

长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

招募说明书(更新)

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

本基金根据2009年12月31日中国证券监督管理委员会《关于核准长盛环球 景气行业大盘精选证券投资基金募集的批复》（证监许可「2009」1501号）的核准，进行募集。

基金管理人保证本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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地管理和运用本基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，并承担基金投资中出现的风险，一是境外投资产品风险，包括海外市场风险、汇率风险、政治风险等；二是开放式基金风险，包括利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险、会计核算风险、税务风险、交易结算风险、法律风险、金融模型风险等。

投资有风险，投资者投资于本基金前应认真阅读本招募说明书。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2011 年 5 月 26 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

目录

一、 绪言	1
二、 释义	2
三、 风险揭示	6
四、 基金投资	12
五、 基金的业绩	24
六、 基金管理人	24
七、 境外投资顾问	32
八、 基金的募集	36
九、 基金合同的生效	37
十、 基金份额的申购和赎回	37
十一、 基金的费用与税收	46
十二、 基金的融资	48
十三、 基金的财产	49
十四、 基金资产估值	51
十五、 基金的收益与分配	55
十六、 基金的会计与审计	57
十七、 基金的信息披露	58
十八、 基金合同的终止与基金财产的清算	63
十九、 基金托管人	65
二十、 境外基金托管人	69
二十一、 相关服务机构	71
二十二、 基金合同的内容摘要	78
二十三、 基金托管协议的内容摘要	93
二十四、 基金份额持有人服务	101
二十五、 其他应披露事项	103
二十六、 招募说明书存放及其查阅方式	104
二十七、 备查文件	105

一、 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称“《试行办法》”）、《关于实施<合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法>有关问题的通知》（以下简称“《通知》”）以及《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

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

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充；
招募说明书：	指《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
托管协议：	指《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
发售公告或基金份额发售公告：	指《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金份额发售公告》；
中国	指中华人民共和国（仅为本基金合同目的，不包括中国香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
国家外汇局	指国家外汇管理局及其派出机构；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》；
《合同法》：	指《中华人民共和国合同法》；
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
元：	如无特指，指人民币元；
基金合同当事人：	指受本基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
基金管理人：	指长盛基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
境外资产托管人：	指基金托管人委托的、负责基金财产境外的保管、存管、清算等托管业务的境外金融机构，由基金托管人选择和更换；
投资顾问：	是指符合《试行办法》规定的条件，为基金管理人境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务并取得收入的境外金融机构，基金管理人有权根据基金运作情况选择、更换或撤销境外投资顾问；

- 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 注册登记机构：指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为长盛基金管理有限公司或接受长盛基金管理有限公司委托符合条件的代为办理本基金注册登记业务的机构；
- 投资者：指个人投资者、机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得本基金基金份额的投资者；
- 基金募集期：指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过三个月；
- 基金合同生效日：基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续，获得中国证监会书面确认之日；
- 存续期：指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 境内工作日：指上海证券交易所与深圳证券交易所的正常交易日
- 工作日：同时为上海证券交易所和深圳证券交易所以及香港、伦敦及纽约交易所的正常交易日；
- 开放日：指销售机构为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
- 认购：指在基金募集期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
- 基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其

持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为；

转托管： 基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；

投资指令： 指基金管理人或其委托的第三方机构在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；

代销机构： 指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；

销售机构： 指基金管理人及本基金代销机构；

基金销售网点： 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；

指定媒体： 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站；

基金账户： 指注册登记机构为投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；

交易账户： 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；

T 日： 指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的工作日；

T+n 日： 指自 T 日起第 n 个境内工作日（不包括 T 日）

基金收益： 指基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券价差、银行存款利息及其他收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约；

基金资产总值： 指基金拥有的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；

基金资产净值： 指基金资产总值减去基金负债后的价值；

基金份额净值 指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额总额后得出的基金份额财产净值；

基金财产估值： 指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；

- 法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
- 不可抗力：指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的事件和因素。包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。
- 公司行为信息：指证券发行人所公告的会或将会影响到基金资产的价值及权益的任何未完成或已完成的行动，及其他与本基金持仓证券所投资的发行公司有关的重大信息，包括但不限于权益派发、配股、提前赎回等信息。

三、 风险揭示

本基金作为一种新兴的大众投资工具，具有自身的优势和巨大的发展潜力。但本基金并不同于银行存款或国债等无风险的投资工具，它不能保证投资人一定获得盈利，也不保证最低收益，是一种收益共享、风险共担的集合投资工具。投资的本质就是对风险的控制，我们认为，只有建立在大量占有信息、科学研究分析、并且有效控制风险基础上的投资，才是真正的理性投资。本基金突出主动进攻性的投资风格，以实现最优化的风险调整后收益为目标，更需要强调风险控制的功能。

（一）投资市场风险

证券市场价格会因为国际政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动，将对本基金资产产生潜在风险，这种风险主要包括：

1、政策风险

由于本基金投资于海外证券市场，因此基金的投资绩效将受到不同国家或地区的金融市场和总体经济趋势的影响，而且适用的法律法规可能会与国内证券市场有诸多不同。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化，导致市场波动而影响基金收益，产生风险。

2、国际市场风险

由于本基金投资于海外证券市场，因此各国或地区处于不同产业景气循环周期阶段，也将对基金的投资绩效产生影响。海外证券市场可能由于对于负面的特定事件、该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反映较境内证券市场有诸多不同。对于国际投资者而言，获取国外公司的全面信息可能比本国公司困难。而且由于政府监管与法规方面的不同，本基金可能无法比照国内法律规定在境外追溯权利。

此外，相对于国内市场的规则来说，由于有的国家或地区对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大。以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加。

某些投资的市场可能受到限制或者流动性低。由于没有现成的市场，基金管理人可能难以进行投资交易，难以获得与该等投资有关的价值和风险程度的可靠信息。

3、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家或地区经济、各个行业及上市公司的盈利水平也呈周期性变化，从而影响到证券市场走势，对基金收益产生影响。

4、政府管制风险

本基金将投资于不同的国家或地区的证券市场，每个国家或地区政府都有可能规定特有

的证券监管制度，包括外部资金准入制度、外汇管制制度等。这些管制制度可能对本基金投资当地市场造成障碍，从而对投资收益产生直接或间接的影响。

5、政治风险

政治风险是指基金投资的某些境外国家或地区政治局势出现大的变化，如政府更迭、国家首脑健康状况出现问题、国内出现动乱、对外政治关系发生危机等，这些事件都会对当地证券市场上产生影响，甚至造成限制资金自由流动等结果。当以上这些与当地政治环境有关的事件在本基金所投资的国家或地区发生时，基金的投资收益会受到影响。

6、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。利率风险是指债券的票息率在该券发行时已经确定，市场利率的上下波动使得原债券利息低于或高于新发行债券的利息从而导致债券价格的波动。浮动利率或可变利率的债券对利率波动的敏感性较低。可转换为股票的债券由于内在的债性也可能受到利率波动的影响，但其对股票市场波动的敏感性较高。基金投资于债券和债券回购，其收益水平可能会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

7、汇率风险

指经济主体持有或运用外汇的经济活动中，因汇率变动而蒙受损失的可能性。本基金投资于海外市场，可能涉及到多种外汇币种的投资，外汇与人民币汇率波动、外汇之间交叉汇率的波动都有可能对本基金以计价币种公布的净值造成不利或有利的影响，基金管理人采用的对冲技术在某些情况下可能受到限制或不能够奏效。

8、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险。对于国际中立评级机构赋予高信用等级的融资人，其信用风险一般认为比低信用等级或无信用评级的融资人低。低信用评级较低的证券价格波动性一般较高，从而影响到基金资产净值。

9、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。如果收益资产所投资的上市公司基本面或发展前景产生变化，其所发行的股票价格下跌，或者能够用于分配的利润减少，使收益资产预期的投资收益下降。虽然收益资产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。

10、小市值公司的风险

由于本基金可少量投资于小市值的公司，可能存在额外亏损的风险。小市值公司的股票价格的波动性一般都高于大盘蓝筹公司，因为他们可能有未经过市场检验的新产品、有限的市场资源、不系统的公司治理等问题，其股票市场交易的流动性与信息透明性可能不强，股票的买价和卖价差别很大，如果在短期内出售这类股票，可能会面临较大的价格冲击成本，从而对基金净值的波动造成影响。

11、新兴市场的风险

由于本基金可部分投资于海外新兴市场，新兴市场国家的证券市场可能在规模上小于发达国家市场，造成流动性上的损失。新兴市场的公司在产品线、竞争地位方面都比较有限，而且基金管理人可能难以获得与投资有关的价值和风险程度的可靠信息，可能对合理评估此类公司价值带来困难。新兴市场国家在政治格局的不稳定、市场监管不足以及腐败问题都可能造成证券市价的波动。

12、初级产品的风险

在全球经济一体化程度不断提升的背景下，能源、基本金属、有色金属和农产品等初级产品已经不再是单纯的商品，价格只受供求状况影响，它们与金融市场的联系愈加紧密，金融市场的波动、地缘政治的事件都可能影响初级产品价格的大幅波动。由于初级产品价格对宏观经济的运行具有重要影响，初级产品价格的大幅波动可能会影响到投资组合持有股票的价格，从而造成不利影响。

13、高科技公司股票风险

科技是一个对专业要求高而且竞争十分激烈的行业。高科技公司往往具有初始规模小、企业发展迅速、产品同质化，并且伴随着股票股值较高等特点。由于高科技公司的企业管理水平以及资金供给有可能跟不上企业发展和资源投入的步伐，公司最终可能会遇到财政困境。而且高科技企业的产品比较容易受到产业转型的冲击，这使得高科技公司的股票面临股价出现较大跌幅的风险，从而造成投资者的损失。

14、监管风险

某些特殊行业，例如健康医疗、公用事业等，在某些国家和地区可能受到政府政策监管的重大影响，不同国家政策对于特殊产业差异性监管政策可能对基金投资产生影响。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。例如资产配置、类属配置因市场原因不能符合基金合同的要求，不能达到预期收益目标；也可能表现在个券或个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。以上这些情况的出现有可能造成基金投资收益的损失。

（三）流动性风险

流动性差的证券一般在资源有限的市场上交易，对此类资产正确估值、以合理价格进行买卖都会受到影响。本基金面临的证券市场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人大额赎回的风险；证券投资中个券和个股的流动性风险等。为减少此类风险，本基金对流动性差的证券投资限制在 10% 以下。开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回

