司承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
 - (1) 越权或违规经营；
 - (2) 违反基金契约或托管协议；
 - (3) 故意损害基金持有人或其它基金相关机构的合法权益；
 - (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其它股票投资；
- (9) 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；
- (10) 其它法律、行政法规禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

本基金管理人就诚信问题谨作出以下承诺：

(1) 道德风险、人事管理方面

- 1) 公司现有或未来股东身份完全符合中国相关法律法规的要求，并且无交叉持股现象；
- 2) 公司董事会成员、监事会成员、高级管理人员、各基金经理均具有中国公司法和中国证监会要求的任职资格。加入本公司之前，该等人员均需接受本公司相关程序的检验，保证具有良好的从业道德记录和优秀的职业素养；
- 3) 公司所有员工在加入本公司之前，均应对其既往学术背景和工作经历的真实性负责；
- 4) 公司所有员工没有在其他经营性机构兼职，没有从事与本职工作相关的其他任何以盈利为目的的活动；
- 5) 公司所有员工在任期或者法定限期内，不直接或者以化名、借他人名义持有、买卖股票，也不收受他人赠送的股票；
- 6) 严格遵守我国现行法律法规和本公司制定的投资规章制度，不越权或违规经营；
- 7) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金等的商业秘密。

(2) 基金设立、销售方面

- 1) 所有基金产品的设计均来源于对市场的深刻领悟和科学的研究；
- 2) 所有基金申请法律文件及宣传资料没有虚假记载、相互抵触及误导性陈述和重大遗漏；
- 3) 除非经中国法律允许，基金销售中不以任何形式向投资人保证获利或者承诺最低收益；
- 4) 基金销售中决不向投资人作虚假陈述、欺骗性宣传，误导投资人买卖基金；
- 5) 决不违反法律法规和基金契约、基金招募说明书的规定，向投资人收取额外费用；
- 6) 决不向任何个人或者机构以强制、抽奖等不正当方式销售基金；
- 7) 决不通过基金销售从投资人处获取或者给予投资人与基金销售无关的利益；

- 8) 除基金契约、基金招募说明书规定的情形外，决不拒绝投资人的认购、赎回申请；
- 9) 决不捏造、散布虚假事实，诋毁竞争对手的商业信誉或者损害行业声誉；
- 10) 决不恶意压低基金的服务收费以排挤竞争对手。

(3) 基金投资运作方面

- 1) 按照基金契约的规定运用基金资产投资并管理基金资产；
- 2) 基金之间决不相互投资；
- 3) 本公司决不以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；决不从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其他证券自营业务；决不从事资金拆借业务；决不动用银行信贷资金从事基金投资；决不从事证券信用交易；
- 4) 决不将基金资产用于任何非法担保、资金拆借或者贷款；
- 5) 决不以基金资产进行房地产投资；
- 6) 决不从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7) 决不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；中国证监会规定禁止从事的其他行为；
- 8) 及时、足额向基金持有人支付基金收益；
- 9) 各项投资的比例均完全符合中国证监会的要求和本公司规章制度的要求；
- 10) 决不从事对倒、对敲、坐庄或任何有可能引致证券市场信息失真、损害本公司旗下基金持有人或其他投资人利益的活动。

(4) 信息披露方面

- 1) 保证及时、准确、完整地披露证监会要求披露的各项信息；
- 2) 正确、及时地回答基金持有人的各项提问、咨询；
- 3) 与媒体保持良好的沟通关系，及时披露相关信息。

(5) 其它

- 1) 公司使用的软件均为正版，保证信息技术的安全性；
- 2) 严格按照中国证监会的要求，与基金托管人保持正常的工作关系，切实保护基金持有人的利益；
- 3) 坚决接受、配合中国证监会和其他相关政府部门的检查、监督。

5、基金经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和基金契约的规定，本着谨慎的原则为基金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。

（六）基金管理人的更换

1、基金管理人的更换：

有下列情形之一的, 经中国证监会批准, 可更换基金管理人：

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

2、基金管理人的更换程序为：

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

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

八、基金管理人的风险管理和内部控制制度

（一）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。

（二）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员。督察员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，主要负责公司日常运营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帐簿建立、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员，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。公司的督察员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。

（三）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。

九、基金托管

(一) 基金托管人基本情况

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

中国农业银行目前在国内设有 37 家分行，44418 个分支机构和储蓄网点，是我国营业网点最多、机构覆盖面最广的金融机构。开通了全国专用数据通信网，拥有先进的银行清算系统和安全、高效的清算、交割能力。

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，内设核算管理处、运行处、监督处、市场开发处、客户服务处、综合管理处，并在北京、上海、深圳设有托管分部，总部员工 48 名。

(二) 主要人员情况：

杨明生：中国农业银行副行长（主持工作），48 岁，硕士，高级经济师，历任中国农业银行沈阳市分行副行长，中国农业银行天津市分行行长。现任中国农业银行党委副书记、副行长。

罗熹：主管基金托管业务行长助理，43 岁，硕士，高级经济师，历任中国农业银行资产保全部总经理、资产风险监管部总经理、国际业务部总经理。现任中国农业银行行长助理兼总行国际业务部总经理。

郭辉：基金托管部总经理，44 岁，博士，高级经济师，曾任中国长城信托投资公司总经理助理、副总经理。

(三) 基金托管人的更换

1、更换托管人的条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国人民银行批准，更换基金托管人：

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

2、基金托管人的更换程序：

- (1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名；

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

(四) 基金托管人禁止行为

基金托管人按照《暂行办法》、基金契约及其它有关规定以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产和监督基金管理人的运作，不为自己或任何第三人谋取利益。基金托管人不从事以下行为：

- 1、 从事基金投资；
- 2、 挪用本基金资产；
- 3、 在本基金信息公开披露前，向他人泄露有关信息。

(五) 基金托管人受处罚情况

最近三年内基金托管人及其负责基金托管业务的高级管理人员未受到中国证监会、中国人民银行及工商、财税及其它有关机关的处罚。

(六) 基金托管人的权利与义务

1、 基金托管人的权利

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

2、 基金托管人的义务

- (1) 依法持有基金资产；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并保管基金资产；
- (3) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (5) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；

