

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

基金合同内容摘要

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

第一部分 基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

一、基金管理人

（一）基金管理人简况

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

成立日期：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】6 号

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；及中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

（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）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

(17) 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) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(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) 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；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产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；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 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；

(12) 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保密，不向他人泄露；

(13) 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；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

(19) 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并通知基金托管人；

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

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(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) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 按照基金合同约定履行保本义务，严格遵守《基金合同》中有关保本和保本条款的约定。保本周期到期日若发生需要保本赔付的情形，基金管理人应于保本周期到期日后向基金份额持有人履行保本赔付差额的支付义务；基金管理人不能全额履行保本赔付差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后书面要求担保人按时履行保本赔付差额的支付义务。如相应款项未按时到账，基金管理人应当履行催付职责，严格遵守本基金《基金合同》中有关保本内容的相关约定；

(28) 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、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

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

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

（二）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）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 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，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的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账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 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；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，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；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 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；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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；

(15) 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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 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监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 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。

三、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，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或仲裁；

(9) 基金管理人及担保人未履行保本义务及保证责任时，直接向基金管理人或担保人追偿；

(10) 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) 认真阅读并遵守《基金合同》；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 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；

(6) 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；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(8) 返还在基金交易过程中因各种原因获得的不当得利；

(9) 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。

第二部分 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》，但基金合同另有约定的除外；

(2) 更换基金管理人、更换基金托管人；

(3) 保本周期内更换担保人，但因担保人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义务的除外；

(4) 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但在保本周期届满时本基金在不符合保本基金存续条件的情况下按照基金合同约定变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”并按基金合同约定的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的管理费率和托管费率计提管理费和托管费的以及根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(6) 变更基金类别，但在保本周期届满时本基金在不符合保本基金存续条件的情况下按照基金合同约定变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本周期届满时本基金在不符合保本基金存续条件的情况下本基金按照基金合同约定变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”并按基金合同约定的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的投资目标、投资范围和投资策略执行以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《基金合同》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。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，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) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

- (4) 某一个保本周期结束后，保持或变更下一个保本周期的保本保障机制；
- (5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (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或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (7) 某一保本周期结束后，基金管理人有权更换下一保本周期的担保人，更换后的担保人为本基金下一保本周期提供的担保不得影响基金份额持有人在基金合同项下享有的保本条款，此项变更无需召开基金份额持有人大会决议通过；
- (8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

二、会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、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 10 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 60 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，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10% 以上（含 10%）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，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 10 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 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）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 10 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 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召

开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、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表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席,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份额持有人大会,基金管理人或托管人不派代表列席的,不影响表决效力。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、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

(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,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 50% (含 50%)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1)会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后,在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

(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,基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%);

(4)上述第(3)项中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代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记注册机构记录相符;

(5)会议通知公布前报中国证监会备案。

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额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份额持有人大会召开前及时公告。

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

(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七条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，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

(2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表

决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项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，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》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，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，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。

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。

七、计票

1、现场开会

（1）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和代理人中选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共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（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）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大

会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒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。

八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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。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、基金托管人均有约束力。

九、保本周期内变更担保人所需召开持有人大会

在保本周期内变更担保人，需召开持有人大会，由基金管理人召集，召集方式、通知、开会方式、议事内容与程序、表决、计票及公告程序应符合上述基金份额持有人大会的相关规定。

在保本周期内，基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过变更担保人的事项，基金管理人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案，自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金管理人依据基金份额持有人大会的决议及证监会依法核准意见履行变更基金担保人程序（见基金合同第十三部分），且原担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任的担保人承担。

第三部分 基金的保本

（一）保本

本基金对适用保本条款的基金份额持有人投资净额(本基金募集期内投资者的净认购金额及认购利息,在过渡期内进行过渡期申购的投资者申购的基金份额在折算日所代表的资产净值以及由本基金上一个保本周期结束后默认转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额在折算日所代表的资产净值)提供本金保证。

在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期默认选择转入当期保本周期的基金份额持有人持有本基金到当期保本周期到期的,如可赎回金额加上保本周期内的累计分红金额低于其投资净额,则基金管理人或担保人应补足该差额,并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人。本基金第一个保本周期的担保人对此提供不可撤销的连带责任保证。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期内申购的或转换转入的基金份额不适用本条款。

认购保本金额 = 基金持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额。

过渡期申购保本金额 = 基金持有人过渡期申购并持有到期的基金份额的投资净额,即基金份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值。

从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额 = 基金份额持有人将其上一保本周期持有到期的基金份额转入当期保本周期并持有到期的,其基金份额在折算日所代表的资产净值。

对于基金持有人多次认购或申购、赎回的情况,以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

（二）适用保本条款的情形

1、对于本基金第一个保本周期而言,基金份额持有人在本基金募集期内认购并持有当期保本周期到期的基金份额。

2、对于本基金第一个保本周期后的保本周期而言,基金份额持有人在本基金过渡期限定期限内申购并持有当期保本周期到期的基金份额、基金份额持有人从本基金上一个保本周期默认选择转入当期保本周期并持有当期保本周期到期