回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。简而言之，包括本基金资产可能不能迅速转变成现金，或变现成本很高等。并且由于本基金涉及跨境交易，其赎回期（从申请赎回到赎回款项到账）通常需要比现有开放式基金更长的时间。

（四）衍生品投资风险

1、投资标的的市场风险

又称价格风险，是指因标的资产（如利率、汇率、股票指数、商品等）市场价格波动而导致金融衍生工具价格变动的不确定性。根据衍生工具价格变动的不同原因，又可以将市场风险分为四种：

- （1）利率风险：由于利率变化而引起损失的可能性；
- （2）汇率风险：由于汇率的不利变动而引起损失的可能性；
- （3）权益风险：市场总的股票价格变动或单只股票价格变动所带来的风险；
- （4）商品风险，由于商品价格的不利变动所带来的风险。

标的资产的价格变动是影响衍生工具未来价值的主要因素之一，金融衍生品的交易总是建立在对其标的资产价格变动的预期之上，当交易商的预期与现实的标的资产价格变动存在偏差时，就会产生价格风险。

2、衍生品交易信用风险

又称违约风险，它是指衍生工具合约的一方违约所引起的风险，包括在贷款、掉期、期权交易及结算过程中，因交易对手不能或不愿履行合约承诺而遭受的潜在损失。衍生品交易信用风险可以分为两类：一类是对手风险，指衍生合约交易的一方可能出现违约而给另一方造成损失的可能性；另一类是发行者风险，指标的资产的发行者出现违约而给另一方造成损失的可能性。

3、衍生品流动性风险

指衍生工具持有者不能以合理的价格迅速地卖出或将该工具转手而导致损失的可能性，包括不能对头寸进行冲抵或套期保值的风险。一般说来，采用在价格不变或较小价位波动的情况下，能够卖出或买入衍生工具的数量或金额来衡量流动性的大小。如果能够卖出或买入的数量或金额较大，则该衍生工具的流动性较好；反之，流动性则较差。

由于有相当大一部分衍生工具在场外交易市场进行交易，这些衍生工具面临的流动性风险要大于场内交易的衍生工具，可能无法变现已有的持仓量。由于流动性不足导致难以确定公平价格，因而在评估持有头寸的价值时也存在困难。

4、衍生品操作风险

指在金融衍生交易和结算中，由于内部控制系统不完善或缺乏必要的后台技术支持而导致的风险。具体包括两类：一是由于内部监管体系不完善、经营管理上出现漏洞、工作流程不合理等带来的风险；二是由于各种偶发性事故或自然灾害，如电脑系统故障、通讯系统瘫痪

疾、地震、火灾、工作人员差错等给衍生品交易者造成损失的可能性。决定营运风险的形成及大小的主要因素包括管理漏洞和内部控制失当、交易员操作不当以及会计处理偏差等。

5、法律风险

指由于衍生合约在法律上无效、合约内容不符合法律的规定，或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因，给衍生工具交易者带来损失的可能性。法律风险主要发生在 OTC（也称为柜台市场）的交易中。

法律风险主要来自两个方面：一是衍生合约的不可实施性，包括合约潜在的非法性，对手缺乏进行衍生交易的合法资格，以及现行的法律法规发生变更而使衍生合约失去法律效力等；二是交易对手因经营不善等原因失去清偿能力或不能依照法律规定对其为清偿合约进行净冲平仓。

（五）其他风险

1、现金管理风险

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回的需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。此外，本基金也可能由于向投资人分红而面临现金不足的风险。

2、技术风险

在当计算机系统、通信网络等技术保障系统出现异常情况，可能导致基金日常的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产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

3、大额赎回风险

本基金为开放式基金，基金规模将随着投资人对基金单位的赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫以低于目标价格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。

4、顺延或暂停赎回风险

因为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，基金投资人在赎回基金份额时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

5、不可抗力风险

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，以及证券市场、基金管理人可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金的赎回按正常时限完成的风险。基金管理人自基金合同生效之日起三个月内可不开放赎回，之后，本基金每日开放赎回，但赎回款项到账较国内基金慢，投资者投资于本基金的资金将受到一定的流动性限制。

6、合同生效风险

基金合同的生效需取决于某些先决条件，例如基金备案条件和募集期的要求。若此类先决条件未能得到满足，则将可能会导致基金募集失败。

7、交易结算风险

在基金的投资交易中，因交易的对手方无法履行对一位或多位的交易对手方的支付义务而使得基金在投资交易中蒙受损失的可能性。

8、会计核算风险

会计核算风险主要是指由于会计核算及会计管理上违规操作形成的风险或错误，通常是指基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

9、税务风险

税务风险指因本基金投资于全球不同国家/地区市场，不同国家对海外投资基金的收益税收规定有所不同，可能对基金投资收益实现产生影响。

10、金融模型风险

投资管理人在有时会使用金融模型来进行资产定价、趋势判断、风险评估等辅助其做出投资决策。但是金融模型通常是建立在一系列的学术假设之上的，投资实践和学术假设之间存在一定的差距；而且金融模型结论的准确性往往受制于模型使用的数据的精确性。因此，投资者在使用金融模型时，面临出现错误结论的可能性，从而承担投资损失的风险。

11、证券借贷风险

本基金可能会涉及证券借贷交易。在进行证券借贷交易时，将选择信用评级高的证券公司，但是仍有可能面临信用风险。在从事证券借贷交易期间，可能会发生无法追加担保物导致被强制平仓的风险，对投资者造成经济损失。如果贷款利率出现波动，导致证券公司提高融资利率，将增加融资成本。交易期间，可能出现借贷标的证券范围调整、暂停交易或终止上市等情况，证券公司可能会提前终止证券交易，可能会给投资者造成经济损失。

12、回购交易风险

回购交易指债券交易的双方在进行债券交易的同时，以契约方式约定在将来某一日期以约定的价格（本金和按约定回购利率计算的利息），由债券的“卖方”（正回购方）向“买方”（逆回购方）再次购回该笔债券的交易行为。从交易发起人的角度出发，凡是抵押出债券，借入资金的交易就称为进行债券正回购；凡是主动借出资金，获取债券质押的交易就称为进行逆回购。由于融资方必须有足额的债券作抵押，因此债券回购的安全性比较高、收益相对稳定。但是，回购交易有可能面临恶意违约风险和流动性不足造成的操作风险，给投资者造成经济损失。

四、 基金的投资

（一）投资目标

本基金主要投资于全球证券市场，把握全球经济趋势，精选景气投资行业，并在此基础上投资于其中的优势公司，实现充分分享全球经济增长收益的目标；同时在投资国家或地区配置上，有效实现全球分散化投资，力争充分分散风险，追求基金资产的稳定增值。

（二）基准货币

本基金的基准货币是人民币。

（三）投资范围

本基金投资组合中股票及其他权益类证券占基金资产的 60%-95%，现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%。

本基金将 80%以上的股票资产投资于大盘类股票。其中，大盘股定义如下：股票按总市值从大到小排序，位于各自交易所三分之一之前或者各自交易所所属行业三分之一以前的股票为大盘股。（行业分类按全球行业分类标准（GICS）确定）。在此期间对于未纳入最近一次排序范围内的股票（如新股、恢复上市股票等），本基金参照上述规则决定是否属于大盘股。基金因所持有股票价格的变化而导致大盘股投资比例低于上述规定的不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，最长不超过 6 个月。未来，随股票市场发展和个股市值差异的变化，基金管理人可在保持大盘风格的前提下适当调整大盘股定义标准，并及时公告。

本基金将 80%以上的股票资产投资于业绩比较基准内的澳大利亚、奥地利、比利时、加拿大、丹麦、芬兰、法国、德国、希腊、香港、意大利、日本、荷兰、新西兰、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、美国、英国等 23 个全球发达地区市场，并将根据业绩比较基准指数的调整，对投资地区做对应调整。对于尚未与证监会签署双边监管合作谅解备忘录（以下简称“MOU”）的国家/地区的投资限制将遵从证监会 QDII 投资的有关规定，目前为单个非 MOU 国家的投资不超过基金净值的 3%，非 MOU 国家全部投资总和不超过基金净值的 10%。

（四）投资理念

1、本基金认为在全球经济的发展过程中，在不同时期，各行业的景气度不同，把握行业景气周期的变化，能够更加充分的分享全球经济增长的成果。

2、本基金认为着眼于全球主流国家或地区的分散化配置，能够更有效地分散由于区域配置带来的非系统性风险，更加有利于中国境内的投资者分散风险，获得稳定收益。

3、本基金管理人认为通过投资过程中的有效外汇对冲管理，可以很大程度地规避人民币汇率风险。

（五）投资策略

本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法，运用行业基本面研究方法与 Black-Litterman 资产配置理论体系实现行业层面的风险最优配置，在行业内部，运用全球量化选股模型精选个股，投资管理人将两者进行有机结合，构建最优化的投资组合。

1、资产配置策略

全球宏观经济的走势是资产配置的基础，本基金管理人将密切关注跟踪各项宏观经济指标的变化，在此基础上，制定中长期资产配置战略，确定投资权益类金融产品和现金货币类工具大类资产配置的比例。

2、股票投资策略

（1）行业配置策略：把握全球经济运行趋势，最优化配置景气行业

本基金自上而下的行业配置采用了由 Black 和 Litterman 于上世纪九十年代逐步开发成型的 Black-Litterman 资产配置模型。本基金管理人定期根据投资研究团队对行业景气程度的判断，明确各行业的投资价值和预期收益率，将预期收益率作为新的变量，运用 Black-Litterman 资产配置模型对市场组合进行优化，得到的新投资组合的行业配置权重将成为指导基金管理人行业配置的重要决策依据。

在具体行业的景气程度和投资价值分析中，基金管理人将运用行业时钟理论，辅以宏观因子回归模型和风格投资因子回归模型，结合对行业发展趋势和行业政策的主观评价，最终形成对 MSCI 世界指数的十个一级行业与二十四个子行业进行行业投资价值的综合评估。