- (6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- (7) 以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户, 负责基金投资于证券的清算交割, 执行基金管理人的投资指令, 并负责办理基金名下的资金往来;
- (8) 保守基金商业秘密, 除《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前予以保密, 不得向他人泄露;
- (9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值;
- (10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告, 并报中国证监会和中国人民银行;
- (11) 采取适当、合理的措施, 使开放式基金单位的认购、申购和赎回等事项符合基金契约等有关法律文件的规定;
- (12) 采取适当、合理的措施, 使基金管理人用以计算开放式基金单位认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金契约等法律文件的规定;
- (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契约等法律文件的规定;
- (14) 在定期报告内出具基金托管人意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金契约的规定进行; 如果基金管理人未执行基金契约规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- (15) 建立并保存基金持有人名册;
- (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向基金持有人支付基金收益和赎回款项;
- (19) 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;
- (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人民银行, 并通知基金管理人;
- (21) 因过错导致基金资产的损失时, 应承担赔偿责任, 其过错责任不因其退任而免除;
- (22) 基金管理人因过错造成基金资产损失时, 应代表基金向基金管理人追偿;
- (23) 法律、法规和《基金契约》规定的其他义务。

十、基金的投资

(一) 投资目标

本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产的当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。

(二) 投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市或拟上市各类债券、股票及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金，本基金主要投资于各类债券品种，品种主要包括：国债、金融债、企业债与可转换债券。本基金对目标指数的投资在资产配置中的比例最低为64%，股票投资在资产配置中的比例不超过16%。

(三) 投资理念

基于对债券市场参与者长期利率预期能力和现有市场结构的认识，本基金管理人的投资理念是“以指数化投资为基础，通过一定程度低风险的积极性投资，结合对投资组合的动态管理，实现基金资产的长期增值”。

1、以指数化投资方式为基础是基于对市场参与者难以长期对利率趋势做出准确预测的认识。

大量事实证明，任何债券市场参与者均难以具有超常的利率预测能力，都不可能利率走势长期做出足够肯定和精确预测，从而获取超常的投资收益。另外，我们认为随着我国债券市场的发展与完善，现存的市场分割局面及结构性失衡问题将得以改善与解决，市场效率将不断提高。因此，为了确保基金长期稳定增值，我们将运用紧盯目标指数久期的指数化投资方式进行组合投资管理。

2、中信全债指数能够直接、比较真实地刻划债券市场走势。

中信全债指数是一个全面反映整个债券市场的综合性权威债券指数。针对我国债券市场，尤其是银行间债券市场流动性不足的问题，中信全债指数没有包含所有在银行间债券市场上市交易的品种，而是选择了部分交投比较活跃的银行间债券品种作为样本券，这样一方面能够敏锐、直接、全面地反映市场对利率的预期及市场的走势，另一方面，也便于基金管理人指数样本的有效跟踪。

3、基于债券市场现存的结构性问题，我们将采用指数化的增强性投资。

现阶段的债券市场作为一个新兴市场，存在一些结构性问题，主要表现在利率期限结构难以体现风险补偿、相似期限债券品种存在较大的收益率差异和不同市场收益率水平的差异。债券市场现存的结构性问题，既对基金管理人提出了在指数化投资的基础上进行低风险的积极性管理的要求，也为基金管理人提供了一定程度积极性管理的机会。

本基金的指数化增强性投资主要体现在债券资产一定程度上的主动性管理和在限定比例内的股票资产配置上。随着债券市场的发展和有效性的提高，

本基金指数化的增强性程度将相应降低。

4、动态资产管理是确保投资目标实现的关键。

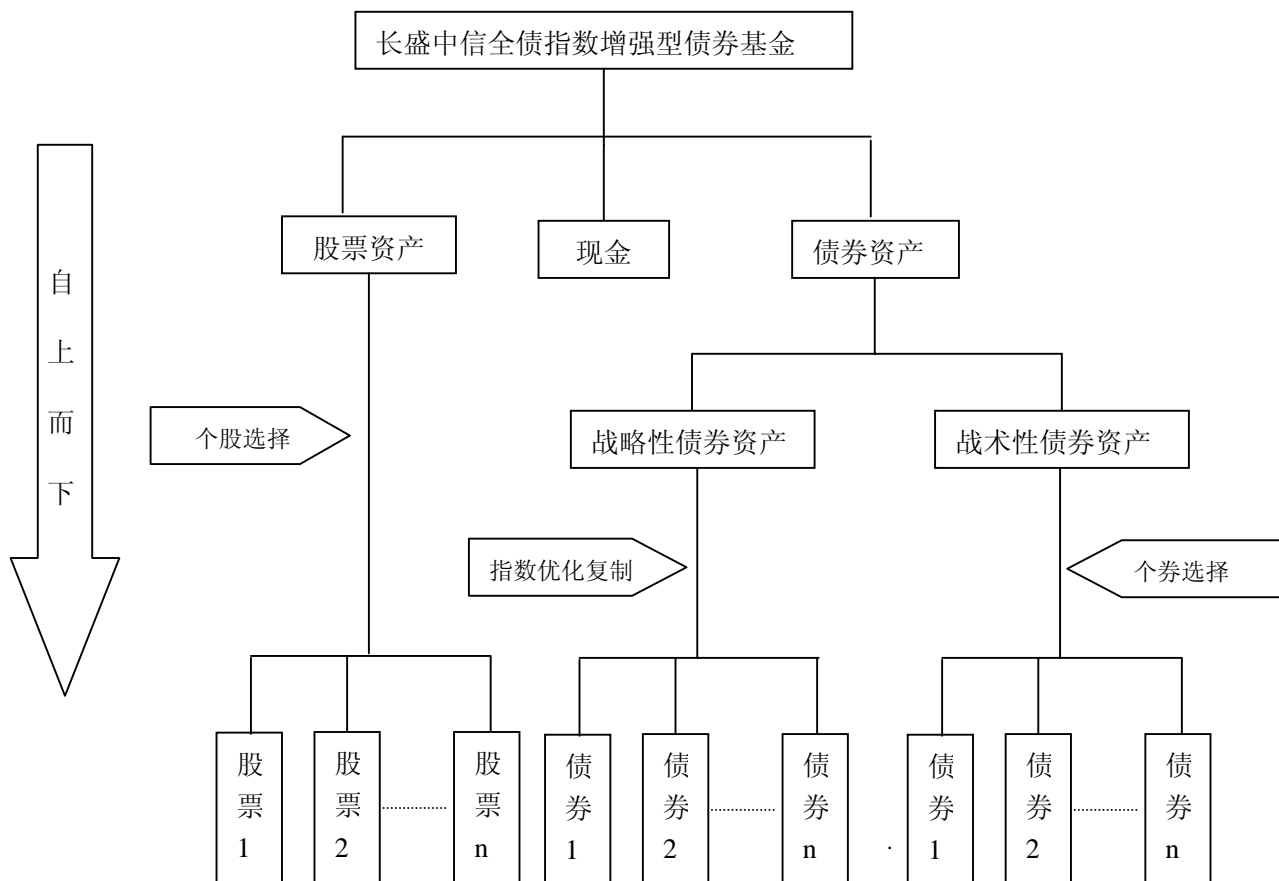
本基金管理人将基于对未来一定时期内宏观经济和市场形势的分析，兼顾投资者对基金份额的申购、赎回需求，高度重视动态资产配置，及时调整投资组合中债券、股票和现金等资产类别间的比例分布，以实现在流动性约束下资产配置效率的最佳状态。同时，对债券投资组合久期与目标指数久期偏离度的动态跟踪与监控，适时相应调整类属资产及个券，有效控制风险，并获得超越目标指数收益。