的基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额）。

3、对持有当期保本周期到期的基金份额，基金份额持有人可以做出如下选择，其投资净额在保本周期到期时都适用保本条款：

（1）在保本周期到期赎回限定期内赎回基金份额；

（2）在到期赎回限定期内从本基金转换到管理人管理的其他基金；

（3）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有本基金份额转入下一个保本周期；

（4）保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有的本基金份额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额。

（三）不适用保本条款的情形

1、在当期保本周期到期日符合条件的基金份额持有人的可赎回金额加上其在当期保本周期期间的累计分红金额，不低于基金份额持有人的投资净额；

2、基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额；

3、基金份额持有人在本基金募集期间认购的、基金份额持有人在本基金过渡期限定期限内申购或者基金份额持有人从本基金的上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的、但在到期赎回限定期前赎回或转换转出的基金份额；

4、在保本周期到期日后基金份额发生的任何形式的基金份额净值减少；

5、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；

6、在保本周期内，本基金更换基金管理人，担保人不同意担保的情形；

7、发生不可抗力事件，导致本基金投资亏损或导致基金管理人或担保人无法履行保本义务。

第四部分 担保

为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金第一个保本周期由安徽省信用担保集团有限公司作为担保人。由基金管理人代表基金份额持有人与担保人签署《保证合同》。

（一）担保人基本情况

名称：安徽省信用担保集团有限公司

法定代表人：钱正

注册地址：合肥市长江西路 200 号

邮政编码：230031

成立日期：2005 年 11 月 25 日

注册资本：28.66 亿元人民币

联系人：袁野

联系电话：0551-5227521

经营范围：为中小企业提供担保，为担保机构提供再担保服务，项目投资，资本运作，资产管理及咨询服务，信用评级，财务顾问，商务信息咨询。

担保人简介：

安徽省信用担保集团有限公司于 2005 年 11 月 25 日成立，是安徽省政府批准设立的国有独资专业担保机构，注册资本 28.66 亿元。截止到 2012 年 3 月 31 日，安徽省信用担保集团有限公司总资产 45.7 亿元，净资产 35.5 亿元，累计实现净利 5.94 亿元。

截至 2012 年 3 月 31 日，安徽省信用担保集团有限公司对外直接担保在保余额 147.22 亿元，其中：长盛同鑫保本混合型证券投资基金期末保本份额：1816848957.71 份。

（二）《保证合同》

1. 《保证合同》

基金管理人为本基金第一个保本周期的保本与担保人签署《保证合同》。《保证合同》的全文详见基金合同的附件。《保证合同》中涉及基金份额持有人利益的主要内容如下：

甲 方：长盛基金管理有限公司

乙 方：安徽省信用担保集团有限公司

（1）担保额度

担保额度是指乙方同意为甲方向基金份额持有人提供担保的最高金额。

根据甲方的申请和项目实际情况，乙方授予甲方人民币 51 亿元的担保额度。

在担保额度内，在符合本合同约定的条件下，甲方对基金份额持有人所负债务将由乙方为其提供保证担保，乙方的保证责任以本合同为准。

(2) 保证的范围

本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本金额为：认购并持有到期的基金份额的净认购金额及募集期间的利息收入之和，即投资净额。

保证范围为按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额的差额部分。

基金份额持有人在保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的基金份额不在保证范围之内。

乙方承担保证责任的最高限额为人民币 51 亿元。

(3) 保证期间

基金保本周期到期日起六个月。

(4) 保证的方式

在保证期间，乙方在保证范围内承担连带责任保证。

(5) 保证受益人

认购本基金并持有到期的基金份额持有人。

(6) 除外责任

下列任一情形发生时，乙方不承担保证责任：

1) 在保本周期到期日，按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额；

2) 基金份额持有人认购，但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出本基金的基金份额；

3) 基金份额持有人在本保本周期内申购或转换转入的基金份额；

4) 在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；

5) 在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且乙方不同意继续承担保证责任；

6) 保本周期到期日之后(不包括该日)，基金份额发生的任何形式的净值减

少；

7) 发生不可抗力事件，导致保本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务；

8) 未经担保人书面同意修改基金合同条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

(7) 到期偿付制度安排

1) 到期保本偿付准备及代偿准备

保本偿付准备：

a. 甲方应按照基金合同中的到期赎回制度安排基金资产的变现操作，准备资金应对持有人的赎回；

b. 甲方应在本基金保本周期到期日前 30 个日历日当日预测本基金是否可能发生到期保本偿付，并向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。甲方应自本基金保本周期到期日前 30 个日历日起每周做出预测并应于每周周末之前向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。《保本到期前报送信息》的内容应包括基金资产累计净值、预计到期偿付金额、甲方在保本周期到期日可调度的自有资金总额等数据；

c. 甲方应不迟于保本周期到期日前 6 个月在托管银行开设独立帐户，与乙方共管。从保本周期到期日前 30 个日历日开始，其中任一工作日，保本基金按保证本金要求测算后，若出现不足保证本金的差额，甲方应在次工作日向上述共管账户划转相应金额的风险准备金，以补平上述差额。