行业景气程度和投资价值分析的主要参考指标：

OECD 综合领先指标

OECD 工业制造指标

OECD 核心通货膨胀率

OECD PPI

Brent 原油期货价格

美元指数

全球长期利率

全球流动性指标

信用价差

行业估值水平

行业竞争优势

行业成长性

行业政策环境

在对全球行业景气程度和投资价值的分析过程中，本基金将前瞻性地把握世界经济增长

方式以及产业结构发生根本性改变时期产生的巨大资源、高科技、高端消费品需求，通过投资于全球范围内受惠的行业龙头公司，使中国投资者最直接分享世界经济成长与行业板块轮动的收益，获得长期、稳定的投资回报。

（2）个股选择策略：数量化精选全球优势公司

在得到了最优化的行业配置比例之后，基金管理人将对利用全球量化选股模型形成的备选投资组合进行行业比例调整，将自下而上的选股结果根据自上而下的行业配置进行调整，从而构建最优化的股票投资组合。

基金管理人使用的全球量化选股模型对全球 10000 多只股票做基本面分析，从中选择各行业有代表性的、流通性良好的股票作为配置基础。该模型主要考察六个核心投资主题：估值、赢利能力、收益质量、管理影响、趋势及分析师情绪的变化。估值主题旨在抓住证券的潜在定价错误，通常对比公司的内在价值及其市场价值。赢利能力评估公司的盈利是否超过其资产成本。收益质量评估公司的盈利是否来源于持续性更强、以现金为基础的来源，而不是应计项目的增长。管理影响评估公司管理层的策略及行为。趋势预测由于对公司特定信息的反应不足而造成的股价变化。最后，分析师情绪变化参考买方分析师对某一公司收益及前景的观点按时间变化的情况。

运用这一量化模型可以在行业中选出最具有投资价值的股票，能够超越行业中的其他同类股票，获得超额收益。

3、外汇现金与货币市场工具投资策略

在货币市场类投资部分，资产配置以安全性、流动性为资产配置原则，并兼顾收益性与货币篮子管理来制订具体策略。在制定货币投资策略时，采取分散化的办法管理外汇头寸策略，被动对冲因资产配置引起的外汇比例偏离。

多币种国际化投资一个重要特点是，可以降低组合中各资产之间的相关度，有效提高投资组合的风险调整后收益。进行国际化的多币种投资将意味着资产将以多币种的形式存在，由于各币种之间汇率的波动，存在着汇率风险。为了有效的管理汇率风险，为投资者获取稳定的人民币收益，本基金的外汇管理贯彻以下政策与策略。

本基金将贯彻以实现外汇管理的套期保值、有效规避人民币汇率风险为主的外汇管理政策。在基金的运作初期拟定不使用衍生品与外汇避险工具。市场风险暴露将主要通过大类资产的配置调整，汇率风险通过多币种现金跟踪业绩基准汇率篮子的方式缓解，即与业绩基准中美元、欧元、英镑、日元、加元、瑞士法郎、澳元、港币、瑞典克朗、新加坡元、挪威克朗、丹麦克朗等货币的比例保持一致。在未来，外汇管理的目标将主要依靠套期保值策略来实现。由于考虑收益性的目标，本基金在资产配置过程中仍然不可避免的存在外汇风险敞口，为了进一步降低风险敞口，本基金将充分利用全球市场上存在的汇率管理工具以及包括：货币远期、货币掉期等衍生金融工具来对冲汇率风险。

4、金融衍生产品的投资策略

出于避险和提高组合管理效率的目的本基金可投资于经过中国证监会认可的包括期权、期货、远期、互换、挂钩性结构化产品等在内的金融衍生产品。

应用远期、指数期货、期权等等的金融衍生产品可以有效提高组合管理与资产配置的效率，本基金将在以下方面应用金融衍生产品作为实现组合管理策略的工具：充分利用股票（或者指数）期货合约、期权合约、权证等金融工具，实现组合股票头寸的套期保值，改善组合的风险收益特性；利用股票（或者指数）期货合约、期权合约、权证等金融工具保证金交易的杠杆特性，调节组合现金头寸，实现提高组合流动性的目标；利用金融衍生工具更好地跟踪组合基准；

此外，在符合有关法律法规规定的前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以增加收益。未来，随着全球证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利世界大盘股指数（MSCI World Large Cap Index）

如法律法规发生变化，或基金变更投资范围，或市场中出现其他更具有代表性的、更适用于本基金的、投资者认同度更高的业绩比较基准，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（七）风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时，本基金为全球股票型证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外，由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。

（八）投资决策

本基金投资决策的基本原则是依据本基金合同所制定投资基本方针、投资范围及投资限制等，拟订基金投资策略及执行投资计划。在追求投资收益的稳健增长的同时，积极管理组合面临的风险，最大限度地保障基金持有人的利益。

为提高投资决策效率和专业性水平，公司在经营管理层下设国际投资决策委员会，作为国际投资管理的核心决策机构。国际投资决策委员会会根据基金投资决策小组形成资产配置建议对基金的资产配置下达指导性意见。国际投资决策委员会的每次会议决议形成书面报告，为监察稽核提供查核依据。本基金的具体投资决策采用集体决策模式，基金投资决策小组定期召开周、月、季度、年度投资决策会议制定投资决策。

具体投资组合的流程具体分为五步，在风险控制的前提下以月为单位循环下述投资流程：

1、全球资产配置：基金管理人根据中国证监会有关规定、基金合同和市场情况确定各资产类配置比例和各资产类投资比例范围。在符合基金合同投资限制的前提下，基金管

理人每月对资产配置比例进行调整。

2、区域相对价值决定：国际投资决策委员会会同国际业务部对各个境外主要券商（包括境外投资顾问）提供的价值分析报告进行研究，决定在资产配置比例下各资产类别中具体投资品种。

3、投资组合构建：基金管理人在确定的战略资产配置与投资目标结构的范围内，构建和调整投资组合。

股票投资组合的构建。本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法。在 MSCI 世界指数组合的基础上，结合基金管理人对于行业景气和投资价值的判断，运用 Black-Litterman 资产配置模型实现行业层面的风险最优配置。在行业内部，基金管理人将对利用全球量化选股模型形成的备选投资组合进行行业比例调整，将自下而上的选股结果根据自上而下的行业配置进行调整，从而构建最优化的股票投资组合。

基金管理人根据宏观经济形势、利率平价研究对不同币种货币市场工具及外汇风险暴露进行管理，控制汇率风险。

外汇远期、股指期货等为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制。

4、交易执行：基金管理人通过公司指定的交易管理系统向各主交易券商的全球交易平台下指令执行。

5、业绩回顾与组合修正：基金管理人将采用归因分析等技术手段，评价业绩贡献的构成，为资产配置和组合调整提供依据。基金管理人下设风险管理小组，根据中国证监会和境外相关市场的监管要求，制定风险管理制度，实施有效的风险管理。

（九）投资限制

1、持有同一家银行的存款不得超过本基金资产净值的 20%。在托管账户的存款可以不受上述限制。

2、持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过基金资产净值的 10%。

3、持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过本基金资产净值的 10%，其中，持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过本基金资产净值的 3%。

4、不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。指数基金可以不受上述限制。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

5、持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其

他资产。

6、持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。持有货币市场基金可以不受上述限制。

7、基金管理人管理的全部基金持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

若超过上述第 1 项—第 7 项的投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

本基金将遵照中国证监会最新调整的上述投资比例。

8、对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个工作日内增加 10 亿元以上的情形，而导致股票投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，应在 3 个月内调整以符合基金合同约定。

9、相对于基金资产，股票及其他权益类证券投资比例为 60—95%。

10、本基金的建仓期为基金合同生效之日起 6 个月内。基金管理人应当在基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

11、本基金投资衍生产品应当严格遵守下列规定：

（1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的 100%。

（2）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的 10%。

（3）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：

1）所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的 20%。

（4）本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

12、本基金参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：（1）所有参与交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级；（2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%；（3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要；（4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：现金、存款证明、商业票据、政府债券、中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证；（5）本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

13、根据正常市场惯例本基金参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

（1）所有参与正回购交易对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级；（2）参与正回购交易，采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要；（3）买方应当在正回购交易期内及时向基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红；（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

14、本基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过本基金总资产的 50%。

前项比例限制计算，本基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不计入基金总资产。

15、其他的投资比例符合《基金法》及相关法规的有关规定。

（十）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、购买不动产。
- 2、购买房地产抵押按揭。
- 3、购买贵金属或代表贵金属的凭证。
- 4、购买实物商品。
- 5、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%。
- 6、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外。
- 7、参与未持有基础资产的卖空交易。
- 8、从事证券承销业务。
- 9、向他人贷款或者提供担保；
- 10、从事承担无限责任的投资；
- 11、直接投资与实物商品相关的衍生品；
- 12、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人、境外资产托管人发行的股票或者债券；
- 13、买卖与其基金管理人、基金托管人、境外资产托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 14、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；
- 15、不公平对待不同客户或不同投资组合。
- 16、除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。

17、依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

（十一）若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（十二）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 30 个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

（十三）基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

基金管理人按照有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；有利于基金资产的安全与增值。

（十四）代理投票权的政策和程序

1、代理投票权的决定将由国际投资决策委员会做出。

2、基金管理人可委托境外投资顾问或境外托管人进行代理投票。由于国外的公司治理标准、法律或监管要求和披露实务操作与中国的相关规定存在差异，当委托投票权与非中国证券相关时，受托机构将考虑在相关外国市场上适用的不同的法律法规，提出决定如何行使表决权的建议。

3、在某些中国以外的法域中，就基金持有股票行使投票权的持有人可能被限制在股东大会召开日期前后的一段时间内对股票进行交易。由于此类交易限制会妨碍基金管理且可能导致基金的流动性受损，如果存在此类限制，基金管理人在一般情况下将不行使代理投票权。此外，某些中国以外的法域要求投票的股东就不同的基金披露当前的持股情况，如果存在此类披露要求，基金管理人在一般情况下将不行使委托投票权，以保护基金持有信息。

4、基金将保留委托投票权的记录，至少保存 3 年以上。其中包括：

- （1）基金作为证券持有人收到的有报告义务的发行人的证券持有人会议相关的材料；
- （2）发行人的名称；
- （3）证券的交易所代码；
- （4）会议日期；
- （5）会议上需投票的事项的简要描述；
- （6）需投票的事项是否由发行人、其管理层或其他人或公司提出；

- （7）基金是否对该等事项进行了投票；
- （8）基金如何就该等事项进行了投票；
- （9）基金的投票是赞成还是反对发行人的管理层的提议。

（十五）证券交易

1、证券经纪商的交易执行能力、研究实力和提供的研究服务，是选择证券经纪商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