(四) 投资策略

本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益。

1、在对宏观经济形势和证券市场走势进行科学分析的基础上，自上而下进行资产配置。

本基金将重点关注经济增长率、工业总产值增长率、产品产销率、外贸进出口额、物价指数等宏观经济指标，通过对宏观经济形势、财政政策及货币政策的深入分析，对未来经济走势、投资环境变化及利率走势做出科学、合理地判断，并在此基础上采用“自上而下”的资产配置策略，首先确定基金资产在债券、股票和现金资产之间的配置，再确定债券资产中战略性与战术性债券资产间的配置比例，最后按照不同方法具体构建债券、股票投资组合。



2、运用指数化的增强性投资策略，获得超过目标指数的收益水平。

在指数化投资的基础上，针对债券市场当前存在的结构性失衡，通过控制债券投资组合久期与指数久期有限度偏离，运用收益率差异策略、资产选择策略等积极资产组合管理策略，依据总收益分析实现对各类属资产的合理配置。

同时，遵循稳健投资原则，积极参与股票增发，并运用投资组合保险策略适当进行股票投资，提高组合的整体收益。

3、充分利用市场无风险套利机会，适当运用杠杆原理，有效提高投资组合的收益水平。

本基金还将充分利用以下无风险套利机会提高资产盈利水平：

(1)利用同一债券品种在不同债券市场上的价格差异，通过无风险套利操作获得由于市场分割带来的超额收益；

(2)利用同期限债券回购品种在不同市场上的利率差异，通过开展无风险套利操作，提高投资组合的盈利能力；

(3)利用同期限债券品种在一、二级市场上的收益率差异，通过投资品种的转换获得一、二级市场的差价收入；

(4)通过债券回购所获得的资金参与新股申购和新股配售，获得稳定的股票一级市场收益；

(5)随着未来利率期货、利率期权、利率互换等可以有效规避利率风险金融衍生产品的推出，在主管机关批准后积极开展套利操作。

此外，多层次的风险监控体系和组合动态调整机制将确保各种积极投资策略和无风险套利操作的有效实施和执行。

(五)投资决策与流程

1、研究过程

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

2、决策机制与决策过程

(1)决策依据

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

(2)决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的报告对基金的资产配置及指数化的增强性投资下达指导性意见，

基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责；

3、投资组合的构建

投资组合的构建是“自上而下”进行债券、股票、现金配置与“自下而上”进行个券、个股选择相结合的过程。

A、债券投资组合的构建。

在债券投资方面，本基金将债券资产配置分为战略性资产和战术性资产两部分。

战略性资产配置体现指数化投资原则，将以中信全债指数样本券为基础，通过保持投资组合久期与目标指数久期有限度的偏离(偏离度5%)，实现对目标指数的优化复制。战略性债券资产配置的最低比例为基金净资产的64%。随着债券市场有效性的提高，战略性债券资产配置的比重可适度增加。

战术性资产配置体现指数化的增强性投资，其投资品种不受指数样本库的限制，组合久期管理不受目标指数的限制，但受整个组合久期的限制。战术性资产投资于因投资主体偏好、流动性需求差别及市场分割而凸显投资价值的流动性较好的债券，是一个“自下而上”进行个券选择的过程。战术性债券资产最多可通过回购放大1倍操作。

	久期偏离下限	久期偏离上限
战略性债券资产	目标指数久期的 95%	目标指数久期的 105%
战术性债券资产	/	/
债券资产组合	目标指数久期的 80%	目标指数久期的 130%

本基金对战略性债券资产和战术性债券资产实行“分户经营，统一管理”。

B：股票投资组合的构建。

本基金的股票投资作为债券投资的有益补充，可以提高投资组合收益并适当分散风险。本基金主要参与新股认购和股票增发，并将适当投资于行业地位领先、业绩优良、有持续分红记录的大盘价值股。其中：通过新股认购所获的不符合个股选择标准的股票，本基金将在该股票上市后1个月内卖出；本基金投资的大盘价值股全部来自于公司建立的股票池。

股票投资组合的构建过程是自下而上进行个股选择的过程。

本基金投资组合的构建应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于债券、股票的比例，不低于本基金资产总值的80%；
- (2) 本基金投资于目标指数的比例不低于本基金资产净值的64%，其中投资于国债的比例不低于本基金资产净值的20%；
- (3) 本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%。

(4) 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%，并按有关规定履行信息披露义务；

(5) 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期，且债券回购融入的资金余额不得超过基金净资产的40%。

(6) 中国证监会规定的其它比例限制。

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

4、交易过程

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

5、投资组合调整过程

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

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

(六) 证券选择标准

1、个券选择标准

本基金在进行指数化的增强性投资时，其个券选择主要标准如下：

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

2、个股选择标准

- (1) 公司发展战略清晰，管理科学稳健，处于行业领先地位；
- (2) 业绩优良，有持续分红记录；
- (3) 流通市值大于市场平均水平且市净率较低的股票
- (4) 其他价值被低估的股票。