代偿准备

a. 在保本周期到期日前 30 个日历日当日，如甲方预测保本周期的到期日甲方可能依据基金合同的约定承担保本责任，且乙方可能依据本合同承担保证责任的，则甲方应在首份及其后的《保本到期前报送信息》中同时向乙方书面通知经预测的需要乙方代偿的金额，提示乙方准备资金；

b. 在保本周期到期日后五个工作日内，甲方不能全额履行保本义务，则甲方应将保本周期到期日的基金资产累计净值、经计算得出的应向基金份额持有人支付的金额、已自行偿付的金额以及需乙方代偿的金额向乙方发出书面《履行保证责任通知书》。《履行保证责任通知书》的格式和内容见附件。

2) 偿付顺序

在保本周期到期日，如根据基金合同甲方需承担保本责任，且根据《保证合同》乙方需要承担保证责任的，则保本差额部分按照下列顺序偿付：

《保证合同》第 6.1.1 (3) (即上文“ 保本偿付准备 ”的 c 项) 约定的共管帐户内的风险准备金；

甲方的自有资金；

乙方资金。

乙方在接到甲方书面《履行保证责任通知书》及相关数据资料后五个工作日内将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户，乙方将上述代偿金额足额划入本基金在基金托管人处开立的指定账户中后即视为全部履行了保证责任，代偿款项的分配与支付由甲方负责。

3) 基金份额持有人追偿的权利及其程序、方式

在担保人逾期未能履行保证责任的情况下，基金份额持有人在保证期间内有权委托基金管理人代表基金份额持有人要求乙方按照本合同的约定履行保证责任。但要求担保人承担保证责任的，应在保证期间内提出。

3. 基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意《保证合同》中的约定。

(三) 担保费用及支付方式

担保人为本基金提供保证收取的担保费用不从基金财产中列支。担保费用的费率由基金管理人与担保人协商确定，并以基金管理人的自有资产承担。

担保费从基金管理人收取的本基金管理费中列支，每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付。基金管理人应自每季收到基金管理费之日起 2 个工作日内向乙方支付担保费。基金当期保本周期到期转下一保本周期的过渡期内，即申购限定期，基金管理人 不支付担保费。

每日担保费=担保费计提日前一 日基金资产净值 × 0.2% × 1/当年日历天数

在法律法规允许的前提下，基金管理人依法履行适当程序后，担保费可从基金财产中列支。

(四) 担保的性质和担保范围

本基金保本担保的范围为：

在保本周期到期时，符合条件的基金份额持有人持有当期保本周期到期的基

金份额的可赎回金额加上当期保本周期内本基金的累计分红金额,低于投资净额时的差额部分。符合条件的基金份额持有人,对于第一个保本周期而言是指在本基金的募集期间认购本基金的基金份额持有人,对于第一个保本周期后各保本周期而言是指在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人。

担保人为本基金第一个保本周期承担的连带责任保证的金额最高不超过 51 亿元人民币。本基金第一个保本周期后各保本周期的担保人、担保方式及担保额度,由基金管理人在当期保本周期开始前公告。

(五) 影响担保人担保能力情形的处理

保本周期内,担保人出现足以影响其履行《保证合同》项下担保责任能力的情形的,应在该情形发生之日起 3 日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人应在在接到通知之日起 3 个工作日内将上述情况报告中国证监会并提出处理办法,包括但不限于加强对担保人担保能力的持续监督、及时提取风险准备金、当确定担保人丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况下根据基金合同约定的程序更换担保人等。基金管理人还应在同时通知基金托管人并在接到通知之日起 3 个工作日内在指定媒体上公告上述情形。确定担保人丧失保证能力的,基金管理人应在 15 个工作日内召集基金份额持有人大会,就如下事项进行表决:

- 1、更换担保人;
- 2、变更基金类别;
- 3、基金合同终止;
- 4、法律法规或中国证监会规定的其他事项。

(六) 担保人的更换

保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过,但因担保人发生合并或分立,由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义务的除外。更换担保人的,原担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任的担保人承担。在新的担保人接任之前,原担保人应继续承担担保人责任。某一保本周期结束后,基金管理人有权更换下一保本周期的担保人,更换后的担保人为本基金下一保本周期提供的担保不得影响基金份额持有人在基金合同项下享

有的保本条款，此项变更无需召开基金份额持有人大会决议通过。

保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。

保本周期内更换担保人的程序：

1、提名

新任担保人由基金管理人提名。

基金管理人提名的新任担保人必须符合如下条件：(1)具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件；(2)符合基金份额持有人的利益。

2、决议

基金份额持有人大会对被提名的新任担保人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 1/2 以上（含 1/2）表决通过。