交易执行能力。主要指证券经纪商是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响等；

研究机构的实力和水平。主要是指证券经纪商能否所提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确；

提供研究服务的质量。主要指证券经纪商承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座。

2、交易量分配的方法及标准

针对境外投资基金业务涉及多个海外证券市场的金融产品投资特点，如不同交易时间、多国货币计价、不同国家风险溢价、每个国家证券交易的法规、税收和监管方式都有差别，证券经纪商的选择更注重其全球范围内上市公司研究力量的综合实力、单个国家证券市场的特色研究力量和遍布全球主要证券交易市场的交易平台的便捷性、高效性。

针对新证券经纪商之等级评分，一律先由国际业务部提出证券经纪商候选名单，金融工程部依证券经纪商所提供近三年财务报表数据来作信用调查，提出证券经纪商评估报告书，呈报风险控制委员会核准后方可进行下单。

往来下单证券经纪商名单均需以定期评分方式进行确定。

每半年评分一次。

由基金经理/交易员根据证券经纪商研究服务品质、交易执行能力进行评分。

打分纪录归档并送监察稽核部和国际业务部备案。

依交易对象分级所可列示的额度及相关法规定，公司将对各证券经纪商的交易总量实施限额控制。额度管理根据境外投资基金交易对手的信用风险控制的有关规定执行。

3、对于在证券经纪商选择和分仓中存在或潜在的利益冲突，管理人应该本着维护持有人的利益出发进行妥善处理，并及时进行披露。

4、交易佣金的返还。管理人每年年初根据对证券经纪商的评价和考核，与证券经纪商签订服务协议，在协议中规定详细的交易佣金的收取标准，严格禁止佣金返还的情况出现。

（十六）基金投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据取自长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	55,007,382.65	79.90
	其中：普通股	55,007,382.65	79.90
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,780,350.60	20.02
8	其他各项资产	55,571.20	0.08
9	合计	68,843,304.45	100.00

2、报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	25,273,341.91	37.17
香港	22,349,516.46	32.87
加拿大	1,976,929.69	2.91
日本	1,489,705.46	2.19
英国	1,431,054.60	2.10
法国	1,345,820.80	1.98
瑞士	1,141,013.73	1.68

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
金融	9,309,203.72	13.69
信息技术	9,027,548.77	13.28
医疗	7,861,851.81	11.56
材料	7,777,252.10	11.44

工业	6,957,204.28	10.23
能源	6,838,981.08	10.06
非必需消费品	5,737,146.59	8.44
必需消费品	1,498,194.30	2.20
合计	55,007,382.65	80.91

注：本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准（GICS）进行行业分类

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明

细

序号	证券代码	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	JPM US	JPMORGAN CHASE & CO	-	纽约证券交易所	美国	10,500	3,173,625.42	4.67
2	AAPL US	APPLE INC	-	纳斯达克证券交易所	美国	1,000	2,284,577.58	3.36
3	MON US	MONSANTO CO	-	纽约证券交易所	美国	4,200	1,989,814.95	2.93
4	ABX CN	BARRICK GOLD CORP	-	多伦多证券交易所	加拿大	5,800	1,976,929.69	2.91
5	5 HK	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	香港证券交易所	中国香港	28,000	1,927,910.25	2.84
6	GOO G US	GOOGLE INC-CL A	-	纳斯达克证券交易所	美国	500	1,921,713.62	2.83
7	BAC US	BANK OF AMERICA CORP	-	纽约证券交易所	美国	20,000	1,747,936.24	2.57
8	135 HK	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	香港证券交易所	中国香港	160,000	1,671,024.00	2.46
9	AMZ N US	AMAZON.COM INC	-	纳斯达克证券交易所	美国	1,400	1,653,406.06	2.43
10	587 HK	HUA HAN BIO-PHARMA CEUTICAL HOLDING LIMITED	华翰生物制药	香港证券交易所	中国香港	788,000	1,612,773.99	2.37

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10、投资组合报告附注

10.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

10.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	35,605.40
4	应收利息	483.09
5	应收申购款	19,482.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,571.20

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

五、 基金的业绩

本基金自成立以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶 段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金成立至 2010 年 12 月 31 日	7.60%	0.51%	20.94%	1.05%	-13.34%	-0.54%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 3 月 31 日	0.23%	0.66%	4.05%	0.83%	-3.82%	-0.17%
自基金成立至 2011 年 3 月 31 日	7.85%	0.56%	25.80%	0.99%	-17.95%	-0.43%

注：同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

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

六、 基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

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

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：中国证监会证监基金字[1999]6 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币壹亿伍仟万元

存续期间：持续经营

电话：（010）82255818

传真：（010）82255988

联系人：叶金松

2、经营概况

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15000万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省信用担保集团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2011年5月26日，基金管理人共管理两只封闭式基金、十四只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理多只专户理财产品。

（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。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。现为国元证券股份有限公司董事长。

钱正先生，董事，学士，高级经济师。曾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。现为安徽省信用担保集团有限公司总经理。

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。现为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。现为国元证券股份有限公司董事、总裁。

何玉珠女士，董事，学士。历任JP摩根证券（亚洲）有限公司副总裁、瑞银集团董事总经理。现为星展资产管理有限公司首席执行官、新加坡财富管理学院资深顾问。

张在荣先生，董事，学士。曾任职多个金融机构，包括法国东方汇理银行、美洲银行、渣打银行、星展银行有限公司。现为星展银行（中国）有限公司执行董事兼行政总裁。

周兵先生，董事，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。2004 年 10 月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司副总经理，现为公司总经理。

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。现为香港国际资本管理有限公司董事长。

张仁良先生，独立董事，金融学讲座教授。曾任香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人，太平洋经济合作理事会（PECC）属下公司管制研究小组主席，上海交通大学管理学院兼职教授及上海复旦大学顾问教授，香港城市大学讲座教授。现为香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署辖下的《伙伴倡自强》小区协作计划主席、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席、以及香港特区政府策略发展委员会委员。2007 年被委任为太平绅士。2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现为安徽大学教授，校学术委员会委员，政治经济学博士点学科带头人，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，中国科技大学兼职教授，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，安徽省经济学会副会长。

陈华平先生，独立董事，博士毕业，教授，博士生导师。曾任中国科技大学信息管理与决策研究室主任、管理学院副院长，现为中国科学技术大学计算机学院执行院长，中国科技大学管理学院商务智能实验室主任。

2、基金管理人监事会成员：

陈锦光先生，监事会主席，学士，特许金融分析师。曾任职于美国银行直投伙伴公司私募股权投资部门，历任野村证券高科技产业研究分析师、野村证券上海办事处及证券研究部门负责人、星展资产管理有限公司研究总监以及投资亚洲和中国国内市场的投资经理人。现为星展资产管理有限公司股票投资团队总监。

沈和付先生，监事，法学学士。曾任安徽省国际经济技术合作公司经理助理，安徽省信托投资公司法律部副主任。现为国元证券股份有限公司合规总监。

叶斌先生，监事，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，安徽省信用担保集团有限公司副总经理。

钱进先生，监事，硕士研究生。曾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总经济师。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计、太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司主管会计，历任长盛基金管理有限公司业务运营部总监和财务会计部总监。现为长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

3、基金管理人高级管理人员

凤良志先生，董事长，博士，高级经济师。同上。

周兵先生，总经理，硕士，经济师。同上。

朱剑彪先生，金融学博士。历任广东商学院投资金融系教师、党支部书记；广州证券有限公司宏观与策略研究员、投资银行部项目经理、基金部经理；金鹰基金管理有限公司筹备组成员、董事会秘书、研究总监、投研副总监兼研究总监和督察长。2007年4月起加入长盛基金管理有限公司，历任社保业务管理部总监、固定收益部总监、总经理助理、副总经理等职，现为长盛基金管理有限公司常务副总经理、社保组合组合经理。

杨思乐先生，英国籍，拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位。从1992年9月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司（新加坡）。2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现为公司副总经理。

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。2004年10月起加入长盛基金管理有限公司，现为公司督察长。

4、基金经理

吴达先生，1979年8月出生。伦敦政治经济学院金融经济学硕士，CFA（美国特许金融分析师）。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理，专户投资组合经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理，资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监。自2008年10月10日起任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，自2010年5月26日起兼任长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金（本基金）基金经理。

邓永健先生，1967年10月出生。英国兰卡斯特大学工商管理硕士，CFA（美国特许金融分析师）。历任恩佩投资管理有限公司助理基金经理；元大京华证券（香港）有限公司高级经理；大福资产管理有限公司助理董事；星展资产管理（香港）有限公司总监及高级基金经理；加拿大宏利资产管理（香港）有限公司股票部行政总监；2007年12月起加入长盛基金管理有限公司，自2010年5月26日起任长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金（本基金）基金经理。

（本招募说明书基金经理任职日是指公司批准日或公司公告日。）

5、投资决策委员会成员

朱剑彪先生，金融学博士，常务副总经理，同上。

王宁先生，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金

经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理。

侯继雄先生，清华大学博士。历任国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部总监，同盛证券投资基金基金经理。

张芊女士，清华大学经济学硕士、法国工程师学院 MBA，美国特许金融分析师 CFA。历任中国银河证券债券研究员、中国人保资产债券投资主管、高级研究员等职务。现任长盛基金管理有限公司社保业务管理部和固定收益部总监，社保组合组合经理。

吴达先生，硕士，国际业务部总监，同上。

白仲光先生，金融工程专业工学博士，2003 年加入长盛基金管理有限公司，历任研究员、高级金融工程师、基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部总监，长盛中证 100 指数基金基金经理。

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、编制基金季度报告、中期和年度基金报告；

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

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、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行为的发生；

2、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、接受委托或以其他任何形式为其他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

- （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 and 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、制度执行及遵规守法进行监察稽核；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、投资管理制度、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总经理办公会批准。

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。公司各部门对规章制度的调整与更新情况由监察稽核部负责监督。

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。

七、 境外投资顾问

（一）境外投资顾问基本情况

名称：高盛资产管理有限责任合伙（GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT, L.P.）
成立时间：1990 年 4 月 4 日
办公地址：200 West Street, New York, NY 10282-2198
邮寄地址：高盛（亚洲）责任有限公司，香港皇后大道中 2 号长江集团中心 68 楼
联系人：高卉（Ruth Gao）
电话：（852）29786049
传真：（852）29781490
电子邮件：ruth.gao@gs.com
公司网址：www.gs.com
公司简介：