(七) 业绩比较基准

本基金为增强性指数化债券型投资基金，对目标指数的投资在资产配置中最低比例为64%，股票资产配置最高比例为16%，现金持有最低比例为3%。由于本基金主要投资于债券，股票投资是作为增强型投资提高收益的一种手段，预计股票投资比例的平均值为8%，因此将基金业绩比较设定为：

基金业绩比较基准=中信全债指数收益率×92%+中信综合指数收益率×8%。

目前投资人可以通过登录中信证券研究网(网址：www.citicindex.com)获取

中信全债指数和中信综合指数的相关信息。如果中信指数体系信息发布渠道增加，本基金管理人将另行公告。

(八) 投资限制

为维护基金持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、动用银行信贷资金从事证券买卖；
- 4、将基金资产用于非法担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、以基金资产进行房地产投资；
- 7、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 8、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
- 9、违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格；
- 10、进行内幕交易、利益输送等损害基金持有人利益的行为；
- 11、通过股票投资取得对上市公司的控制权；
- 12、因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他持有 5%以上投票权的股东恶意串通，致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法权益；
- 13、证券法规规定禁止从事的其他行为。

(九) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

十一、风险揭示

本基金面临与其他开放式基金相同的风险（例如市场风险、管理风险、流动性风险、技术风险等），但由于本基金是实行指数化增强性投资的开放式基金，上述风险在本基金中存在一定的特殊性。

（一）跟踪指数的被动投资风险

被动跟踪指数的风险主要表现在三个方面：指数下跌风险，即在市场下跌的情况下由于本基金被动地跟踪指数而对基金净值造成损失的不确定性；跟踪偏离风险，即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与目标指数表现之

间产生差异的不确定性；目标指数风险，即目标指数因为编制方法的不同或自身的不合理性等原因，可能导致目标指数表现与市场的综合指数表现之间产生差异的不确定性，以及目标指数调整给基金投资带来的管理成本和投资成本提高的风险。比较而言，指数下跌风险和目标指数风险是指数基金本身固有的风险，而跟踪偏离风险是相对可控的风险，它主要受到交易成本、市场流动性风险和基金管理人的管理能力、样本券调整等因素的影响，具体表述如下：

（1）本基金在跟踪指数过程中，由于买入和卖出证券时均存在交易成本，例如交易佣金、经手费、证管费、过户费等，导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离。

（2）受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标指数的样本债券，或在面临投资者赎回时，无法以赎回价格将债券及时地转化为现金。这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险。

（3）在本基金实行指数化投资过程中，管理人对指数基金的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对目标指数的跟踪程度。

（4）在跟踪中信全债指数的过程中，由于中信全债指数样本券可能出现调整，本基金在被动调整过程中也可能产生一定的跟踪偏离风险。

（5）中信全债指数本身的合理性有待市场检验。中信全债指数可能存在的不合理性会导致其不能很好地代表市场整体。随着中国市场的进一步发展和完善，未来如果有更合理、更能代表中国债券市场走势的债券指数推出时，本基金可能会通过召开持有人大会的方式，决定是否更换标的指数。

（二）增强性投资的积极投资风险

增强性积极投资的风险主要体现为基金经理为了获得超越指数的投资回报而通过采用积极投资的手段增加投资组合的风险度。但由于在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平，既可能高于指数收益，也可能低于指数收益：在债券投资组合久期偏离指数久期的情况下，基金管理人对利率走势的判断与市场真实走势会出现差异，可能造成基金收益低于指数收益；即使债券投资组合久期与指数久期基本一致，如果基金对长、中、短期债券的持有结构与指数存在差异，当债券收益率曲线出现非平行移动时，则由于长、中、短期债券的相对价格变化幅度不同，可能造成基金收益低于指数收益；如果债券投资组合中不同类属资产的权重与指数存在差异，则当类属资产间的收益率差异发生变化，可能造成基金收益低于指数收益；基金管理人调整债券整体投资比例，如通过回购进行杠杆操作时，可能由于自身判断与市场走势存在差异，而造成基金收益低于指数收益；此外，股票投资作为指数化投资的增强性体现，当

股票投资收益低于目标指数收益时，也会造成基金收益低于指数收益。

因此，本基金的积极投资风险具体可能由下列投资方式产生：对一些指数样本券的投资权重进行适当调整，选择其它债券对指数样本券进行替代，调节债券投资的仓位以及进行比例限制内的股票投资等。

（三）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，主要存在以下几种风险：

（1）政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致证券市场波动而影响基金收益，产生风险。

（2）利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

（3）经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，各个行业及上市公司的盈利水平也呈周期性变化，从而影响到个股乃至整个行业板块的二级市场走势。

（4）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如经营决策、技术更新、新产品研究开发、高级专业人才流动等风险。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

（5）国际竞争风险。随着中国开放程度的提高，上市公司的发展必然也受到发达国家同类技术及同类产品进入中国市场的影响。尤其是中国加入 WTO（世界贸易组织），市场开放程度加大之后，中国境内公司必然面临国际竞争风险。

（6）购买力风险。基金持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

（7）信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

（8）债券收益率曲线风险。债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

（9）再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率

（四）流动性风险

本基金面临的流动性风险主要表现在几个方面：基金资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险；指数中个别

样本券存在流动性风险。这些风险的主要形成原因是：

(1) 市场流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，本基金的建仓或变现都有可能因流动性问题而抬高或压低指数，从而增加建仓成本或变现成本，对本基金的资产净值造成不利影响。

(2) 大额赎回导致流动性风险。由于本基金是开放式基金，基金规模将随着投资者对基金单位的申购与赎回而不断变化，若是由于投资者的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

(3) 指数中样本券之间流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于样本券的流动性高低存在差异，即使是在市场流动性比较好的情况下，一些样本券的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得本基金在以指数权重为基础进行操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对债券价格产生比较大的影响，增加建仓成本或变现成本。

(五) 管理风险

本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素，而影响基金收益水平。

(六) 技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限计算并显示净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

