

# 长盛同鑫保本混合型证券投资基金 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

长盛同鑫保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2011 年 4 月 11 日获中国证监会证监许可【2011】519 号文批准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动而波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金根据股票与债券市场的波动趋势灵活配置股票与债券的投资比例，在系统研究基础上判断股票市场与债券市场的未来趋势，有可能发生判断失误的风险等。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者投资于本保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，投资者投资本基金仍然存在本金损失的风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2012 年 5 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

重要提示 .....	2
目 录.....	3
第一节 绪 言.....	4
第二节 释 义.....	5
第三节 基金管理人.....	10
第四节 基金托管人.....	18
第五节 相关服务及担保机构.....	22
第六节 基金的募集.....	35
第七节 基金合同的生效.....	36
第八节 基金份额的申购与赎回.....	36
第九节 保本.....	46
第十节 担保.....	47
第十一节 基金的投资.....	54
第十二节 基金的业绩.....	71
第十三节 基金的财产.....	71
第十四节 基金资产的估值.....	72
第十五节 基金的费用与税收.....	76
第十六节 基金的收益与分配.....	78
第十七节 基金的会计与审计.....	79
第十八节 基金的信息披露.....	80
第十九节 保本周期到期.....	83
第二十节 风险揭示.....	89
第二十一节 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	92
第二十二节 基金合同内容摘要.....	94
第二十三节 基金托管协议的内容摘要.....	107
第二十四节 对基金份额持有人的服务.....	116
第二十五节 其他应披露的事项.....	119
第二十六节 招募说明书的存放和查阅方式.....	120
第二十七节 备查文件.....	120
附件一、《保证合同》 .....	122
附件二、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金保函》 .....	136

## 第一节 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》”)和其他相关法律法规的规定以及《长盛同鑫保本混合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。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,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。基金投资者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。

## 第二节 释义

招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

1. 基金或本基金：指长盛同鑫保本混合型证券投资基金；
2. 基金合同：指《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》及其任何有效修订和补充；
3. 招募说明书或本招募说明书：指《长盛同鑫保本混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
4. 托管协议：指《长盛同鑫保本混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
5. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
6. 中国银监会：指中国银行业监督管理委员会；
7. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时作出的修订；
8. 《证券法》：指由中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议于 2005 年 10 月 27 日修订通过的自 2006 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券法》及不时作出的修订；
9. 元：指人民币元；
10. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有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；
11. 基金管理人：指长盛基金管理有限公司；
12. 基金托管人：指中国银行股份有限公司；
13. 担保人：指为本基金保本周期的保本提供保证担保、风险买断担保或者中国证监会认可的其他担保方式的担保并依基金合同约定确定的机构。本基金第一个保本周期的担保人为本基金第一个保本周期的保本提供连带责任保证担保的安徽省信用担保集团有限公司；
14. 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；

15. 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代为办理本基金注册登记业务的机构；
16. 投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外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；
17. 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的自然人；
18. 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；
19. 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
20. 基金份额持有人大会：指按照基金合同第十部分之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
21. 保本周期：指本基金的保本期限。本基金的保本周期一般每三年为一个周期。本基金第一个保本周期自基金合同生效之日起至3年后对应日止；本基金第一个保本周期后的各保本周期自本基金公告的保本周期起始之日起至三年后对应日止的期间。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一保本周期的起始时间。基金合同中若无特别所指，保本周期即为当期保本周期；
22. 过渡期：指基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定的当期保本周期到期日至下一保本周期开始之前的不超过15个工作日的一段期间，基金管理人可进一步确定在该期间内投资人进行过渡期申购的期限；
23. 过渡期申购：指依据基金管理人在保本周期到期前公告的到期处理规则，投资人在过渡期的限定期限内申请购买本基金基金份额的行为，投资者进

行过渡期申购的，按其申购的基金份额在折算日所代表的资产净值确认下一保本周期的投资净额并适用下一保本周期的保本条款；

24. 基金份额发售公告：指本基金为募集基金份额而刊登的发售公告；
25. 基金合同生效日：指基金募集期满，基金募集情况符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
26. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
27. 投资净额：指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。投资净额为本基金的保本投资金额。在当期保本周期内赎回或转换转出的基金份额，不纳入当期保本周期的投资净额的计算；
28. 折算日：指本基金第一个保本周期后各保本周期开始日的前一工作日，即过渡期最后一个工作日。基金合同中若无特别所指，折算日即为当期保本周期开始日的前一工作日；
29. 基金份额折算：在折算日，基金份额持有人所持有的基金份额（包括投资者进行过渡期申购的基金份额和上一个保本周期结束后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）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 1.00 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整；
30. 可赎回金额：指根据保本周期到期日基金份额数及基金份额净值计算的赎回金额；
31. 《保证合同》：若招募说明书无特别所指，指安徽省信用担保集团有限公司与基金管理人为本基金第一个保本周期的保本保证所签署的《保证合同》；
32. 保函：指担保人向本基金基金份额持有人出具的保证法律文件；
33. 持有当期保本周期到期：指在本基金募集期认购本基金、过渡期申购本基金及从上一个保本周期转入当期保本周期的持有人在当期保本周期内