高盛资产管理泛指高盛集团在世界各地所有涉及资产管理业务的业务部门。高盛资产管理是全球领先的资产管理机构，其目前在管资产总数居全球前 10 位，截至 2010 年 12 月底，资产管理规模达 7171 亿美元。高盛资产管理有限责任合伙是高盛资产管理在纽约的分支机构。高盛资产管理有限责任合伙从事资产管理业务超过 19 年，投资区域分布北美、欧洲、亚太以及新兴市场等多个地区。

（二）参与本基金产品投资的主要人员情况

1、Gary Chropuvka，特许金融分析师，董事总经理，全球产品策略团队成员

Gary 目前是负责客户策略和交流的全球产品策略团队中的成员之一。他曾经在量化股票策略部门中领导过投资组合实施工作，并且还曾经在负责开发节税投资产品的量化股票部门中，是应税产品管理团队中的一员。Gary 于 1998 年 3 月加入高盛资产管理，在私募股本合伙企业部门中任职。在此之前，他曾在摩根士丹利的代理清算组（Correspondent Clearing Group）中任职四年。Gary 拥有 13 年的行业经验。他获得了罗格斯大学的文学学士学位（数学），并在加州大学获得了金融工程硕士学位。Gary 是特许金融分析师。

2、Len Ioffe，特许金融分析师董事总经理；高级投资组合经理、全球量化股票团队成员

Len 是全球量化股票团队的高级投资组合经理，负责管理全球及非美国投资组合。他也是全球量化股票投资政策委员会成员之一。在担任这一职务前，Len 负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析，并实施不同的交易策略。Len 于 1994 年加入高盛资产管理。

此前，他供职于史密斯·巴尼·希尔森公司。Len 拥有 15 年的从业经验。他获得了俄罗斯圣彼得堡理工大学颁发的计算机科学硕士学位以及由纽约大学斯特恩商学院颁发的工商管理硕士学位。Len 是特许金融分析师。

3、Katinka Domotorffy，特许金融分析师，董事总经理，量化投资策略部主管

Katinka 是高盛资产管理量化投资策略部的主管及投资总监。在此之前她曾任职该部门定量投资策略小组的策略主管，并兼任组合经理一职，与全球宏观 / 固定收入小组合作。她以前主要负责对各类共同基金、基金捆绑项目及机构客户进行定量研究和组合管理，研究重点包括全球跨行业和国内以行业为基准的股票策略以及最优组合构建技术。Katinka 于 1998 年加入高盛资产管理，并于 2006 年获得合伙人资格。在加入高盛前，Katinka 曾获 Thouron 奖学金前往英国求学，并以优异成绩获伦敦政治经济学院（London School of Economics）授予金融学理科硕士学位。Katinka 毕业于宾夕法尼亚大学（University of Pennsylvania），获理学士学位，现持有特许金融分析师牌照。

4、Lia Wang，特许金融分析师，执行董事，客户组合经理，香港

Lia 于 2002 年 7 月加入高盛资产管理，任职于量化投资策略部客户组合管理团队，主攻亚洲（除日本外）市场。她目前的办公地点在香港。从 2002 年 7 月到 2008 年 1 月，Lia 在高盛纽约负责量化研究和组合管理工作。Lia 于 2002 年 5 月于宾夕法尼亚大学沃顿商学院获得经济学学士学位和会计硕士学位（一等荣誉学位）。Lia 于 2005 年获得特许金融分析师资格。

5. Oliver Bolitho，董事总经理，高盛资产管理亚洲主管，香港

Oliver 为高盛资产管理亚洲的主管，他于 1998 年加入高盛，担任目前职位之前，他曾在 2001 年至 2006 年间担任英国和爱尔兰业务的主管。Oliver 初入高盛资产管理时负责发展与机构投资顾问的关系。加入高盛之前，Oliver 是 Brand Consultancy（一个专注于衡量和改善营销活动财务绩效的团队）的发起人和合伙人。1990 年从剑桥大学毕业后，他加入了美国策略顾问公司——贝恩公司，开始了自己的职业生涯。同时，Oliver 还在医生保护协会（一个关注全球医疗工作者的互助保险公司）投资委员会任职，并担任英国慈善团体 Comic Relief（一个关注英国和非洲健康和福利项目的团体）的投资委员会成员。

6. Ruth Gao 高卉，执行董事，香港

高卉于 2008 年 10 月加入高盛资产管理。作为销售和市场营销团队的一员，她主要负责管理开发中国大陆地区的业务。在加入高盛资产管理之前，高卉曾在瑞联全球资产管理工作四年半，作为高级销售经理，从事发展中国机构客户业务开发及参与瑞联与中国合作合资的项目。高卉的职业生涯始于 2001 年，那时她就职于平安证券与资产管理。高卉在南开大学获得

经济学本科学历后，赴英国卡迪夫大学研读国际金融，并取得硕士学位。

（三）境外投资顾问的历史业绩

由前任高盛量化部门全球最高负责人 Bob Litterman 先生于 1992 年发布的 Black-Litterman 模型，是为组合优化的过程提供支持的理论依据。Black-Litterman 模型在高盛资产管理内部长期被应用于自下而上精选个股与自上而下资产配置，并且业内其它投资者也逐渐开始使用该模型原理优化组合配置。Black-Litterman 模型公认最大的长处在于可以在投资观点的基础上形成合理的组合配置方案。在高盛资产管理为基金管理人提供投资建议上全程使用了 Black-Litterman 模型的理论体系。

高盛资产管理相信其采用的这种投资于估值低，盈利能力强，盈利质量高，市场趋势好，分析师持正面观点且管理层对股东很友好的公司的系统性投资方法，仍然是一种客观理性的投资方法。这种投资方法尽管最近遇到了一些挑战，但曾经经历了多年不同地区不同市场环境的考验，为高盛资产管理的客户提供了良好的收益。例如，高盛资产管理历史最长的投资组合，美国大盘股指数增强基金，自 1991 年 12 月到 2008 年 1 月的 17 年间，提供了年均优于标准普尔 500 指数 0.75% 的收益率。相似的，高盛资产管理旗下的全球市场国家中性投资组合，在保持和 MSCI 全球指数相同的国家权重的前提下，在过去 5 年半的时间内实现了年均优于指数 3% 的收益率。

（四）境外投资顾问的职责

基金管理人（而非境外投资顾问）以受托人的身份全权管理基金的证券投资，其中会用到境外投资顾问的研究和建议。境外投资顾问的职责是根据其与基金管理人签订的《投资顾问协议》向基金管理人提供下列服务：

1、向基金管理人以资产组合列表的形式提供投资建议（基金管理人有权决定是否遵从该列表）以及相关辅助服务；

2、为了就基金管理人的资产组合管理流程中的交易和其他事项向基金管理人提供合理协助，传授国际专有技术和专业知识，根据《投资顾问协议》的规定向基金管理人提供其他服务。

根据《投资顾问协议》，境外投资顾问在向基金管理人提供投资建议（就资产组合中证券的组成和权重而言）之前，可以为其他账户执行交易或为其他客户提供类似建议。

高盛资产管理特别设计了金融冲击指标加强量化模型的反应性管理。通过收集市场数据进行推演，金融冲击指标能够纵向衡量比较市场现状与 911、长期资本 LTCM、俄罗斯债务危机等历史事件。通过与投资顾问合作交流，基金管理人投资团队理解量化模型理念及选股标

准、在市场急剧变化时影响模型的相关因素。在市场发生此类情况时，投资团队将在高盛资产管理的紧密协助下，对模型选股建议产生的影响和变化做出适当的调整。

八、 基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证券监督管理委员会 2009 年 12 月 31 日《关于核准长盛环球近景气行业大盘精选证券投资基金募集的批复》（证监许可「2009」1501 号）批准募集。

（一）基金类型和存续期间

- 1、基金的类型：股票型基金。
- 2、基金的运作方式：契约型开放式。
- 3、基金存续期间：不定期。

（二）募集概况

本基金自 2010 年 4 月 19 日起向全社会公开募集，截至 2010 年 5 月 21 日募集工作结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 339,898,507.52 元人民币，折合基金份额 339,898,507.52 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 142,877.11 元人民币，折合基金份额 142,877.11 份。本次募集所有资金已于 2010 年 5 月 25 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管专户。本次募集有效认购户数为 10,702 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 340,041,384.63 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

九、 基金合同的生效

本基金基金合同自 2010 年 5 月 26 日起生效，本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

十、 基金份额的申购和赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售机构将由基金管理人在基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所以及香港、伦敦、纽约证券交易所同时正常交易的工作日，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

基金合同生效后，基金管理人可根据法律法规规定或持有人要求，增加申购、赎回的开放日；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，基金管理人还可视情况对开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照有关规定在指定媒体上公告。

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

2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日后不超过三个月开始办理。具体业务办理时间由基金管理人另行公告。

本基金的赎回自基金合同生效日后不超过三个月开始办理。具体开放时间由基金管理人另行公告。

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申购或赎回开始前 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。

申购开始日：2010 年 7 月 22 日

赎回开始日：2010 年 7 月 22 日

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日的基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行处理，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日业务办理时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施三日前予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购款项。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2、申购与赎回申请的确认

T 日规定时间内受理的申请，正常情况下，本基金注册登记人在 T+2 日内为投资者对该交易的有效性进行确认。投资者应在 T+3 日（包括该日）后及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。对于申请在注册登记机构的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，因投资者怠于行使权利而造成的损失，由投资者自行承担。

担。

3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理投资者有效赎回申请之日起不超过十个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

本基金认购、申购、赎回的币种为人民币，基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，接受其他币种的申购、赎回，并提前公告。

（五）申购与赎回的数额限制

（1）本基金最低申购金额 1,000 元人民币，追加申购的单笔最低限额为人民币 1,000 元。

（2）本基金不设最低赎回份额。

（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三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。

（六）申购、赎回的处理方式

1、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均四舍五入保留至小数点后两位。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

其中，当申购费用采用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额－申购费用

申购份数=净申购金额/申购当日基金份额净值

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除相应费用后的金额，各计算结果均四舍五入保留至小数点后两位。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用