(七) 操作风险

在投资流程的各个环节中，由于制度建设、人员配备或内控机制的不完善或相关业务人员违反操作规程而产生的风险。如：交易差错、系统运行故障等。

(八) 巨额赎回风险

若因市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资者在赎回基金单位时，可能会遇到部分顺延赎回情况或暂停赎回等风险。

(九) 其他风险

(1) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险；

(2) 证券市场、基金管理人及基金销售代理人可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

(3) 其他意外导致的风险。

十二、费用概览

(一) 基金运营过程中，从基金资产中支付的费用

1、费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金信息披露费用；
- (5) 基金持有人大会费用；
- (6) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金分红手续费；
- (8) 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0.75%年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

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。

为充分维护持有人利益，本管理人承诺，在本基金成立满一年后，经基金托管人核对，如当日累计单位资产净值低于基金单位面值，基金管理人将从下一日开始暂停收取基金管理费，直至累计单位资产净值不低于基金单位面值。在当日累计单位资产净值低于基金单位面值期间，如遇法定节假日，同样暂停收取本基金管理费。

(2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计算。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

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

3、不列入基金费用的项目

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

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

(二) 申购和赎回费用

1、投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。申购费用由申购人承担,不列入基金资产。

2、投资者选择交纳前端申购费用时,申购费率为不超过申购金额的1.5%。

3、投资者选择交纳后端申购费用时,申购费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有时间	后端申购费率
1年以内	1.5%
满1年不满2年	1.2%
满2年不满3年	0.9%
满3年不满4年	0.6%
满4年不满5年	0.3%
满5年以后	0.05%

4、本基金赎回费率按持有期递减,最高不超过赎回金额的0.3%,赎回费由赎回人承担。赎回费率表如下:

持有期	赎回费率
一年以内	0.3%
满一年不满两年	0.2%
满两年不满三年	0.1%
满三年后	0.05%

持有期满三年后,赎回费率仅收取登记注册人的登记注册费0.05%,全部作为登记注册费用,在此之前的赎回费用的70%作为登记注册费用和基本手续费,其余30%归入基金资产。

5、基金管理人对部分基金投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

6、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公开说明书中列示。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。

申购份额和赎回金额的计算公式及示例见第十八章。

十三、基金资产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金资产的账户

本基金资产以“长盛中信全债指数增强型债券投资基金”的名义开立基金专用资金账户、证券账户，与基金管理人、基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户严格分开、相互独立。

（四）基金资产的保管和处分

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

十四、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的价值，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单位净值，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、任何上市流通的股票，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。估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

(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、证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。

5、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价计算得到的净价估值。

6、在任何情况下，基金管理人如采用本款第 1-5 项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本款第 1-5 项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、银行间债券市场债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑市场成交价、报价、收益率曲线、成本价等因素确定的反映公允价值的价格估值。

8、未上市债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

9、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

基金日常估值由基金管理人进行，用于公开披露的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《基金契约》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市场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、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、法律法规和中国证监会规定的其它情形。

(七) 基金单位净值估值错误的处理方式

基金单位资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。当基金资产的估值导致基金单位资产净值小数点后四位以内发生差错时，视为基金单位资产估值错误。

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。当发生估值错误时，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，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

因基金单位净值错误给投资人造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任，赔偿原则如下：

1、赔偿仅限于因差错而导致的基金持有人的直接损失，基金管理人在赔偿基金资产或基金持有人后，有权向有关责任方追偿不当得利。

2、计算的基金单位资产净值低于正确的基金单位资产净值时的处理：

(1) 申购确认份额大于实际应确认份额，由基金管理人向投资者追偿少付的申购金额，不能追偿的由基金管理人承担；

(2) 赎回确认金额小于实际应确认金额，不足部分由基金管理人赔付给投资者。

3、计算的基金单位资产净值高于正确的基金单位资产净值时的处理：

(1) 申购确认份额小于实际应确认份额，少计基金份额部分的申购资金由基金管理人退还给投资者；

(2) 赎回确认金额大于实际应确认金额，多付部分由基金管理人赔付给基金资产。

4、基金管理人代表基金保留要求返还不当利得的权利。

5、基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成10元人民币以上的损失。

(八) 特殊情形的处理

1、如遇国家颁布的有关基金会计制度的变化所造成的误差，不作为基金单位净值错误处理。

2、基金管理人按(四)估值方法第6、7、8条进行估值时，所造成的误差不作为基金单位净值错误处理。

3、由于证券交易市场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。但基金管理人与基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十五、基金税收

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

十六、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、 基金持有人可以选择取得现金红利或将所获红利按分红除权日的基金单位净值自动转为基金单位进行再投资，除非基金持有人成功办理了选择取得现金红利的方式，否则其持有本基金基金单位的默认分红方式为红利再投资。红利再投资免收手续费，并不受最低申购金额限制；
- 2、 每一基金单位享有同等分配权；
- 3、 基金收益分配比例按有关规定制定；
- 4、 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 5、 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 6、 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
- 7、 基金收益分配后基金单位资产净值不能低于面值；
- 8、 法律法规以及中国证监会的其它规定。

（四）收益分配方案

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

（五）收益分配方案的确定与公告

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

（六）收益分配中发生的费用

- 1、 收益分配采用红利再投资方式免收申购费用；
- 2、 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金持有人自行承担。若投资者的现金红利不足以支付银行转帐或其它费用，基金登记注册人将投资者的现金红利按分红实施日的基金单位净值自动转为基金单位，不足 0.01 份基金单位的，四舍五入。

十七、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

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

（二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请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。

十八、基金的申购与赎回

（一）基金投资人范围

中华人民共和国境内的个人投资人和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）。

（二）日常申购与赎回的场所

- 1、长盛基金管理有限公司直销中心；
- 2、中国农业银行、交通银行、中信实业银行、深圳发展银行、中信证券股份有限公司、华夏证券有限公司、长江证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、国泰君安股份有限公司、海通证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、天同证券有限责任公司、广发证券股份有限公司办理本基金销售的营业网点。

本公司直销中心及代销机构营业网点信息详见发行公告。基金管理人有权增加符合条件的销售代理人，并另行公告。条件成熟时，投资者可通过基金管理

人或者指定的基金销售代理人以电话或互联网等形式进行申购与赎回。

（三）申购与赎回的开放日期及时间

1、申购与赎回的开始时间

基金的日常申购、赎回自本基金成立日后不超过三十个工作日开始办理。在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