3、备案

基金份额持有人大会选任新任担保人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行。

4、签订《保证合同》

更换担保人经中国证监会核准后，基金管理人与新任担保人签订《保证合同》。

5、公告

基金管理人在中国证监会核准后 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。

6、交接

原担保人职责终止的，原担保人应妥善保管保本周期内保证业务资料，及时向基金管理人和新任担保人办理保证业务资料的交接手续，基金管理人和新任担保人应及时接收。

保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前，原担保人应继续承担保证责任。

(七) 担保人免除保证责任的情形

除本部分第(六)款所指的担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任的担保人承担的情况以及本部分第(二)款第1项《保证合同》主要内容的“除外责任”所列明的免责情形外,不得免除担保责任。

保本周期届满时,担保人同意继续为本基金提供担保或基金管理人认可的其他机构继续为本基金的保本提供连带责任保证或者风险买断担保或者中国证监会认可的其他担保方式,同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的,本基金将转入下一保本周期;否则,本基金变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”,担保人不再为本基金承担担保责任。

(八) 担保责任的履行

基金份额持有人同意授权基金管理人作为其代理人代为行使向担保人索偿的权利并办理相关的手续(包括但不限于向担保人发送履行担保责任的书面通知及代收相关款项等)。如果符合《基金合同》第十二部分第(二)款“适用保本条款的情形”的基金份额在保本周期到期日的可赎回金额加上其在当期保本周期内的累计分红金额之和低于其投资净额的,且基金管理人无法全额履行保本义务或基金管理人不承担保本义务的,基金管理人在保本周期到期日后五个工作日内,向担保人发出书面《履行保证责任通知书》(应当载明需担保人代偿的金额)。担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的五个工作日内,将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户中,由基金管理人将该差额支付给基金份额持有人。若担保人未履行全部或部分保证责任的,基金份额持有人有权直接就差额部分向担保人追偿。担保人将上述代偿金额足额划入本基金在基金托管人处开立的指定账户中后即视为全部履行了保证责任,担保人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责,担保人对此不承担责任。

第五部分 基金收益分配原则、执行方式

一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额,基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金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、基金收益分配方式：

(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

(2) 本基金变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”后：基金收益分配方式分为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；

2、基金收益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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额；

3、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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即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截止收益分配基准日的可供分配利润、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 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

六、基金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再投资的费用；

2、基金收益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。

如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，则前述银行转账等手续费用由相应销售机构（基金管理人或代销机构）承担；

3、若基金转型为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，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自动转为基金份额。

第六部分 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用、证券账户等的开户费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、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。

二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 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

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本基金当期保本周期到期转下一保本周期的过渡期内，即申购限定期，不收取基金管理费和基金托管费。

4、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法同上。

上述“一、基金费用的种类中第 3 - 7 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第七部分 基金财产的投资方向和投资限制

若本基金在当期保本周期内或保本周期到期自动转为下一保本周期，基金的投资适用如下约定：

（一）投资目标

本基金采用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，实现组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金将按照组合保险策略将资产配置于稳健资产与收益资产。本基金投资的稳健资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据、中期票据、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议、银行存款等），以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资的收益资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等。

本基金在保本期内投资债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于 5%；投资股票、权证等收益资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

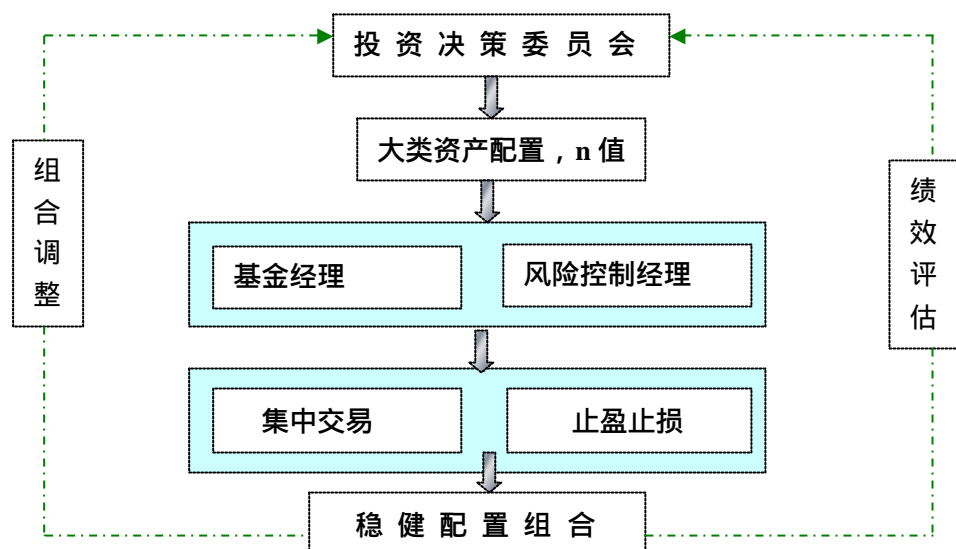
（三）投资理念

在严格有效的风险控制的前提下，追求保本期间稳健收益的最大化。

（四）投资管理流程

我公司具有一套完整、规范的投资流程，贯穿研究、战略性资产配置、战术配置、风险控制、业绩评价等各个环节，通过有力的衔接和反馈机制把各环节联结为一个整体，保证本基金运作的可靠性、一致性和风险可控性。我公司保本