一直持有前述基金份额(进行基金份额折算的,指折算后对应的基金份额)的行为;

34. 保本周期到期日:基金合同中若无特别所指即为当期保本周期届满日(自当期保本周期开始之日起至3年后对应日止,如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日)。基金份额持有人在当期保本周期到期前公告的开放到期赎回的限定期限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,则对该基金份额持有人所赎回或转换转出的基金份额而言,赎回日或转换日为当期保本周期到期日;
35. 到期赎回限定期限:指基金管理人在保本周期到期日前指定的一个期限。在此期限内,基金份额持有人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,则对该基金份额持有人所赎回或者转换转出的基金份额而言,赎回日或转换日为当期保本周期到期日,基金份额持有人无需支付赎回费用或基金间转换费用(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),并可按其赎回或转换的基金份额与赎回或转换日基金份额净值的乘积加上其赎回或转换的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其赎回或转换的基金份额的投资净额的差额享有保本利益;
36. 保本基金存续条件:指本基金保本周期届满时(后),担保人同意继续担保或基金管理人和基金托管人认可的其他机构同意为本基金提供未对基金合同保本条款作出不利改变的担保,同时本基金满足法律法规和本基金合同规定的保本基金存续要求;
37. 保本周期到期后基金的存续形式:指保本周期届满时,在符合保本基金存续条件的前提下,本基金继续存续;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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”;
38. 转入下一个保本周期:指在本基金符合保本基金存续条件的情况下,上一保本周期的基金份额持有人继续持有本基金基金份额的行为;
39. 工作日:指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;
40. 认购:指在基金募集期内,投资者按照基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为;

41. 申购：指在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，如基金合同无特别所指，包括过渡期申购；
42. 赎回：指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人申请卖出本基金基金份额的行为；
43. 基金转换：指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；
44. 转托管：指基金份额持有人将其所持有的某一基金的基金份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为；
45. 投资指令：指基金管理人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；
46. 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；
47. 销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；
48. 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；
49. 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；
50. 基金账户：指注册登记机构为基金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；
51. 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基金份额的变动及结余情况的账户；
52. 开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
53. T 日：指销售机构受理投资者某笔申购、赎回或其他业务申请的开放日；
54. T+n 日：指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
55. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
56. 基金资产总值：指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；

57. 基金资产净值：指以计算日基金资产总值减去基金负债后的价值；
58. 基金份额净值：指以计算日基金资产净值除以基金份额余额所得的基金单位份额的价值；
59. 基金资产估值：指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
60. 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；
61. 不可抗力：指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、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。

### 第三节 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心 8 层 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

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基金字[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%;新加坡星展银行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(现名称为安徽省投资集团控股有限公司)占注册资本的13%。截至2012年5月24日,基金管理人共管理两只封闭式基金、十八只开

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。曾任安徽省政府办公厅二办副主任，安徽省国际信托投资公司副总经理，安徽省证券管理办公室主任，香港黄山有限公司董事长、总经理，安徽国元控股（集团）有限责任公司董事长、党委书记，安徽国元信托投资有限责任公司董事长。现任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会办公厅副处长、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。现任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。曾任安徽省第一轻工业厅研究室副主任，安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长，安徽省巢湖市市委常委、常务副市长，安徽省发改委副主任。现任安徽省投资集团有限责任公司（现名称为安徽省投资集团控股有限公司）党委书记、董事长。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任，安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理，安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理，香港黄山有限公司总经理助理。现任国元证券股份有限公司董事、总裁。

陈淑珊女士，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括 ING 霸菱证券公司、花旗银行、摩根士丹利。现任星展银行有限公司私人银行业务部董事总经理兼主管。

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。现任星展银行（中国）有限公司执行董事兼行政总裁。

周兵先生，董事、总经理，硕士，经济师。曾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。现任长盛基金管理有限公司总经理。

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。现任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、上海复旦大学顾问教授、香港城市大学讲座教授。现任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。现任安徽大学教授、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。现任中国科学技术大学计算机学院执行院长、管理学院商务智能实验室主任。

## 2、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。现任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。现任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，安徽省信托投资公司部门经理、副总经理。现任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，安徽省投资集团有限责任公司资本运营部经理、总经理助理、总经济师。现任安徽省投资集团有限责任公司（现名称为安徽省投资集团控股有限公司）党委委员、副总经理。

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、财务会计部总监。现任长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

### 3、管理层成员

凤良志先生，董事长，博士，高级经济师。同上。

周兵先生，董事、总经理，硕士，经济师。同上。

朱剑彪先生，金融学博士。曾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。现任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，现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生，大学，会计师。曾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。2004年10月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司督察长。

### 4、本基金基金经理

蔡宾先生，1978年11月出生。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA

(美国特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理、投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理等职务。现任固定收益部总监，自2011年5月24日起任长盛同鑫保本混合型证券投资基金(本基金)基金经理，自2011年12月6日起兼任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。