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

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

（四）申购与赎回的原则

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

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

5、申购费用按单笔申购申请金额对应的费率乘以单笔确认的申购金额计算；

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

（五）日常申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售代理人规定，在开放日的交易时间段内提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。基金持有人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）及登记注册机构必须有足够的基金单位余额。否则会因所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2工作日及之后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 个工作日后可以赎回。

3、申购和赎回款项支付

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

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

(六) 日常申购与赎回的数额和价格

1、申请申购基金的金额

(1) 单笔最低申购金额为1,000元人民币（含申购费）。

投资者选择当期分配的基金收益自动转为基金单位时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。但法律法规、中国证监会另有规定的除外。

(2) 申请赎回基金的份额

赎回按份额进行，申请赎回的份额为大于0的任意份额。

(3) 基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的程序和数额限制，但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

2、申购和赎回费用

(1) 投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

(2) 投资者选择交纳前端申购费用时，申购费率为不超过申购金额的1.5%。

(3) 投资者选择交纳后端申购费用时，申购费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	后端申购费率
1年以内	1.5%
满1年不满2年	1.2%
满2年不满3年	0.9%
满3年不满4年	0.6%
满4年不满5年	0.3%
满5年以后	0.05%

(4) 本基金赎回费率按持有期递减，最高不超过赎回金额的0.3%，赎回费

率表如下：

持有期	赎回费率
一年以内	0.3%
满一年不满两年	0.2%
满两年不满三年	0.1%
满三年后	0.05%

(5) 基金管理人对部分基金投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

(6) 基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，调整后的申购费率、赎回费率和收费方式在公开说明书中列示。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。

3、申购份数与赎回金额的计算方式

(1) 申购份数的计算

如果投资者选择交纳前端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

$$\text{前端申购费用} = \text{申购金额} \times \text{前端申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{前端申购费用}$$

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{T日基金单位净值}$$

如果投资者选择交纳后端申购费用，则申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购份数} = \text{申购金额} / \text{T日基金单位净值}$$

基金单位份数以四舍五入的方法保留小数点后两位。

例二：假定T日的基金单位净值为1.2000元，申购金额为10,000元，如果投资者选择交纳前端申购费用，需负担的申购费用和获得的基金份额计算如下：

$$\text{前端申购费用} = 10,000 \times 1.5\% = 150 \text{元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,000 - 150 = 9,850 \text{元}$$

$$\text{申购份数} = 9,850 / 1.2000 = 8,208.33 \text{份}$$

如果该投资者选择交纳后端申购费用，可获得的基金份额计算如下：

$$\text{申购份数} = 10,000 / 1.2000 = 8,333.33 \text{份}$$

(2) 赎回金额的计算

如果投资者在申购时选择交纳前端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T日基金单位净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

如果投资者在申购时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T日基金单位净值}$$

后端申购费用=赎回份数×申购日基金单位净值×后端申购费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端申购费用-赎回费用

例三：假定某持有人分别在一年内、满一年后、满两年后、满三年后赎回10,000份，赎回当日的基金单位资产净值分别为1.0810、1.1550、1.2150、1.3150，其在申购时已交纳前端申购费用，各笔赎回扣除的赎回费用和获得的赎回金额计算如下：

	赎回 1 1 年内	赎回 2 1 年后	赎回 3 2 年后	赎回 3 3 年后
赎回份数 (A)	10,000.00	10,000.00	10,000.00	10,000.00
赎回日基金单位净值 (B)	1.0810	1.1550	1.2150	1.3150
赎回总额 (C=A×B)	10,810.00	11,550.00	12,150.00	13,150.00
赎回费率 (D)	0.3%	0.2%	0.1%	0.05%
赎回费用 (E=C×D)	32.43	23.10	12.15	6.58
赎回金额 (F=C-E)	10,777.57	11,526.90	12,137.85	13,143.43

例四：假定某投资人申购本基金单位当日的基金单位净值为1.2000元，该投资人选择交纳后端申购费用，并分别在半年后、一年半后和两年半后赎回10,000份，赎回当日的基金单位资产净值分别为1.0810、1.1550、1.2150、1.3150，各笔赎回扣除的后端申购费用、赎回费用及获得的赎回金额计算如下：

	赎回 1 1 年内	赎回 2 1 年后	赎回 3 2 年后	赎回 4 3 年后
赎回份数 (A)	10,000.00	10,000.00	10,000.00	10,000.00
申购日单位资产净值 (B)	1.2000	1.2000	1.2000	1.2000
赎回日单位净值 (C)	1.0810	1.1550	1.2150	1.3150
赎回总额 (D=A×C)	10,810.00	11,550.00	12,150.00	13,150.00
后端申购费率 (E)	1.5%	1.2%	0.9%	0.6%
后端申购费用 (F=A×B×E)	180.00	144.00	108.00	72.00
赎回费率 (G)	0.3%	0.2%	0.1%	0.05%
赎回费用 (H=D×G)	32.43	23.10	12.15	6.58
赎回金额 (I=D-F-H)	10,597.57	11,382.90	12,029.85	13,071.43

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

(4) 单位资产净值的计算公式：

基金单位资产净值=当日基金资产净值/当日基金总份额

(七) 拒绝或暂停申购与赎回的情况

1、拒绝或暂停申购的情形与处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请：

- (1) 基金资产规模过大，使基金管理人认为继续扩大基金规模会影响基金投资业绩，从而损害现有基金持有人的利益；
- (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、基金销售代理人和登记注册人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。

2、拒绝或暂停赎回的情形及处理方式

除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资人的赎回申请：

- (1) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- (2) 因市场剧烈波动或其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、基金销售代理人和登记注册人的一方或多方技术系统出现故障导致无法正常进行工作；
- (4) 因不可抗力事件导致基金无法正常运作或基金的赎回无法进行；
- (5) 法律、法规、规章允许的其它情形或其它在《基金契约》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

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

(八) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的情形及处理方式

(1) 巨额赎回的认定

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

(2) 巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时,基金管理人将根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