基金投资流程图如下：



由于保本基金产品高度强调资产配置的科学与投资决策的纪律性，严格运用金融工程手段以有效控制风险，其投资管理在遵循公司成熟的投资流程框架（投决会领导下的基金经理负责制为流程核心）的同时，还具有以下有别于公司旗下其他基金/组合管理流程的鲜明特点：

1、基金经理和风控经理负责制

严格量化的风险控制机制是保证保本基金产品成功运作的关键，因此，本保本基金运作管理在传统基金经理基础上，增设风险控制经理一职，具体负责执行投决会对风险投资额度和大类资产配置比例的决议，协调金融工程小组工作，跟踪组合 VaR 值变化，从风险控制的精确数量化角度对组合提出优化措施。

2、严格的投资纪律

为保证投资纪律性，防止市场波动时基金经理的情绪化投资决策，当组合风险暴露头寸达到警戒比例时，经投决会批准后，投资管理系统将启动止盈止损程序，通过对风险资产进行整体比例减持或具体投资品种进行强制止盈止损，来确保已实现投资收益或减少已可能的投资损失，从制度上避免组合在投资期内大幅急剧波动，实现保本基金稳健投资目标。

（五）投资策略

本基金采用恒定比例组合保险策略（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）和基于期权的组合保险策略（OBPI，Option-Based Portfolio Insurance），其中主要通过 CPPI 策略动态调整稳健资产与收益资产的投资比例，以确保在保

本期到期时本基金价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。

1、CPPI 投资策略与资产配置

根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动、组合安全垫(即基金净资产超过基金价值底线的数额)的大小动态调整稳健资产与收益资产投资的比例,通过对稳健资产的投资实现保本期到期时保本金额的安全,通过对收益资产的投资寻求保本期间资产的稳定增值。本基金对稳健资产和收益资产的资产配置具体可分为以下四步:

第一步:确定稳健资产的最低配置比例。

根据保本期末投资组合最低目标价值(本基金的最低保本值为保本金额的100%)和合理的贴现率,设定当期应持有的稳健资产的最低配置数量和比例,即投资组合的安全底线。

$$P_t = PV(P_T) = P_T e^{-r(T-t)}$$

其中: P_t 为当期稳健资产现值, P_T 为保本期末投资组合最低目标价值, r 为贴现率, T 为到期时间, t 为当前时间。

第二步:计算投资组合的安全垫(Cushion),即投资组合净值超过安全底线的数额。

$$C_t = V_t - P_t$$

其中: C_t 为组合安全垫, V_t 为当期投资组合净值。

第三步:确定收益资产的最高配置比例。

根据组合安全垫和收益资产风险特性,决定安全垫的放大倍数——风险乘数,然后根据安全垫和风险乘数计算当期可持有的收益资产的最高配置比例,其余资产投资于稳健资产。

$$E_t = nC_t = n(V_t - P_t)$$

其中: E_t 为当期持有的收益资产上限, n 为放大倍数, $0 < n < 5$ 。

其中放大倍数主要根据当期权益类市场的估值情况、宏观经济运行情况、债券市场收益率水平、基金资产的风险承受能力等因素进行动态调整。

第四步：动态调整稳健资产和收益资产的配置比例。

根据安全垫水平、市场估值情况，并结合市场实际运行态势制定收益资产投资策略，进行投资组合管理，实现基金资产在保本基础上的增值。

2、OBPI 投资策略与资产配置

OBPI 策略主要根据期权的收益特性进行构建，其主要投资思路为在投资期初同时购买风险资产(如：股票)和相应的看跌期权，当股票价格下跌时，可执行看跌期权，以规避股票价格的下跌，当股票价格上涨时，则放弃使用看跌期权，以享受正股价格上行的收益。从投资效果分析，OBPI 的投资目标为一方面可以享受市场上涨时的收益，另一方面又可以锁定市场下跌时的损失。从这个角度出发，OBPI 策略的核心思想为构建一个投资组合，使其下行风险可控，上行可享受投资收益。

而根据期权平价公式，OBPI 策略可由股票和看跌期权的投资组合衍生出另一种投资策略，即通过买入无风险资产和看涨期权以锁定下行风险，具体的决策过程可以通过以下公式推演得到：

$$Call + Xe^{-rt} = Put + S$$

其中：Call 为看涨期权， Xe^{-rt} 为无风险资产，X 为期权的执行价格，S 为股票，Put 为看跌期权。

从上式看出，本基金可以通过不同类型的组合配置实现两类 OBPI 投资策略，一是构建债券组合和看涨期权的组合，即可转换公司债券投资；二是在投资看跌权证时，可在买入该权证的同时，买入权证对应的股票类资产。通过以上两种不同的资产组合来实现下行风险可控，上行可享受投资收益的投资目标。

3、股票投资策略

本基金在构造股票组合时，采取自上而下的方法，定量分析与定性分析相结合，通过组合管理有效规避个股的非系统性风险，通过行业精选确定拟投资的优势行业及相应比例，通过个股选择，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。