（七）申购和赎回的费用及其用途

1、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。

购买金额（M）	申购费率
M<50 万	1.5%
50 万≤M<200 万	1.2%
200 万≤M<500 万	1.0%
M≥500 万	每笔 1000 元

2、本基金的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。

持有基金份额期限	赎回费率
小于一年	0.50%
大于等于一年小于两年	0.25%
大于等于两年	0%

3、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

4、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率和收费方式。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施三日前在指定媒体上刊登公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，经代销机构同意后，针对特定地域、特定行业的投资者以及以特定交易方式等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

6、本基金申购、赎回的币种为人民币，基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，接受其他币种的申购、赎回，并提前公告。

（八）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+2 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施 3 个工作日前在指定媒体上予以公告。

（九）拒绝或暂停申购的情形及处理

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力或其他不可控制因素导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- 2、本基金投资的重要市场正常或非正常停市，导致基金管理人无法准确计算当日基金资产净值；
- 3、发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- 4、基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种；
- 5、其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- 6、基金资产规模或者份额数量达到中国证监会、国家外汇局核准的境外证券投资额度；
- 7、因基金收益分配、或基金投资组合内某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内继续接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；
- 8、个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得

基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害；

9、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；

10、法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项或延缓支付赎回款项；
- 2、基金投资的重要市场正常或非正常停市，导致基金管理人无法准确计算当日基金资产净值；
- 3、发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；
- 4、发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
- 5、法律、法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人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，其余部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，延期支付最长不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应在指定媒体上公告。

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。暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

（十一）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转换转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在三个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种指定媒体予以公告。

（4）暂停接受赎回申请和延缓支付赎回款项：本基金连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回的为连续巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过二十个工作日，并应当在至少一种指定媒体公告。

（十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

1、如果发生暂停的时间为一个开放日，基金管理人将于重新开放日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

2、如果发生暂停的时间超过一个开放日但少于十个开放日，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过十个开放日，暂停期间，基金管理人应每十个开放日至少

重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过 20 个开放日时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日，在指定媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

（十三）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费。基金转换的程序及相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

（十四）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。基金份额转托管一步完成。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在转托管业务确认成功后转入其指定的销售机构。

投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+2 日到达转入方网点，投资者可于 T+3 日起赎回该部分基金份额。

如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其他合理原因，可以暂停该业务或者拒绝基金份额持有人的转托管申请。

（十五）定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下，基金管理人可为投资者办理定期定额投资计划，具体实施办法由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

（十六）基金份额的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行、国有资产无偿划转、机构合并或分立和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

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”是指国家有权机关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；

4、“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；

5、“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转。

办理非交易过户业务必须提供注册登记机构要求提供的相关资料，并向注册登记机构申请办理。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

（十七） 基金的冻结与质押

注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一律转为基金份额并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。

根据相关法律法规的规定，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

十一、 基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费（含境外投资顾问的费用）；
- 2、基金托管人的托管费（含境外托管人的费用）；
- 3、基金的资金划拨费用；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、证券经纪商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 5、基金进行外汇兑换交易的相关费用；
- 6、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等；
- 7、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金合同生效以后的会计师费和律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用（包括税务咨询顾问服务费用）；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

在中国证监会允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费（含境外投资顾问费）按基金资产净值的 1.8%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.8%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

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，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 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费（包括向境外资产托管人支付的相应服务费）按基金资产净值的 0.3% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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，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 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（四）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，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列入基金费用。

（五）基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（六）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。基金份额持有人根据中国法律法规规定，履行纳税义务。

十二、 基金的融资

本基金可以按照有关规定进行融资，为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的 10%。

十三、 基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类有价证券、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、基金投资及收益以及估值调整；
- 7、股票投资及其估值调整；
- 8、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债（含各项有关税收）后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件的规定在境内开立人民币和外币资金账户，在境外以本基金名义或托管人名义开立外币资金账户及证券账户，与基金管理人、基金托管人和境外资产托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

（四）基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、资产托管人不得将基金财产归入其固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。
- 3、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，归基金财产。

4、基金托管人按照法律法规规定和境外市场惯例开设基金财产的所有资金账户和证券账户。

5、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

6、基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。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范围。

7、除依据《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十四、 基金资产估值

（一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，确定基金资产净值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

（二）估值日

基金合同生效后，对每个工作日基金资产进行估值，T+1 日完成 T 日估值。

（三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

（四）估值方法

1、股票估值方法

（1）上市流通股票的估值

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

（2）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。首次发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值。

2、固定收益证券的估值办法

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交

易市价，确定公允价值。

（2）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（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（3）未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

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

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、衍生品估值方法

（1）上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。

4、存托凭证估值方法

公开挂牌的存托凭证按其估值日所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

5、基金估值方法

（1）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

（2）其他基金按最近交易日的基金份额净值估值。

6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，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、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

8、在任何情况下，基金管理人如采用本款第 1—7 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—7 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；

9、估值中的汇率选取原则：

在估值中汇率数据选取方面，基金管理人与境外托管人将按目前 QDII 相关法规，采用人民银行或其认可机构每天所公布的人民币分别兑换美元、英镑、欧元、日元、瑞士法郎等五种外币的中间价。涉及这五种货币以外的其他货币对人民币汇率，则采用 Bloomberg 于北京时间 18:00 公布的 Tokyo Composite Rates 的相关货币对美元中间汇率进行换算。

10、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

11、法律法规或监管部门有最新规定的，按其规定进行估值。

（五）估值程序

1、基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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。

2、基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自应承担的责任。

（六）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人按照有关规定对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（七）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人向中国证监会报告，计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（八）暂停估值的情形

- 1、基金投资涉及的香港、伦敦和纽约等交易所遇法定节假日或因其他原因停市时；
- 2、基金管理人所在的中国大陆遇法定节假日时；
- 3、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 4、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 5、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或无法评估基金资产的；
- 6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

（九）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按本条第（四）款第8项规定进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

2、对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与基金按照权责发生制进行估值的应交税金有差异的，相关估值调整不作为基金资产估值错误处理。但是，对于其中因基金管理人、基金托管人、境外资产托管人或基金管理人委托的税务顾问（称为“责任人”）业务操作不当、疏忽或者故意违约等行为导致基金实际税收负担（含罚金等）与估值有所差异的，该等差异应由责任人负责赔偿，基金管理人和基金托管人应代表基金利益进行追偿。

3、由于不可抗力原因，或由于各家数据服务机构发送的数据错误，本基金管理人和本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，本基金管理人和本基金托管人可以免除赔偿责任，但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：基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）期末可供分配利润

期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次分配比例不低于收益分配基准日可供分配收益的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个境内工作日；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在至少一家指定媒体公告及基金管理人网站并报中国证监会备案。

（六）基金收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

十六、 基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币为记账单位。
- 3、会计制度按国家有关的会计制度执行，并可参考国际会计准则。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期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。

- 7、法律法规或监管部门对基金会计政策另有规定的，从其规定。

（二）基金年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人、境外资产托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后在2日内披露。

十七、 基金的信息披露

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金以人民币计算并披露净值及相关信息。涉及币种之间转换的，应当披露汇率数据来源，并保持一致性。如果出现改变，应当予以披露并说明改变的理由。人民币对主要外汇的汇率应当以报告期末最后一个估值日中国人民银行或其认可机构公布的人民币汇率中间价为准。

本基金除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

（一）招募说明书、基金合同、托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3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；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在各自公司网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的

15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当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。

（三）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媒体和网站上登载基金合同生效公告。

（四）基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。如本基金投资衍生品，应当计算每个工作日的基金份额净值并于两个境内工作日内进行披露。

在开始办理基金份额申购或赎回之后，基金管理人应当在每个开放日后的两个境内工作日内通过网站、基金份额发售网点以及其他指定媒体，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个工作日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述工作日后两个境内工作日内，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和网站上。

（五）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（六）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。

1、基金年度报告：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，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：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，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个境内工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第二个境内工作日，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。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

（七）临时报告与公告

基金发生重大事件，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。

前款所称重大事件，是指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下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、提前终止基金合同；
- 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、境外投资顾问、境外资产托管人的法定名称、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、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

18、基金改聘会计师事务所；

19、基金变更、增加、减少基金代销机构；

20、基金更换注册登记机构；

21、基金开始办理申购、赎回；

22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23、基金发生巨额赎回并延期支付；

24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26、更换境外资产托管人，更换或撤销境外投资顾问；

27、基金运作期间如遇境外投资顾问主要负责人员变动，基金管理人认为该事件有可能对基金投资产生重大影响；

28、基金份额持有人大会决议；

29、本基金接受其他币种的申购、赎回；

30、本基金推出新业务或服务；

31、中国证监会规定的其他事项。

（八）公开澄清

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。

（九）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，

投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

有关交易管理、交易佣金返还安排、代理投票政策、流程、记录等文件，将分别置于基金管理人住所，以供公众查阅，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

十八、 基金合同的终止与基金财产的清算

（一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 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、基金托管人承接的；
- 3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

（二）基金财产的清算

- 1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。
- 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起三十个境内工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（7）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（8）对基金剩余财产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿基金债务；

（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后五个境内工作日内由基金财产清算小组进行公告。基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 20 年以上。

十九、 基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门负责人：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至

上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截止 2011 年 3 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方

达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票 (QDII)、嘉实海外中国股票 (QDII)、银华全球优选 (QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型 (QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型 (QDII)、信诚金砖四国积极配置 (QDII)、海富通大中华精选股票型 (QDII)、招商标普金砖四国指数 (LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选 (QDII)、大成标普 500 等权重指数 (QDII)、长信标普 100 等权重指数 (QDII) 等 107 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人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，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如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，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

二十、 境外基金托管人

（一）中银香港概况

名称：中国银行(香港)有限公司

注册地址：香港花园道 1 号中银大厦

办公地址：香港花园道 1 号中银大厦

法定代表人：和广北

成立时间：1964 年 10 月 16 日

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

联系人：黄晚仪

联系电话：+852-3419-3753

中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）早于 1964 年成立，并在 2001 年 10 月 1 日改组成为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司-则于 2001 年 2 日在香港注册成立，并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市，2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

资本总额(截止 2010 年 12 月 31 日)：约为 1182.89 亿港元

托管资产规模(截止 2010 年 12 月 31 日)：约 4601 亿港元

信用等级：

2010	穆迪投资服务	标准普尔	惠誉国际评级
评级展望	稳定	正面	稳定
长期	Aa3	A-	A
短期	P-1	A-2	F1
基本实力 / 财务实力	C+	B	-