(本招募说明书基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。)

#### 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、长盛同庆可分离交易股票型证券投资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，长盛同庆中证800指数分级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。

吴达先生，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，美国特许金融分析师CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司，历任星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、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，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛全球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。

蔡宾先生，硕士，固定收益部总监，同上。

刘斌先生，清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部副总监，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。

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、赎回和注册登记手续；
- 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、编制季度报告、中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值、基金份额净值、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、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

### （四）基金管理人承诺

- 1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规的行为发生；
- 2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生：
  - （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
  - （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
  - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - （5）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。
- 3、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

(4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### (五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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

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

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

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

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

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

##### 2、完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”(董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部)内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况，组织指导公司监察稽核工作，对基金运作、内部管理、制度执行及遵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、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、岗位职责、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度,并结合部门职责和业务运作的要求拟定,其制定和实施需报经公司管理层讨论通过和总经理批准。

公司的内部控制制度会随着市场的发展和金融创新来进行相关调整。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) 建立了严格评价程序,以评估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,

同时报告总经理和公司督察长，以保证多重检查复核。

(3) 建立了报告制度。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，定期向督察长出具检查报告。

#### 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。

### 第四节 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：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

托管及投资者服务部总经理：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 120 余人。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

截至 2012 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、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、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)、博时抗通胀增强回报(QDII)

华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等147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。

### 第五节 相关服务及担保机构

#### (一) 基金份额发售机构

## 1、直销机构

名称：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) 82019799、82019795

传真：(010) 82255981、82255982

联系人：张莹、张晓丽

## 2、代销机构

### (1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

联系人：吴雪妮

电话：010 - 66594851

传真：010 - 66594946

客户服务电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://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：蒋超良

客户服务电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

### (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

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

联系人：何奕

电话：010-67596093

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

公司网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(4) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：林芳

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(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

联系人：邓炯鹏

电话：0755 - 83077278

传真：0755 - 83195050

客户服务电话：95555

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(6) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-57092851

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：虞谷云

电话：021—61616206

传真：021—63604199

客户服务电话：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(8) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

电话：021—52629999

传真：021—62569070

客户服务电话：95561

公司网站：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(9) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

电话：020-38321739

传真：020-87311780

客户服务电话：400-830-8003

公司网址：[www.cgbchina.com.cn](http://www.cgbchina.com.cn)

(10) 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

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王佺

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

公司网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(11) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

联系人：赵树林

电话：010-65556960

传真：010-65550981

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

(12) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：010-85238000

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

公司网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(13) 国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：祝丽萍

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

公司网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

(14) 华福证券股份有限公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

统一客户服务电话：96326

公司网址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

(15) 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

联系人：李笑鸣

联系电话：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客服电话：400-8888-001、(021) 962503

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(16) 齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531 - 68889155

传真：0531 - 68889752

客户服务电话：95538

网址：[www.qizq.com.cn](http://www.qizq.com.cn)

(17) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

业务联系人：谢高得

业务联系电话：021-38565785

客户服务电话：95562

公司网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(18) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

客户服务热线：4008888788、10108998

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(19) 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：万建华

联系人：芮敏祺

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

客服电话：95521

公司网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(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：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(21) 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

联系人：林生迎

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943237

客户服务热线：95565、4008888111、(0755) 26951111

公司网址：www.newone.com.cn

(22) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

开放式基金咨询电话：4006000686

开放式基金业务传真：(0431) 85096795

公司网址：www.nesc.cn

(23) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

(24) 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

法定代表人：刘弘

联系人：牟冲

电话：010-5832-8112

客户服务热线：400-887-8827

公司网址：www.ubssecurities.com

(25) 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

联系人：李清怡

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54035333

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

(26) 国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702

法定代表人：雷建辉

联系人：沈刚

开放式基金咨询电话：(0510) 82831662

开放式基金业务传真：(0510) 82830162

客户服务热线：4008885288 或 95570

公司网址：www.glsc.com.cn

(27) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至  
21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话 400 600 8008

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(28) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：(010) 66568430

传真：(010) 66568536

客服电话：400-888-8888

公司网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(29) 中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

联系人：张于爱

电话：010-84864818

传真：010-84865560

公司网址：[www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

(30) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 (1507-1510 室)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(31) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

长江证券客服网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(32) 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

联系人：程高峰

电话：025-84457777-893

传真：025-84579763

客户咨询电话：95597

公司网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(33) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

(34) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

客户服务热线：400-8866-567

公司网址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(35) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：楼斯佳

联系电话：021-50122107

客户咨询电话：400-820-9898

公司网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(36) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

联系人：王勤

联系电话：0571-85783750

客户咨询电话：0571-96598

公司网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

(37) 民生证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：岳献春

客服热线：4006 19 8888

公司网址：www.msq.com

(38) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 47-49 楼

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客服电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

(39) 红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

联系人：王敏

电话：0871-3577011

客户服务热线：0871-3577930

网址：www.hongtastock.com

(二) 注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福中三路 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