股票选择标准：

1) 建立以行业基本面、上市公司基本面、行业二级市场相对投资价值、分析师建议等因素为基础的多因素行业综合评估模型，对各行业的超额收益潜力进

行打分和排序，初步确定当期拟进行投资的优势行业；

2) 建立成长企业甄别模型，选出优势行业中具有可持续成长性的上市公司；

3) 建立成长企业相对定价模型，对潜力公司进行相对价值评估，根据相对价值排序确定股票投资组合的初选方案；

4) 对初选股票组合中上市公司的财务结构、市场表现进行细致分析，结合上市公司调研等手段确定最终的股票组合。

本基金将谨慎参与新股申购。在进行新股申购时，基金管理人将结合数量化模型，使用现金流贴现模型等方法评估股票的内在价值，充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果，对于拟发行上市新股（或增发新股）的价值进行深入发掘，评估申购收益率，并通过对申购资金的积极管理，制定相应的申购和择时卖出策略以获取较好投资收益。

4、债券投资策略

在债券投资方面，通过投资于剩余期限与避险周期基本匹配的债券，规避利率、收益率曲线、再投资等各种风险，控制企业债信用风险，并注重利用市场时机、无风险套利、利率预测以及低估值等策略，获取债券投资收益。

（1）利率策略

利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略，例如：子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

（2）类属策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债券等不同债

券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

（3）信用策略

信用策略主要是分析企业债券发行人所处行业发展前景，发行人业务发展状况，企业市场地位，财务状况，管理水平，债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险。根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券的信用风险利差。对企业债券信用级别的研判与投资，主要是发现信用风险利差上的相对投资机会，而不仅是绝对收益率的高低。

（4）选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

5、可转债投资策略

本基金在具体的投资过程中，将综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上，采用 Black-Scholes 期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，并且其基础股票的基本面优良、具有较好盈利能力或成长前景、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种，以合理价格买入并持有，根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转换公司债券投资组合，获取稳健的投资回报。

此外，本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值，通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求选择被市场低估的品种，来构建本基金可转换公司债券的投资组合。

6、权证投资策略

本基金将在理论框架的基础上，遵循法律法规的相关规定，运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。

对于法律法规或者监管部门允许投资的其他品种，本基金按照有关规定进行投资。

7、资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述多种因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

（六）业绩比较基准

3 年期银行定期存款税后收益率。

本基金是保本混合型基金产品，保本周期为 3 年。以基金合同成立日所在年度的中国人民银行公布的 3 年期银行定期存款基准利率的税后收益率为计算基准。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告。

（七）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、

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；

(7) 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；

(8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

基于本基金的产品属性，通过兼顾组合投资和分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(5) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(8) 本基金在保本期内投资债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%；投资股票、权证等收益资产占基金资产的比例不高于 40%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资比例限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(九) 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六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，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

(十) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

若本基金保本周期到期后变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，则基金的投资适用如下约定：

(一) 投资目标

本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票，追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。

(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市各类股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、中期票据、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议、银行存款等）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

投资组合比例为：权益类资产（即股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为 40%-95%；其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产比例为 0%-40%，其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于

基金资产净值的 5%。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

(三) 投资策略

本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略,重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司,同时考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险,通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。

1、资产配置

对宏观经济的经济周期进行预测,在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断,确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中,本基金管理人采用经济周期资产配置模型,通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析,对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测,然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

2、行业配置

不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值与投资时机,据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业,把握行业景气轮换带来的投资机会。

具体操作中,首先考察各行业历史收入和利润增长表现,对未来行业收入增长率和行业平均利润增长率进行预测;然后对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序,挑选出未来一段时间内最具增长前景的行业。具体评估将从宏观经济环境、行业景气度分析和预测、行业财务状况和行业竞争力综合表现四个方面入手,采用定性分析结合定量分析的方法对行业的未来的增长前景进行综合评价。

最后,在完成对行业增长预测和行业综合评价基础上,通过市场及各个行业的相对和绝对估值水平 PE、PB 等数据的横向、纵向分析,进行估值比较,并跟踪各行业的资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力,动态把握行业板块轮换蕴涵的投资机会。

3、股票选择

(1) 中小盘股票的定义

基金管理人自成立及期后每六个月月末将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到 A 股总流通市值 2/3 的这部分股票称为中小盘股票。在前后两次调整排序期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其流通市值（对未上市新股而言为本基金管理人预计的流通市值）可满足以上标准，也称为中小盘股票。

一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。当权威的证券数据服务机构能够提供可供投资者在公开股票市场上买卖的自由流通股本数据时，本基金管理人可采取自由流通股本乘以收盘价计算流通市值。

基金因所持有股票价格的相对变化而导致中小盘股票投资比例低于基金合同规定的范围，本基金管理人将根据市场情况，本着投资者利益最大化的原则，适时予以调整，最长不超过 3 个月。如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前公告变更后具体的计算方法。

(2) 股票投资策略

本基金综合运用长盛股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，中小盘股票中的优势股票优先入选。具体分以下两个层次进行股票挑选：