- 1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力兑付投资人的赎回申请时,将按正常赎回程序处理投资人赎回申请。
- 2) 部分延期赎回:当基金管理人认为没有能力全部兑付投资人的赎回申请或全部兑付投资人的赎回申请可能对基金的资产净值造成较大波动时,基金管理人在不低于上一日基金总份额的 10%,按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;未受理部分可延迟至第二开放日办理,并以第二开放日的基金单位资产净值为依据计算赎回金额,直至将申请赎回份额全部赎回为止。投资人在申请赎回时有权对当日未获受理部分份额选择延迟赎回或放弃延迟赎回。
- 3) 巨额赎回的公告:当发生巨额赎回并延期支付时,基金管理人应通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点在 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

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

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

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

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

十九、基金的非交易过户、转托管与冻结

（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、继承是指基金持有人死亡，其持有的基金单位由其合法的继承人或受赠人继承。

2、捐赠仅指基金持有人将其合法持有的基金单位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）冻结

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。基金单位的冻结手续、冻结方式按照基金登记注册人的相关规定办理。

二十、基金的登记注册

（一）委托与更换程序

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

注册与登记过户代理人的更换程序如下：

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

(二) 基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的注册与登记过户业务。

(三) 基金登记注册人概况

基金登记注册人：中国证券登记结算有限责任公司

法定代表人：陈耀先

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

营业期限：长期

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

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

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

公司经营范围：

- 1、 证券账户和结算账户的设立和管理；
- 2、 证券登记与过户；
- 3、 证券托管与转托管；

- 4、 证券和资金的清算与交收；
- 5、 受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- 6、 中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

二十一、基金持有人

（一）基金持有人的权利和义务

1、基金持有人的权利

- （1） 取得基金收益；
- （2） 出席或者委派代表出席基金持有人大会，并行使表决权；
- （3） 监督基金运作状况，获取基金业务及财务状况的资料；
- （4） 申购、赎回及其他对基金单位处分的权利，并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金单位；
- （5） 因基金管理人、托管人、销售机构、登记注册机构的错误导致基金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《基金契约》规定的其他权利。

每份基金单位具有同等的合法权益。

2、基金持有人的义务

- （1） 遵守《基金契约》；
- （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持有人利益的活动；
- （5） 法律、法规和《基金契约》规定的其他义务。

（二）持有人大会

1、召开事由

有以下情形之一的，召开基金持有人大会

- （1） 修改《基金契约》；
- （2） 决定终止基金；
- （3） 更换基金托管人；
- （4） 更换基金管理人；
- （5） 与其他基金合并；
- （6） 中国证监会规定的其他事项；
- （7） 法律法规及基金契约规定的其他事项。

2、召集方式

(1) 在正常情况下，基金持有人大会由基金管理人召集，基金持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定；

(2) 在更换基金管理人、审议与基金管理人利益冲突的事项或基金管理人无法行使召集权的情况下，由基金托管人召集；

(3) 单独或合计持有权益登记日基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金持有人有权提请基金管理人或基金托管人召集基金持有人大会；在基金管理人和基金托管人均未按规定召集或者不能行使召集权的情况下，单独或合计持有权益登记日基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金持有人有权自行召集。

3、通知

召开基金持有人大会，召集人必须于会议召开前 20 天在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金持有人大会通知必须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 权益登记日；
- (4) 投票委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由大会召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

4、出席方式

本基金持有人大会的召开方式由召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金持有人大会。

(1) 现场开会。由基金持有人本人出席或以授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金持有人大会议程：

- 1) 到会人数不少于 10 人；
- 2) 亲自出席会议的基金持有人与受托出席会议者所代表的基金持有人合计不少于 100 人；
- 3) 亲自出席会议者持有基金单位的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金单位的凭证及委托人的代理投票授权委托书均符合有关法律法规、本基金契约和会议通知的规定；

4) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金单位的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 25%。

现场开会未能符合上述条件，但同时符合以下条件时，也可以进行基金持有

人大会议程：

1) 到会人数不少于 7 人，其中持有 50 万份以下基金单位的持有人或其授权代表不少于 3 人；

2) 亲自出席会议者持有基金单位的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金单位的凭证及委托人的代理投票授权委托书均符合法律、法规、本基金契约和会议通知的规定；

3) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金单位的凭证显示，全部有效的凭证所对应的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 30%。

(2) 通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 大会召集人按本基金契约规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 大会召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金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持有人不少于 100 人，并且所有出具有效书面意见所代表的基金持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 25%；或者基金持有人少于 100 人，而其所出具有效书面意见所代表的基金持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 30%；

4) 直接出具书面意见的基金持有人或受托代表基金持有人出具书面意见的代理人，提交的持有基金单位的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金单位的凭证及委托人的代理投票授权委托书均符合法律、法规、本基金契约和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述现场开会或通讯方式开会的条件，则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为 10 天，但确定有权出席会议的基金持有人资格的权益登记日不应发生变化。

属于以现场开会方式再次召集基金持有人大会的，必须同时符合以下条件：

1) 到会人数不少于 5 人；

2) 亲自出席会议者持有基金单位的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金单位的凭证及委托人的代理投票授权委托书均符合法律、法规、本基金契约和会议通知的规定；

3) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有的基金单位凭证显示，全

部有效的凭证所对应的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的20%。

属于以通讯表决方式再次召集基金持有人大会的，必须符合以下条件：

1) 大会召集人按本基金契约规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 大会召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金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持有人不少于 50 人，并且所有出具有效书面意见所代表的基金持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 20%；或者基金持有人少于 50 人，并且所有出具有效书面意见所代表的基金持有人所持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 25%；

4) 直接出具书面意见的基金持有人或受托代表基金持有人出具书面意见的代理人，提交的持有基金单位的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金单位的凭证及委托人的代理投票授权委托书均符合法律、法规、本基金契约和会议通知的规定；

5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容

议事内容为关系基金持有人利益的重大事项，如修改基金契约、决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并以及法律法规及基金契约规定的其他事项。

基金持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。基金持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金持有人大会召开日前 10 天公告，否则会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 或以上的基金持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 15 天提交召集人。召集人对于基金管理人、基金托管人和基金持有人提交的临时提案应当在大会召开日前 10 天公告。