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：戴君棉

(三) 担保人

名称：安徽省信用担保集团有限公司

注册地址：合肥市长江西路200号

法定代表人：钱正

联系人：袁野

联系电话：0551-5227521

#### **(四) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师**

名称：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：黎明

经办律师：吕红、黎明

#### **(五) 会计师事务所和经办注册会计师**

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：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：汪棣、张鸿

## **第六节 基金的募集**

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2011 年 4 月 11 日证监许可[2011]519 号文批准募集。

### **(一) 基金类别与存续期间**

1、基金类别：保本混合型证券投资基金

2、基金存续期间：不定期

## （二）募集概况

本基金自 2011 年 4 月 20 日起向全社会公开募集，截至 2011 年 5 月 20 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 3,031,349,989.30 元人民币，折合基金份额 3,031,349,989.30 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 761,628.00 元人民币，折合基金份额 761,628.00 份。本次募集所有资金已于 2011 年 5 月 24 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同鑫保本混合型证券投资基金托管专户。本次募集有效认购户数为 24,500 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 3,032,111,617.30 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。本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费等费用，不从基金财产中列支。

## 第七节 基金合同的生效

本基金基金合同自 2011 年 5 月 24 日起生效，基金合同生效后的存续期内，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，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 第八节 基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构

开通电话、传真或网上等交易方式,投资人可以通过上述方式进行申购与赎回,具体办法由基金管理人另行公告。

## (二) 申购与赎回的开放日及时间

### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本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。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的,视为下一个开放日的申请,其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将根据本基金招募说明书等文件的规定视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但此项调整应在实施日2日前在指定媒体公告。

### 2、申购与赎回的开始时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

申购开始日:2011年7月8日

赎回开始日:2011年7月8日

## (三) 申购与赎回的原则

1、“未知价”原则,即基金份额的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算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，基金管理人按后进先出的原则，即对该基金份额持有人在销售机构托管的基金份额进行赎回处理时，申购确认日期在前的基金份额后赎回，申购确认日期在后的基金份额先赎回，以确定所适用的赎回费率；若基金保本周期到期后变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，则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，申购确认日期在前的基金份额先赎回，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，在当日的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3个工作日前在至少一种指定媒体上公告。

#### （四）申购和赎回的程序

##### 1、申购与赎回申请的提出

基金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内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全额交付申购款项。

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

基金管理人应自身或要求基金注册登记机构在T+1日对基金投资者申购、赎回申请的有效性进行确认。投资者应在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式及时查询申请的确认情况，否则，如因申请未得到基金管理人或注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。

##### 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，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成交后，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，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过七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和有关法律法规规定处理。

## (五) 申购与赎回的数额限定

### 1、申购金额的限制

基金管理人网上交易及代销机构每个账户单笔申购的最低金额为 1000 元（含申购费）；

2、投资者赎回份额不设限制。

3、基金管理人可根据市场情况，调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整三个工作日前在中国证监会指定的至少一种媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

## (六) 申购和赎回的数额与价格

### 1、申购份额的处理方式

(1) 申购份额的处理方式：本基金采用外扣法计算申购费用及申购份额，申购的有效份额以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

(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，赎回净额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

### 2、申购份额的计算

申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

（注：在适用固定金额计算申购费率时，净申购金额 = 申购金额 - 申购费用）

### 3、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{基金赎回费率}$$

$$\text{赎回净额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

#### 4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 发行在外的基金份额总数

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。

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

#### (七) 基金的申购费与赎回费及其用途

##### 1、申购费用

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。若投资者在一天之内有多笔申购，则按每次申购金额对应费率分别收取申购费。申购费用由基金申购人承担，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。

本基金的申购费率如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
M < 50 万	1.2%
50 万 M < 200 万	0.8%
200 万 M < 500 万	0.4%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

举例说明如下：

某投资者以 40 万元申购本基金，申购费率为 1.2%，假设申购当日基金份额净值为 1.100 元，则其可得到的申购份额为：

净申购净额 =  $400,000 / (1 + 1.2\%) = 395,256.92$  元

申购费用 =  $400,000 - 395,256.92 = 4743.08$  元

申购份额 =  $395,256.92 / 1.100 = 359,324.47$  份

即投资者以 40 万元申购本基金，如果申购当日基金份额净值为 1.100 元，则其可得到的申购份额为 359,324.47 份。

##### 2、赎回费用

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，其余部分用于支付销售、注册登记等机构的相关手续费。

本基金的赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
6个月以下(不含)	1.8%
6个月(含) - 2年(不含)	1.0%
2年(含) - 3年(不含), 但持有当期保本周期到期且在当期保本周期开放到期赎回的限定期限内选择赎回的, 不适用本档费率	0.5%
3年以上(含), 或者持有当期保本周期到期且在当期保本周期开放到期赎回的限定期限内选择赎回的	0

(注：1年按365天计算；6个月按183天计算；基金份额持有人持有时间的计算，以其份额在注册登记机构的注册登记日开始计算。)