（二）、境外次托管安排

中银香港为本基金境外清算估值的法律责任方。在选择次托管服务商时，中银香港采用「优中选优」的原则，按服务商在当地市场之实际经验及专长、服务水平、财务状况、风险管理、声誉、整体服务配套及质素等方面的表现，挑选最佳服务商作为中银香港的次托管人，

其中包括多家顶级的跨国银行。中银香港的托管网络覆盖全球约八十多个市场，其中包括所有已经与中国证监会或中国银监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区，并已经开立账户。完备的全球次托管网络足以覆盖本基金投资目标包括的主要国家/地区市场。

（三）境外估值安排

基金托管人对本基金的估值工作委托中银香港（通过旗下的中银国际英国保诚信托有限公司）完成。中银国际英国保诚信托有限公司（“中银保诚”）是由中银集团信托人有限公司（简称「中银信托」）与 Prudential Corporation Holdings Limited（简称「保诚」）于一九九九年在香港注册成立的合营企业，注册资本为三亿港元，其中 64%的股权由中银信托持有，36%由保诚持有。中银信托是中银香港的附属公司。中银保诚除为香港的雇主、雇员及自雇人士提供强制性公积金及退休保障计划的信托及行政服务外，亦为单位信托基金提供信托及资产托管服务。中银保诚专职基金会计与投资监督人员多达 30 人，其中骨干人员均具备 10 年以上相关经验。

（四）有关法律责任揭示

中国银行跟中银香港为两个不同的法人，亦为两家独立的上市公司，分别设有防火墙区隔，并就双方之职能及责任明确订定。按 QDII 相关法规，境内托管人为 QDII 的全权负责方，而境外托管人则按照与境内托管人签署的托管协议向境内托管人负责；即工作外包，法律责任不外包。境外托管人（中银香港）主要负责提供境外投资市场的开户和资产保管、境外投资清算、公司行为、基金估值及会计、投资监督等日常托管服务。其中，基金估值及会计、投资监督等托管服务由中银香港委托其控股子公司中银保诚提供，但相关责任仍是由中银香港对中国银行承担。另外，中银香港乃香港的持牌银行，所有外包服务行为都必须获得香港金融管理局批准并受其持续监管，而中银保诚则须承担与中银香港签署之服务协议书的法律责任。

二十一、 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

邮政编码：100088

电话：（010）82255818 转 263、288

传真：（010）82255981、82255982

联系人：张元

2、代销机构

（1）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：（010）66594851

传真：（010）66594946

联系人：吴雪妮

客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

（2）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

网址：www.95599.cn

（3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

电话：010-67597114

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（4）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66104230

传真：（010）66107914

联系人：王隽

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

电话：0755—83077278

传真：0755—83195050

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

（6）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 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）2272100

联系人：祝丽萍

（7）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 40—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40—45 层

法定代表人：宫少林

电话：（0755）82943666

传真：（0755）82943237

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、（0755）26951111

（8）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号海通证券大厦
办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦
法定代表人：王开国
电话：（021）53594566
联系人：李笑鸣
客服电话：400-8888-001、（021）962503

（9）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

（10）广发华福证券股份有限公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 8 层
法定代理人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
客服热线：0591-87383333
公司网站：<http://www.gfhfzq.com.cn/>

（11）瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层，100140
法定代表人：刘弘
联系人：谢亚凡、田文健
电话：010-59226788
网站：www.ubssecurities.com

（12）第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层
办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层
法定代表人：刘学民

开放式基金咨询电话：（0755）25832686

开放式基金业务传真：（0755）25831718

联系人：杨柳

（13）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

法定代表人：顾伟国

电话：（010）66568430

传真：（010）66568536

联系人：田薇

客服电话：400-888-8888

公司网址：<http://www.chinastock.com.cn/>

（14）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：丁国荣

电话：（021）54033888

传真：（021）54035333

联系人：李清怡

公司网址：www.sw2000.com.cn

（15）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：021-38565785

客服电话：400-888-8123

公司网站：www.xyzq.com.cn

（16）东北证券股份有限公司

住所：长春市人民大街 138—1 号

办公地址：长春市人民大街 138—1 号

法定代表人：矫正中

开放式基金咨询电话：（0431）96688-0、（0431）5096733

开放式基金业务传真：（0431）5680032

联系人：潘锴

公司网址：www.nesc.cn

（17）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-893

传真：025-84579763

联系人：程高峰

（18）华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：95513

公司网站：www.lhzq.com

（19）德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

电话：021-68761616

传真：021-68767981

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

客户服务电话：400-888-8128

（20）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

客户服务热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

(21) 中信证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

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：张于爱

（二）注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

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

成立时间：1999 年 3 月

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：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：吕红

经办律师：吕红、安东

（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

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：薛竞、张鸿

二十二、 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

（一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据基金合同募集的基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1） 分享基金财产收益；
- （2） 参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3） 依法申请赎回其持有的基金份额；
- （4） 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5） 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6） 查阅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） 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- （9） 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1） 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- （2） 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- （3） 在其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其他基金合同当事人合法权益的活动；
- （5） 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金代销机构处获得的不当得利；

（6） 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（7） 基金份额持有人应遵守基金管理人及其代理销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

（8） 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1） 依法募集基金；

（2） 依照法律法规和基金合同运用基金财产；

（3） 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

（4） 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理人报酬，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其他事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；

（5） 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；

（6） 在本合同的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

（7） 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

（8） 自行担任注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，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；

（9） 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

（10） 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

（11） 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

（12） 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

（13） 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

（14） 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；

（15） 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（16）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；

（17）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（18）选择、更换或撤销境外投资顾问，并对其行为进行必要的监督；

（19）委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

（20）法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会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）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（3）办理基金备案手续；

（4）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；

（5）对境外投资顾问的挑选和委托过程中，承担受信责任，履行尽职调查义务，并确保境外投资顾问应符合《试行办法》规定的有关条件；

（6）确保基金管理人或其委托的境外投资顾问向基金托管人发送的交易数据真实、准确、完整，如因数据发送错误造成基金资产或基金托管人财产损失的，基金管理人应负责协调解决；

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

（8）委托境外证券服务机构代理买卖证券的，基金管理人应当严格履行受信责任，并按照有关规定对投资交易的流程、信息披露、记录保存进行管理；与境外证券服务机构之间的证券交易和研究服务安排，应当严格按照《试行办法》规定的原则进行；

（9）进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

（10）确保基金投资于中国证监会规定的金融产品或工具，严格按照《基金法》、《试行办法》、基金合同及有关法律法规有关投资范围和比例限制的规定，确定清晰、可执行的投资范围和投资比例，在规定时间内，对超范围、超比例的投资进行调整，并承担相应的责

任；

- （11）按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基金收益；
- （12）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；
- （13）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- （14）依法接受基金托管人的监督；
- （15）编制半年度和年度基金报告；
- （16）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额申购、赎回和转换价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- （17）计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- （18）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；
- （19）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、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以保密，不得向他人泄露；
- （20）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- （21）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同和其他相关资料；
- （22）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；
- （23）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实施其他法律行为；
- （24）组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- （25）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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- （26）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；
- （27）基金管理人对其委托投资顾问、第三方机构相关事项的法律后果承担责任。
- （28）法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他义务。

（三）基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- （1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- （2）依照基金合同的约定获得基金托管费；
- （3）监督基金管理人对本基金的投资运作和资金汇出入情况；
- （4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- （5）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；
- （6）选择境外资产托管人并与之签署有关协议；
- （7）法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- （1）安全保管或委托境外资产托管人安全保管基金财产；
- （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，负责基金财产境内托管事宜；
- （3）按规定开设或委托开设资金账户和证券账户；
- （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；
- （5）对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- （6）保管（或委托境外资产托管人）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）保护持有人利益，按照规定对基金日常投资行为和资金汇出入情况实施监督，如发现投资指令或资金汇出入违法、违规，应当及时向中国证监会、国家外汇管理局报告；
- （8）安全保护基金财产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；
- （9）确保基金按照有关法律法规和基金合同的规定进行认购、申购、赎回等日常业务；
- （10）确保基金根据有关法律法规和基金合同确定并实施收益分配方案；
- （11）按照有关法律法规和基金合同的规定以基金托管人名义或其指定的境外资产托管人名义登记资产；
- （12）每月结束后 7 个境内工作日内，向中国证监会和国家外汇局报告基金境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；

- （13）办理基金的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
- （14）保存基金的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年
- （15）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- （16）按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- （17）保守基金商业秘密。除《基金法》、《试行办法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- （18）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- （19）对基金财务会计报告、季度、半年度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；
- （20）保存基金份额持有人名册；
- （21）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，确保基金的份额净值按照有关法律法规和基金合同规定的方法进行计算；
- （22）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- （23）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；
- （24）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；
- （25）按照规定监督基金管理人的投资运作，确保基金按照有关法律法规和基金合同约定的投资目标和限制进行管理；
- （26）因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- （27）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；
- （28）对基金的境外财产，基金托管人可授权境外资产托管人代为履行其承担的受托人职责，选择的境外资产托管人应符合《试行办法》规定的有关条件；境外资产托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽等原因而导致基金财产受损的，基金托管人应当承担相应责任；
- （29）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；
- （30）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监

督管理机构，并通知基金管理人；

（31）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（32）法律法规、中国证监会和国家外汇局根据审慎监管原则规定的其他职责以及基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

（1）提前终止基金合同；

（2）转换基金运作方式；

（3）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；

（4）更换基金管理人、基金托管人；

（5）变更基金类别；

（6）变更基金投资目标、范围或策略；

（7）变更基金份额持有人大会程序；

（8）本基金与其他基金合并；

（9）对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

（10）法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况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）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

（3）经中国证监会允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

（5）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（6）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（7）在不违反法律法规的前提下，接受其他币种的申购、赎回；

（8）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集方式

（1）除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

（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。

（3）代表基金份额百分之十以上（“以上”含本数，下同）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，代表基金份额百分之十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）代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项书面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，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

（5）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。

（6）基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明

以下内容：

（1）会议召开的时间、地点、方式；

（2）会议拟审议的主要事项；

（3）投票委托书的内容（包括但不限于代理人身份、授权范围、授权的有效期限等）、送达时间和地点；

（4）会务常设联系人姓名、电话；

（5）权益登记日；

（6）如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

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。基金管理人或基金托管人不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