召集人负责对提案进行审议，如果提案所涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律、法规和基金契约规定的基金持有人大会职权范围的，则可以提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金持有人大会审议。如果召集人决定不将基金持有人提案提交大会表决，应当在该次基金持有人大会上解释和说

明。

召集人可以对基金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持有人大会作出决定，并按照基金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下列第（八）款规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均无法主持大会，则由出席大会的基金持有人以所代表的基金份额 50% 以上多数（不含 50%）选举产生一名基金持有人作为该次基金持有人大会的主持人。

2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前 20 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

6、表决

(1) 基金持有人所持每份基金单位有一票表决权。

(2) 基金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持有人所持表决权的 50% 以上（不含 50%）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：特别决议须经代表权益登记日基金总份额的 50% 以上（不含 50%）通过方为有效。更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

(5) 基金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) 如基金持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金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持有人中选举两名基金持

有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金持有人自行召集，基金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持有人中选举三名基金持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人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；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金持有人或者基金持有人的代理人对会议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，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

(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

基金持有人大会决议自作出之日起生效，但其中需中国证监会或其他权力机关批准的，自批准之日或相关批准另行确定之日期起生效。生效的基金持有人大会决议对全体基金持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。

基金持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

二十二、对持有人的服务

基金管理人承诺为基金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 个工作日内向投资人以书面形式寄出，投资人也可以选择不获取邮寄对账单服务。

(二) 查询

查询服务为投资人提供基金账户查询、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，客户服务人员将分别汇总投诉内容并予以及时处理；同时，充分做好与投资人的沟通工作，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

若基金持有人选择本基金收益以基金单位形式进行分配，该持有人当期分配所得基金收益将按分红除权日的基金单位净值自动转基金单位，且红利转基金单位时不收取任何费用。

（七）其它服务

在条件成熟的情况下，管理人将为持有人提供本基金与管理人旗下其它基金之间的转换服务，及其它服务方式，并另行公告。

二十三、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《暂行办法》及其实施准则第5号《证券投资基金信息披露指引》、《试点办法》、基金契约及其它有关规定。

（一）信息披露的形式

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

（二）信息披露的内容及时间

1、招募说明书

基金获准设立后，在基金募集前三日内公告招募说明书；自基金成立起在每6个月结束后的1个月内更新并公告招募说明书及其摘要。

2、成立公告书

在募集期间内，若基金募集满足第六项中第（一）项所述的成立条件时，管理人应于基金成立日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上刊登基金成立公告书。

3、年度报告、半年度报告、季度报告

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

4、基金资产净值公告

本基金在每个开放日的次日公告开放日基金单位资产净值。

5、临时公告

基金在运作过程中发生如下可能对基金持有人权益产生重大影响的事项时，

基金管理人须按照法律法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告：

- 1) 基金持有人大会决议；
- 2) 基金管理人或基金托管人变更；
- 3) 基金管理人或基金托管人的董事、监事和高级管理人员变动；
- 4) 基金管理人或基金托管人主要业务人员一年内变更达30%以上；
- 5) 基金经理更换；
- 6) 重大关联事项；
- 7) 基金管理人或基金托管人及其董事、监事和高级管理人员受到重大处罚；
- 8) 重大诉讼、仲裁事项；
- 9) 基金终止；
- 10) 基金发生巨额赎回并延期支付；
- 11) 基金暂停申购或赎回；
- 12) 暂停期间需要公告的其它情形；
- 13) 开始或者重新开始申购、赎回等一项或多项业务的办理；
- 14) 基金转换等其他业务的推出；
- 15) 基金费用的调整；
- 16) 基金投资限额的调整；
- 17) 增加或减少销售代理人；
- 18) 基金所投资的上市公司或发债主体发生重大事项；
- 19) 基金或为基金提供服务的相关机构出现有关事项，有可能影响投资人对基金风险和未来表现的评估；
- 20) 其他重大事项。

（三）基金信息披露文件的存放与查阅

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

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十四、基金终止

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。

二十五、基金清算

（一）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。在基金清算小组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金契约》和《托管协议》的规定继续履行保护基金资产安全的职责。
2. 基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。
3. 基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（二）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。

（三）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。

（四）基金资产按下列顺序清偿：

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

基金资产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金持有人。

（五）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。

（六）清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

二十六、基金专用交易席位的选用

（一）选择使用交易席位的证券经营机构的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其专用交易席位。选择的标准是：

1. 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元。
2. 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
3. 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
4. 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
5. 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服。
6. 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

代理证券买卖的证券经营机构由基金管理人根据上述标准考察后确定。基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，报证监会备案并公告。

（二）席位使用期限及更换方式

席位使用期限暂定为半年。使用期满后，基金管理人将根据证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价，包括：

1. 提供的研究报告的数量和质量；
2. 研究报告被基金采纳的情况；
3. 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
4. 因采纳其报告为基金运作避免或减少的损失；
5. 由基金管理公司提出课题，由证券经营机构提供研究论文；
6. 开放证券经营机构的资料库；
7. 其它可评价的量化标准。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中，管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行评价排名，同时亦关注并接受暂未使用席位的证券经营机构的研究报告和信息资讯，为半年后的席位更换作准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及信息服务不符合管理人的要求，管理人有权提前终止使用其交易席位。

（三）席位运作方式

基金管理人将严格遵守中国证监会有关基金通过证券经营机构买卖证券成

交量的规定，结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量，分配基金在各席位买卖证券的交易量。

(四) 其它事宜

基金管理人将根据有关规定，在基金中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露，并向中国证监会报告。

二十七、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和登记注册人的办公场所，投资人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。

二十八、备查文件

- (一) 中国证监会批准长盛中信全债指数增强型债券投资基金设立的文件
- (二) 《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金契约》
- (三) 《长盛中信全债指数增强型债券投资基金代理销售协议》
- (四) 《长盛中信全债指数增强型债券投资基金登记注册协议》
- (五) 《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》
- (六) 《长盛中信全债指数增强型债券投资基金业务规则》
- (七) 法律意见书
- (八) 基金管理人的业务资格批件、营业执照和公司章程
- (九) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (十) 中国证监会要求的其它文件

长盛基金管理有限公司
二零零三年八月十二日