举例说明：

某基金份额持有人赎回持有不超过6个月的1000份基金份额，赎回对应的赎回费率为1.8%，假设赎回当日基金份额净值是1.100元，则其可得到的赎回净额为：

$$\text{赎回金额} = 1000 \times 1.100 = 1100 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 1100 \times 1.8\% = 19.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 1100 - 19.80 = 1080.20 \text{ 元}$$

即基金份额持有人赎回持有不超过6个月的1000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.100元，则其可得到的赎回净额为1080.20元。

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人最迟应在调整实施前3日在中国证监会指定的媒体上刊登公告。

4、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，对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，基金管理人可以调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### (八) 申购和赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金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 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 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，并最迟于开始实施三个工作日前予以公告。

#### **(九) 过渡期申购的特别规定**

1、基金管理人应在当期保本周期到期前公告处理规则，允许投资者在下一个保本周期开始前的过渡期限定期限内申请购买本基金基金份额，投资者在上述期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。投资者在过渡期限定期限内申购本基金的，按其申购的基金份额在下一个保本周期开始前的折算日所代表的资产净值确认下一保本周期的投资净额并适用下一保本周期的保本条款。

2、基金管理人在当期保本周期到期前，将根据担保人提供的下一个保本周期担保额度确定并公告下一个保本周期的担保规模上限，规模控制的具体方案详见当期保本周期到期前公告的处理规则。

3、投资者在保本周期开始后的开放日申购本基金的，不适用保本条款。

#### **(十) 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总份额后的余额）与净转出申请（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，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；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。

(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，在三个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

(4) 暂停接受和延缓支付：本基金连续两个开放日以上（以上含本数，下同）发生巨额赎回，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 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体公告。

#### (十一) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、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) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；

(2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法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资产估值情况；

(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，或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；

(5) 本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害基金份额持有人利益时；

(6) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正

常运行；

(7) 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；

(8) 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(上述第(7)种情形除外)。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并予以公告。

2、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:

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项;

(2) 证券交易场所交易时间临时停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3) 基金发生连续巨额赎回,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资产估值情况;

(5) 过渡期期内暂停赎回和转换转出;

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项的,基金管理人应当在当日向中国证监会备案,并及时公告。除非发生巨额赎回,已接受的赎回申请,基金管理人应当足额支付。

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并及时公告。

3、暂停基金的申购、赎回,基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、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。

## (十二) 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,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。

### (十三) 转托管

基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。转托管在转出方进行申报,基金份额转托管一次完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后,转托管份额于 T+1 日到达转入方网点,投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

### (十四) 定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下,本基金可为投资者提供定期定额投资计划服务,具体规则由基金管理人在届时发布的公告或更新的招募说明书中确定。

### (十五) 基金的非交易过户

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中:

“继承”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;

“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社会团体的情形;

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依照法律法规及本基金合同的有关规定可以持有本基金基金份额的投资者。

### (十六) 基金的冻结

基金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(包括现金分红和红利再投资)一并冻结。

### (十七) 基金份额质押

对于相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金

业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 第九节 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限内赎回基金份额；

(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“长盛同鑫行业配置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、但在当期开放到期赎回的限定期限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担保人无法履行保证义务。

## 第十节 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》

担保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》的全文详见招募说明书的附件。《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

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。

#### (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十个工作日内, 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，且根据本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：

基金合同第 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一次性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，而不得对甲方调度自有资金的情况及方式提出异议，乙方对相关基金份额持有人的保证责任即视为履行完毕，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基金合同的约定履行保证责任。

2、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，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的 2 个工作日内向担保人支付担保费。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、宣告破产的情况下应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

除本节第（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节第（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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，担保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)。如果符合第九节第（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的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。担保人将代偿金额全额划入本基金在基金托管人处开立的账户中后即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。

## 第十一节 基金的投资

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

依据本基金的保证合同，本基金通过运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，力争在本基金保本周期结束时，实现基金资产的收益增长。

### （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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于股票（包括一级、二级市场股票）资产占基金资产的比例不高于 30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产（包括国债、央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）占基金资产的比例不得低于 70%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

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

严格有效的风险控制是实现稳健收益的前提。

### （四）投资策略

本基金投资策略突出强调配置的科学性与纪律性，通过严格金融工程手段有效控制风险，保证实现投资期中的稳定收益，并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。

#### 1、资产配置及保本策略

##### （1）资产配置策略

科学合理的资产配置是实现稳健保本投资目标的基础。本基金将按照恒定比例组合保险机制将资产配置于安全资产与风险资产。本基金投资的安全资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）、货币市场工具和现金资产。本基金投资的风险资产为股票（包括一级、二级市场股票）资产。

在基金实际管理过程中,基金管理人将根据宏观经济和证券市场的阶段性变化,在投资组合比例范围内,适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例。因此,本基金资产配置策略分为两个层次:一层是对风险资产和安全资产的资产配置,该层次以资产管理优化恒定比例组合保险策略(CPPI)为依据;另一层是对风险资产的资产配置策略。

## (2) 保本技术及策略

本基金采用固定比例组合保险(CPPI)的保本投资策略,即用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损,并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。