1) 品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理上符合基本要求的上市公司，构建备选股票池，主要筛选指标包括：估值比较（PE、PB、PEG、PS、PCF 等）、盈利能力（ROE、ROA、毛利率、EBITDA 利润率等）、盈利质量（企业自由现金流量 FCF、主营收入现金含量等）、成长能力（主营业务收入增长率、销售收入增长率、EPS、NAV、净利润等）、运营能力（资产周转率等）、负债水平（资产负债率等）。

2) 价值评估

本基金在前述优势行业选择体系的基础上,根据下述标准挑选出其中具有投资潜力的上市公司构建核心股票池:

公司治理结构良好,管理规范,信息透明,无违规行为;

公司主营业务鲜明,盈利能力强,收入和利润稳定增长;

公司具有优良的成长性,不断增长或改善的优质公司;

公司财务状况良好,具备规模优势和较好的抗风险能力;

公司在产品、技术方面具有核心竞争优势,处于行业龙头。

对上述核心股票池中的重点上市公司进行内在价值评估和成长性研究,在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可持续的投资标的。

4、债券投资策略

在本基金的债券投资过程中,本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势,采取积极主动的投资管理,以中长期利率趋势分析为基础,结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。通过确定债券组合久期、确定债券组合期限结构配置和挑选个券等三个步骤构建债券组合,尽可能地控制风险,提高基金投资收益。

5、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

6、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(五) 业绩比较基准

该混合型基金的整体业绩比较基准采用:

$60\% \times \text{中证 500 指数} + 40\% \times \text{中证全债指数}$

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金

管理人将视情况调整本基金的业绩评价基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

(六) 风险收益特征

该基金是一只混合型基金,属于基金中的中高风险品种,风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

(七) 投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1) 承销证券;
- (2) 向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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;
- (7) 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;
- (8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

基于本基金的产品属性,通过兼顾组合投资和分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

- (1) 持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的 10%;
- (2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;
- (3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;
- (4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证

监会另有规定的，遵从其规定；

(5) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(8) 本基金投资组合比例为：权益类资产（即股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为 40%-95%；债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产比例为 0%-40%。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自本基金变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约

定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(八) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

第八部分 基金资产净值的计算方法和公告方式

一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

二、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

三、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。

交易所上市的资产支持证券，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，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4、权证估值：

(1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

5、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

6、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

7、如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或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，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布的结果予以公布。

四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

五、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)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数

据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

5、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，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。

六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和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，由基金管理人对基金净值予以公布。

八、基金资产净值、基金份额净值的公告方式

《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。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，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市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，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上。

第九部分 保本周期到期

（一）保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一个保本周期，下一保本周期的起始日一般为上一保本周期到期日后，下一保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准；

如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”。同时，变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金投资及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人协商一致后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后公告，并在更新的招募说明书中予以说明。

如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将根据本基金合同的规定终止。

（二）保本周期到期的处理规则

1、在本基金保本周期到期日前的到期赎回限定期内，基金份额持有人可以做出如下选择，其持有当期保本周期到期的基金份额都适用保本条款：

（1）在到期赎回限定期内赎回其持有当期保本周期到期的基金份额；

（2）在到期赎回限定期内将其持有当期保本周期到期的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金。

2、本基金保本周期到期日后，基金份额持有人未选择赎回或转换转出的，按以下两种情形处理，且其持有当期保本周期到期的基金份额都适用保本条款：

（1）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人持

有的基金份额将根据届时基金管理人的公告自动转入下一个保本周期；

(2) 保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人所持有的本基金基金份额默认转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额。

3、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人（对于第一个保本周期而言）、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人（对于第一个保本周期后的各保本周期而言），在到期赎回限定期内选择赎回或者转换转出的，均无需支付赎回费用、基金间转换费用（基金间转换费用包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差，下同）。

在当期保本周期开始后申购的或转换转入的基金份额，不适用到期赎回限定期的条款。基金份额持有人就其在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额选择赎回时，需支付赎回费用；选择基金间转换时，按规定支付基金转换费用，其赎回费或基金间转换费用按照招募说明书或相关公告规定的费率确定，其持有时间以该份额在注册登记机构的注册登记日开始计算。

在折算日登记在册的基金份额（包括投资者进行过渡期申购的基金份额和上一保本周期结束后默认选择转入下一保本周期的持有人所持有的基金份额）转入下一保本周期时，无需支付费用。

如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定，变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”。基金份额持有人在保本周期到期时持有的基金份额（包括持有当期保本周期到期的基金份额和在当期保本周期内申购和转换转入的基金份额）在保本周期到期后默认转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额的，无需再支付转换费用。