6、开会方式

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。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，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，基金管理人或基金托管人不派代表出席的，不影响表决效力；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。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、转换基金运作方式和提前终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者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、本基金合同和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同规定公告会议通知后，在两个境内工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的

基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的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；

（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的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个境内工作日后），且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。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同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弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

7、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

①议事内容限为本条前述第 2 款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

②基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额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份额持有人大会审议表决的提案。

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。

④ 单独或合并持权益登记日基金总份额 10%或以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

⑤ 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。

（2）议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个境内工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

8、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

① 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

② 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上（含百分之五十）通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或提前终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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。

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。

9、计票

（1）现场开会

① 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，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中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人担任）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中推举三名基金份额持有人担任监票人。

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，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其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。重新清点仅限一次。

④ 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关规定表决通过的事项，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。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。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议。

（3）基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或备案后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在指定媒体公告。

（4）如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

11、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、基金合同的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过事项的。

（2）变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

（3）但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利

益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公告，并报中国证监会备案。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （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、基金托管人承接的；
- （3）法律法规和基金合同规定的其他情形。

3、基金财产的清算

（1）基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金财产进行清算。

（2）基金财产清算组

①自基金合同终止事由之日起三十个境内工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

（3）清算程序

- ①基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- ②基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- ③基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- ④对基金财产进行评估和变现；
- ⑤制作清算报告；
- ⑥聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- ⑦将清算报告报中国证监会备案并公告。
- ⑧对基金财产进行分配。

（4）清算费用

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

（5）基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- ①②③支付清算费用；
- ②交纳所欠税款；
- ③清偿基金债务；
- ④按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款①、②、③项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（6）基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

（7）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

四、争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议应首先通过友好协商解决。但若自一方书面要求协商解决争议发生之日起 60 日内未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费由败诉方承担。

五、基金合同的效力

1、本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件，应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立，于基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

2、本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

3、本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、本基金合同正本一式八份，除上报有关监管机构一式四份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

六、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资者查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

二十三、 基金托管协议的内容摘要

（一）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

2、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同中实际可以监控事项的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

（1）对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

（2）对基金投融资比例进行监督。

（3）对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单。基金托管人和基金管理人均有责任保证该名单的真实、准确和完整性，并及时将更新后的名单发送给对方。

（4）基金管理人向基金托管人提供其回购交易及监督所需的其他投资品种的交易对手库，交易对手库由信用等级符合《通知》要求的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人进行金融衍生品、证券借贷、回购交易时，交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对交易对手是否符合交易对手库进行监督。

（5）基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督。

（6）对法律法规规定及基金合同中实际可以监控事项约定的基金投资的其他方面进行

监督。

2、基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等。进行业务监督、核查。

3、基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时通知基金管理人，由基金管理人限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

4、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

5、基金托管人对投资管理人对基金资产的投资运作于估值日结束且相关数据齐备后，进行交易后的投资监控和报告。

6、基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性受限于基金管理人及其他中介机构提供的数据和信息，基金托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

7、基金托管人对基金管理人的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)及其投资回报不承担任何责任。

（三）基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、基金合同及本协议有关规定时，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对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

- （1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （2）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、基金合同及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的所有资金账户和证券账户。
- （4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- （5）基金托管人可将基金财产安全保管和办理与基金财产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。
- （6）现金账户中的现金由基金托管人或其境外托管人以银行身份持有。
- （7）托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例，支付现金、办理证券登记等托管业务。

2、基金募集期间及募集资金的验资

- （1）基金募集期间的资金应存于基金管理人开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人以基金管理人的名义开立并管理。
- （2）基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合基金合同及其他有关规定后，基金管理人应在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。验资完成后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立并指定的基金托管银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

（3）若基金募集期限届满，未能达到基金合同及其他有关规定的生效条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金银行账户的开立和管理

- （1）基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- （2）基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。

（3）本基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户，亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

（4）基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。

4、基金证券账户的开立和管理

（1）基金托管人在基金所投资市场的交易所或登记结算机构或境外资产托管人处，按照该交易所或登记结算机构的业务规则开立证券账户。

（2）基金证券账户的开立和使用，仅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以及各自委托代理人均不得出借擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金证券账户的开立和证券账户相关证明文件的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

（4）基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

5、其他账户的开立和管理

（1）因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或境外资产托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

（2）投资市场所在国家或地区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。

6、基金财产投资的有价凭证的保管

基金财产投资的有价凭证的保管按照实物证券相关规定办理。

7、与基金财产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金财产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 20 年。

（五）基金资产净值计算和会计核算

基金资产的净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行。

1、基金资产净值的计算和复核

（1）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。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后的价值。

（2）复核程序

基金管理人每个工作日对基金进行估值，估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。每个工作日 12:00 之前，基金管理人将前一日的基金估值结果以书面形式报送基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在当日 18:00 之前盖章或签字后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人定期对外公布。基金月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（3）当相关法律法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

（5）当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应向中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

（6）如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在偏差在 0.25%份额净值以内的，基金份额净值以基金管理人的计算结果为准，基金管理费和基金托管费也应以基金管理人的净值计算结果计提。

（7）由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

（8）由于证券交易所及其登记结算公司及其他中介机构发送的数据错误，或由于其他

不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和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。

（9）如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

2、基金会计核算

（1）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

（2）会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

（3）基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个境内工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个境内工作日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于每个季度结束之日起 15 个境内工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 45 日内，由基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 70 日内，基金管理人将编制完毕的报告送交基金托管人复核，并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告，半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个境内工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个境内工作日内完成复核，并将复核结果书面

通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个境内工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

（六）基金份额持有人名册的保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

2、基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个境内工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5 个境内工作日内向基金托管人提供。

3、基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、基金合同和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行基金合同和本协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。

（七）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会现时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应各自继续履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（八）托管协议的修改、终止与基金财产的清算

1、托管协议的修改程序

本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。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。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

2、基金托管协议终止出现的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金合同终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）本基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

3、基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照基金合同及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

二十四、 基金份额持有人服务

基金管理人为基金份额持有人提供以下一系列的服务。基金管理人有权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，增加、修改服务项目：

一、 基金份额持有人注册登记服务

基金管理人委托或作为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，则该基金份额持有人当期分配所得基金收益将按除息日的基金份额净值自动转为基金份额，且不收取任何费用。

三、 定期投资计划

在条件成熟时，基金管理人可通过代销机构和网上直销为基金份额持有人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金份额持有人可以通过固定的渠道，定期申购基金份额，该定期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

基金管理人通过邮寄、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，包括邮寄季度交易对账单、发送月度电子对账单、交易确认的电子邮件和短信通知、对账单寄送失败的电子邮件或短信通知、公司公告及重要信息的电子邮件或短信主动通知等服务。

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 小时自助语音服务、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：

自助语音及网上查询：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、资料索取服务

为方便份额持有人办理各种交易手续，同时方便客户了解长盛基金，基金管理人提供了资料索取服务。

基金份额持有人可通过客户服务热线转人工索取以下信息：直销业务表格、封闭式及开放式基金公告、任意交易时间段内对账单、个人资产证明及我公司其它对外公布信息。客户服务人员将通过传真、EMAIL 及邮寄形式提供以上索取信息。

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

为进一步提升服务品质，满足客户个性化需要，基金管理人推出全方位资讯服务定制计划。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 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、月度电子对账单、电子成交确认单、短信成交通知、持有基金每周净值短信、临时公告短信等。

基金管理人每日发送不同资讯，内容不仅全方位涵盖了公司全部可披露信息，而且包含市场的最新信息、深度新闻资讯及基金管理人的市场判断、操作等。

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为客户解答疑问，提供关于基金投资全方位的咨询服务。同时，还提供在线交流及手机短信交流。

十、投诉建议受理

如果基金份额持有人对基金管理人提供的各项服务有疑问，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等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、互动活动

基金管理人为基金份额持有人定期或不定期地举办各种互动活动如基金份额持有人见面会、理财讲座，以加强基金份额持有人与基金公司间的互动联系。

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

二十五、 其他应披露事项

- （一）本基金管理人目前无重大诉讼事项。
- （二）近3年基金管理人及其高级管理人员没有受到任何处罚。
- （三）2010年12月15日本基金管理人发布关于增加信达证券为旗下部分基金代销机构、推出定期定额申购业务及费率优惠活动的公告。
- （四）2010年12月23日本基金管理人发布关于QDII基金节假日暂停申购和赎回业务的公告（圣诞节）。
- （五）2011年1月5日本基金管理人发布长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书（更新）及其摘要。
- （六）2011年1月11日本基金管理人发布长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金收益分配公告。
- （七）2011年1月17日本基金管理人发布关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告。
- （八）2011年1月24日本基金管理人发布长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金2010年第4季度报告。
- （九）2011年2月21日本基金管理人发布关于长盛QDII基金节假日暂停申购和赎回业务的公告。
- （十）2011年3月28日本基金管理人发布关于增加中信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告。
- （十一）2011年3月31日本基金管理人发布长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金2010年年度报告及其摘要。
- （十二）2011年4月1日本基金管理人发布长盛基金管理有限公司关于开通汇付天天盈网上直销业务的公告。
- （十三）2011年4月12日本基金管理人发布关于旗下部分基金参与银河证券基金申购、定投业务费率优惠活动的公告。
- （十四）2011年4月21日本基金管理人发布长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金2011年第1季度报告。

（十五）2011 年 4 月 22 日本基金管理人发布关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告。

（十六）2011 年 4 月 29 日本基金管理人发布关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告。

（十七）2011 年 5 月 10 日本基金管理人发布长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告。

（十八）2011 年 5 月 13 日本基金管理人发布长盛基金管理有限公司关于开通旗下开放式基金在中信证券定期定额投资业务的公告。

（十九）2011 年 5 月 14 日本基金管理人发布长盛基金管理有限公司总经理变更公告。

二十六、 招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复制件或复印件，但应以招募说明书正本为准。

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。

二十七、 备查文件

以下备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

- 一、中国证监会批准长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金设立的文件
- 二、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》
- 三、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》
- 四、《长盛基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 五、法律意见书
- 六、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 七、基金托管人业务资格批件、营业执照

长盛基金管理有限公司

二〇一一年六月二十八日