采用核心 CPPI 策略的目标是控制风险类资产的投资比例,确保本基金组合价值线的增长,从而实现稳健的收益目标。当以股票市场为代表的风险类资产上涨的过程中,分享风险资产上涨的收益,带动组合价值线的增长;当风险类资产下跌的过程中,控制风险,快速止损,保持前期收益成果。

本基金所采用的核心 CPPI 策略是应用 CPPI 基础上通过变动投资安全垫、主动投资策略中情景预测等先进的技术,创新性为本基金组合设计了独特的改进型组合保险策略。

改进后的组合保险策略的基本公式为:

$$RA_t = k \times m \times (AN_t - F_t)$$

其中: $RA_t$ 是在 t 期组合可以投资于风险资产的最大投资金额; $AN_t$ 为 t 期期初的组合资产净值; $F_t$ 是 t 期期初的防守垫金额;k 是情景调整系数(调整范围为 0-1),与当期市场状况有关系;m 是动态风险配置系数既放大倍数,与组合资产在当期可能面临的最大损失有关系。

在风险资产和安全资产的配置上,本基金通过对远期利率、市场价格及趋势等参数的预测,计算风险资产组合中不同类属资产可能发生的最大亏损,据此得到不同类属资产的可放大倍数。根据风险资产投资的盈亏状况,动态调整风险资产和安全资产的权重。

依照 CPPI 投资策略主要有三点关键点:

安全资产的确定

在 CPPI 中,安全资产在保本周期末需要有确定的现金流。在实际投资中,有确定现金流的安全资产最好是选用剩余期限与保本周期相匹配的高信用等级零息票据,如零息国债。对于认购期以后投资者追加的申购资金,将投入剩余期限与保本周期剩余期限相匹配的三年期债券。

#### 放大倍数的确定

在 CPPI 中,安全垫是风险资产可承受的最高损失限额,因此风险资产变现时所能承担损失的比例上限是放大倍数的倒数。在本基金的投资中,本基金管理人将着重考察保本周期内的市场中长期走势,根据市场的中长期态势,适度调整安全垫中长期的放大倍数。在市场处于弱市时,辅以提高安全垫以控制基金风险,确保基金保本目标的实现。

#### 安全垫放大倍数的维持

根据 CPPI 策略,只有当安全垫的放大倍数在一定时间内保持恒定,才能保证在安全垫减少至零时,风险资产的数量也能按需要同时减少至零,以保证基金的本金安全。在本基金的实际投资中,为维持风险资产与安全垫的放大倍数,基金管理人对风险资产与安全资产的比例进行定期调整而不是随时调整,同时管理人还将根据这种调整可能造成的交易费用与冲击成本,设立调整阈值,根据调整阈值来确定调整的最佳时点,以降低交易费用。

在市场可能发生剧烈变化时,本基金管理人对基金安全垫的中长期放大倍数进行调整,调整的时间间隔将比日常安全资产与风险资产比例调整的时间间隔长,这样一方面保证基金能够有充足的时间间隔实现“恒定比例”的投资组合保险策略,另一方面,本基金管理人又能根据对市场中长期态势的判断来决定是否该减小或增大放大倍数。

### 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。

此外,本基金谨慎参与一级市场股票首发和增发,以获得一、二级市场之间的利润。

#### 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。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。

通过全面研究宏观经济运行,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。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。

##### (2) 类属策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行,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

本基金运用国际普遍使用的二叉树模型计算可转债所含期权的价值,结合该可转债的债券价值对可转债进行相对价值评估,根据本溢价率排序和行业资金配置情况确定最终的可转债投资组合。

#### (五) 有关保本技术及投资管理的测算举例

首先,按照组合保险策略,在战略性债券资产配置的基础上,计算初始防守垫(价值线)的底线。其次,在股票配置策略指导下,在模拟组合 VaR 测算的基础上,运用组合保险策略计算风险资产的配置比例。

CPPI 组合保险技术策略的模型如下:

$RA_t = k \times m \times (AN_t - F_t)$ 。其中  $m \times (AN_t - F_t)$  由金融工程小组根据组合情况自动计算给出,而最终风险资产投资额度  $RA_t$  则由投决会根据市场状况确定情景调整系数  $k$  形成风险授权额度,其中  $k$  在 (0 - 1) 的范围内可调。

根据上述策略进行简单计算举例如下:

假如保本基金的初始总资产为  $An=50$  亿元,安全性资产比例  $Sa$  (债券),假设未来安全资产(债券)年收益率为  $r=3\%$ ,则三年的总收益率为  $3 \times r=9\%$ ;

根据 Var 测算,风险性资产比例  $Ra$  (股票)的最大可能性损失为 50%,则其放大系数  $m=1/0.5=2$ ;如将安全性资产的未来收益部分投入的风险性资产中来,则风险性资产的可投的比例为  $Ra=Sa \times 9\% \times 2=Sa \times 18\%$ ;由于  $Sa+Ra=1$ , $Sa+Sa \times 18\%=1$ ,则安全性资产比例为  $Sa=1/(1+18\%)=84.7\%$ ,风险资产的比例为  $Ra=1-Sa=15.3\%$ 。