(三) 保本周期到期选择的时间约定

本基金保本周期到期前，基金管理人将提前公告并提示基金份额持有人作出到期选择申请。

在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中，由基金管理人指定在当期保本周期结束前5个工作日内至当期保本周期到期日（含当期保本周期到期日）的一段期间为到期赎回限定期。基金份额持有人在到期赎回限定期内将在当期保本周期内持续持有的基金份额进行赎回或转换为基金管理人管理的其他基金的，视为持有到期，无需支付赎回费用、基金间转换费用，其赎回日或转换日为当期保本周期到期日。到期赎回采取“未知价”原则，基金份额持有人可赎回金额或转出金额以基金份额持有人实际赎回日或转换日当日的本基金基金份额净值为基准进行计算。基金份额持有人可按持有当期保本周期到期赎回日或转换日当日基金份额的可赎回金额加上当期保本周期内的累计分红金额低于保本额的差额（即保本赔付差额）享有保本利益。当期保本周期到期日之后的净值下跌风险应由基金份额持有人自行承担。

（四）保本周期到期的保本条款

1、基金份额持有人对于其在本基金募集期认购本基金并持有第一个保本周期到期的基金份额、在本基金过渡期限定期限内申购并持有当期保本周期到期的基金份额以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期并持有当期保本周期到期的基金份额，无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、默认选择转入下一个保本周期或是继续持有变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，均适用保本条款。

2、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，若在当期保本周期的到期赎回限定期内选择赎回基金份额、转换基金份额或继续持有基金份额，而可赎回金额加上当期保本周期内的累计分红金额低于其投资净额，基金管理人或担保人应补足该金额差额。

3、若本基金保本周期到期后不符合保本基金存续条件，在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份

额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，若继续持有基金份额，其持有的基金份额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额，而可赎回金额加上当期保本周期期间的累计分红金额低于其投资净额，基金管理人或担保人应补足该金额差额。

（五）下一保本周期基金资产的形成

1、过渡期和过渡期申购

在公告的到期处理规则中，基金管理人指定在当期保本周期到期后，即当期保本周期到期日至下一保本周期开始之前不超过 15 个工作日的一段期间的过渡期作为进行申购限定期限。

投资者在申购限定期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在申购限定期限内，投资者转换入本基金基金份额，视同为过渡期申购。投资者进行的过渡期申购，其投资净额适用下一保本周期的保本条款。

（1）基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

（2）过渡期申购采取“未知价”原则，即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。

（3）投资者进行过渡期申购的，其持有相应基金份额至过渡期最后一日（含该日）期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

（4）过渡期申购费率

过渡期申购费率最高不超过 5%，具体费率在《招募说明书》中列示。

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

（5）过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确

定并提前公告。

(6) 过渡期内，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

2、下一保本周期基金资产的形成

(1) 持有到期的基金份额

如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额可赎回金额加上相应基金份额的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

对于投资者认购或者在保本周期内申购、转换入的基金份额，选择或默认选择转入下一保本周期的，转入下一保本周期的转入金额等于选择或默认选择转入下一保本周期的相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值。

(2) 过渡期申购的基金份额

对于投资者过渡期申购的基金份额，转入下一保本周期的转入金额等于相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值。

3、基金份额折算

下一保本周期开始日的前一工作日为折算日。对在折算日登记在册的基金份额持有人所持有的基金份额（过渡期申购的持有人所持有的基金份额和上一个保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额），将以折算日的基金估值为基础，在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.000 元的基金份额，其持有的基金份额数额按折算比例相应调整。具体折算规则由基金管理人通过到期处理规则进行公告。

4、下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日，本基金进入下一保本周期运作。

本基金进入下一保本周期后，仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务，下一保本周期的日常申购按本基金合同有关约定执行。投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换入本基金基金份额的，相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。

（六）转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”资产的形成

保本周期届满时，若本基金依据基金合同的规定转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”：

1、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，如果其持有当期保本周期到期的可赎回金额加上当期保本周期期间的累计分红金额高于其投资净额，则按可赎回金额作为转入变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的转入金额；

如果持有到期的可赎回金额加上保本周期期间的累计分红金额低于其投资净额，则按投资净额（扣除已分红款项）为转入金额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”基金份额。

2、在保本周期内申购本基金的基金份额持有人，如果继续持有本基金而转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，则按可赎回金额作为转入变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的转入金额。

3、变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”申购的具体操作办法由基金管理人提前公告。

（七）保本周期到期的公告

1、保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，保本基金将继续存续。

基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续、持有人到期选择及转入下一个保本周期前的过渡期申购等相关事宜进行公告。

2、保本周期届满时，在不符合保本基金存续条件下，保本基金将变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的更新招募说明书中公告相关规则。

3、基金管理人可以修改相关规则，并将在临时公告或更新的招募说明书中公告。

4、在保本周期到期前，基金管理人还将进行提示性公告。

（八）保本周期到期的赔付

发生赔付的具体操作细则由基金管理人依据基金合同和与担保人所签署的合同约定提前公告。

第十部分 基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

一、《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约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

3、《基金合同》可能加重担保人保证责任的变更需经担保人书面同意，但根据法律法规要求进行修改的除外。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新

基金托管人承接的；

- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估值和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)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；

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7)对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

六、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；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后五个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第十一部分 争议解决方式

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可通过友好协商解决，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，按照其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。

《基金合同》受中国法律管辖。

第十二部分 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，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。