安全垫  $F_t = A_n \times (1 - R_a \times 50\%) = 50 \times 92.5\% = 46.18$  亿。因此，当  $k$  值为 1 时，我们初试的资产配置为：

风险性资产（股票） $RA = k \times m \times (A_n - F_t) = 1 \times 2 \times (50 - 46.18) = 7.65$  亿元；

安全性资产（债券） $SA = 50 - RA = 42.35$  亿元；

从上述举例测算中，我们初始投资为 42.35 亿债券资产，7.65 亿股票资产，另根据当时市场情况及投资委员会的建议可用  $K$  值（0-1）对风险性资产进行调整以更加安全保护本金的安全。

#### （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

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过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) 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%；

(5) 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%；

(6) 本基金持有的同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

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

(8) 本基金管理人管理的全部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%；

(9) 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；

(10) 本基金不投资于权证，若转型为非保本其他类型基金时，则遵循转

型后的基金组合对于投资权证所约定的相关限制；

(11) 本基金投资于股票(包括一级、二级市场股票)资产占基金资产的比例不高于30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产(包括国债、央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等)占基金资产的比例不得低于70%；

(12) 本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的流通受限证券,且投资流通受限证券的锁定期不得超过当期保本周期的剩余存续期；

(13) 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、股权分置改革中支付对价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。

(九) 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。

(十) 基金投资组合报告

基金投资组合报告数据摘自本基金2012年第1季度报告(以下简称“本报告”)。

基金管理人长盛基金管理有限公司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。

本报告所载数据内容自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	73,764,939.88	3.28
	其中:股票	73,764,939.88	3.28
2	固定收益投资	1,281,450,242.11	56.98
	其中:债券	1,281,450,242.11	56.98
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	306,200,779.30	13.61
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	532,316,002.80	23.67
6	其他资产	55,304,985.89	2.46
7	合计	2,249,036,949.98	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	4,203,445.08	0.22
C	制造业	1,992,000.00	0.11
C0	食品、饮料	656,800.00	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,335,200.00	0.07
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	5,017,000.00	0.27
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	2,778,500.00	0.15

I	金融、保险业	52,802,494.80	2.81
J	房地产业	6,971,500.00	0.37
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	73,764,939.88	3.92

### 3、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投资

#### 明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	深发展A	1,006,800	15,816,828.00	0.84
2	600000	浦发银行	1,400,000	12,502,000.00	0.66
3	601166	兴业银行	899,990	11,987,866.80	0.64
4	601328	交通银行	2,500,000	11,775,000.00	0.63
5	000002	万科A	650,000	5,382,000.00	0.29
6	601006	大秦铁路	500,000	3,725,000.00	0.20
7	600123	兰花科创	79,956	3,552,445.08	0.19
8	600111	包钢稀土	20,000	1,335,200.00	0.07
9	600009	上海机场	100,000	1,292,000.00	0.07
10	000024	招商地产	50,000	1,025,000.00	0.05

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	95,009,500.00	5.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	745,757,545.31	39.62
5	企业短期融资券	242,377,000.00	12.88
6	中期票据	-	-
7	可转债	198,306,196.80	10.53
8	其他	-	-
9	合计	1,281,450,242.11	68.08

### 5、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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	1,920,460	194,120,096.80	10.31
2	010203	02 国债	950,000	95,009,500.00	5.05

3	115003	中兴债 1	964,481	93,530,544.98	4.97
4	126011	08 石化债	964,580	89,985,668.20	4.78
5	126008	08 上汽债	775,120	72,861,280.00	3.87

#### 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。

#### 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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8、投资组合报告附注

(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。

(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。

#### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	32,656,047.03
3	应收股利	-
4	应收利息	22,146,760.94
5	应收申购款	2,177.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,304,985.89

#### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	194,120,096.80	10.31
2	113002	工行转债	3,248,100.00	0.17

#### (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。

## (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。

若本基金保本周期到期后变更为“长盛同鑫行业配置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

积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会，在控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### (二) 投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 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（包括一年以内的短期国债、回购协议等）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 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%。

### (三) 投资策略

在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，以谋求行业配置的超额收益。

#### 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

本基金综合运用长盛行业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,前述优势行业中股票优先入选。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:盈利能力指标(如 PE、PCF、PB 等)、经营效率指标(如 ROE、ROA 等)和财务状况指标等。

### (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

在债券投资方面，本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期策略、期限结构策略、类属策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

#### 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%×沪深 300 指数+40%×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

该基金是一只灵活配置的混合型基金，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

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过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%。

（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%；

(7) 本基金持有的同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(8) 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%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(10) 本基金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；

(11) 本基金股票资产占基金资产的40%-95%；债券、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议等）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-40%；

(12) 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、股权分置改革中支付对价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“长盛同鑫行业配置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。

## 第十二节 基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

	基金份额净值 增长率	同期业绩比较基准 收益率	同期业绩比较基准 收益率超额收益率
2011年5月24日(基金合同生效日)至 2011年12月31日	2.30%	2.89%	-0.59%
2012年1月1日至 2012年3月31日	0.98%	1.15%	-0.17%
2011年5月24日(基金合同生效日)至 2012年3月31日	3.30%	4.07%	-0.77%

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。

## 第十三节 基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### （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后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，以“长盛同鑫保本混合型证券投资基金”的名义于基金托管人处开立银行账户，并以基金托管人和“长盛同鑫保本混合型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“长盛同鑫保本混合型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、代销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相独立。

#### （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及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

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

3、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。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

### 第十四节 基金资产的估值

#### （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，并准确计算出本基金的经营收益，为本基金的申购、赎回等交易提供公允的价值基础。

#### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

#### （三）估值对象

基金所持有的金融资产和所承担的金融负债。

#### （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）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。

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。

## （3）有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 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，确定公允价格。

（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，确定公允价格。

（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、权证估值

若本基金保本周期到期后变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，则基金所投资权证资产适用如下估值方法：

#### (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。

4、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。

5、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。

### 6、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。

7、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-6 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充分的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### (五) 估值程序

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，将估值结果以约定方式报给基金托管人，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，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）暂停估值的情形

- 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财产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的确认

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当日的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。

#### （八）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、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；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 7 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十五节 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；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 7、基金的资金汇划费用及开户费用；
- 8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

### （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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.2% 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 1.2% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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。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。

在保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

#### 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 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 0.2% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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。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。

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“长盛同鑫行业配置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。

5、本条第（一）款第 3 至第 9 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。

### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

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

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 第十六节 基金的收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

### （二）基金可供分配利润

期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### （三）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“长盛同鑫行业配置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、 每一基金份额享有同等分配权；

3、 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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

4、 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多4次，每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的10%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算,期末可供分配利润以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为准；

#### 5、 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过15个工作日；

6、 投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；

#### 7、 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金

收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### **(五) 收益分配方案的确定与公告**

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后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

#### **(六) 收益分配中发生的费用**

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、在保本周期内，本基金红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金管理人承担。

3、若转型为长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金，则收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。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，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除息日的基金份额净值转为基金份额。

### **第十七节 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，以人民币元为记账单位。

3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。

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，按照有关法律法规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。

#### **(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，并报中国证监会备案；

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，应通报基金托管人，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两日内公告。

## 第十八节 基金的信息披露

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全国性报刊和基金管理人的互联网网站等媒介披露，并保证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。

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

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三日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金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六个月结束之日起四十五日内，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十五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报刊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。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后,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、基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日,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报刊和网站上。

#### (五) 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。基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。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。基金管理人应当在中国证监会指定的信息披露媒体公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值和基金份额净值。

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。

#### (六) 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、终止基金合同;
- 3、转换基金运作方式;
- 4、更换基金管理人、基金托管人或担保人;
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7、基金募集期延长;
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%;
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%;
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- 14、重大关联交易事项;
- 15、基金收益分配事项;
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 17、基金份额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、更换基金注册登记机构;
- 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、基金份额持有人大会的决议
- 27、中国证监会规定的其他事项。

#### （七）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。

#### （八）保本相关信息

1、保证合同作为本基金的基金合同、招募说明书的附件,并随基金合同、招募说明书一同公告。

2、在保本周期到期时更换担保人或保本周期内更换担保人,基金管理人除根据基金合同履行必要程序外,还须按照法律法规和基金合同规定及时进行公告。

3、为向基金份额持有人明确担保人承担的保证义务,担保人依据保证合同向本基金的基金份额持有人出具保函。该保函作为本基金的基金合同的附件,并随基金合同、招募说明书、保证合同一同公告。

#### （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、基金托管人和基金代销机构的住所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

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

### 第十九节 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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”。同时，变更后的“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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。

#### （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

本基金过渡期申购费率如下：

过渡期申购金额(含申购费)	费率
M < 50 万	0.8%
50 万 M < 200 万	0.5%
200 万 M < 500 万	0.2%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

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尽量保持为现金形式，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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，则按可赎回金额作为转入变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的转入金额。

3、变更后的“长盛同鑫行业配置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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或“长盛同鑫行业配置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。

## 第二十章 风险揭示

保本基金面临的风险主要有本金损失风险、流动性风险、市场风险和担保风险。本金损失风险是指投资人面临的无法全额收回本金的可能性。流动性风险主要指基金投资的股票流动性差使基金在调整投资组合时基金资产受损。市场风险主要包括利率波动导致债券收益率和价格波动的风险以及利息再投资风险。担保风险主要指本基金在引入了担保人机制下也会因个别情况的发生而导致保本周期到期日不能偿付本金的风险。

#### （一）本金损失风险

在正常情况下，基金管理人可以基本控制本金损失的风险，但在一些极端情况下基金资产将面临较大的本金损失风险。目前看来，极端情况主要是以下

两种：

#### 1、基金所投资债券发行人违约

如果债券发行人到期不能偿还本息，则会出现债券发行人违约风险，因此本基金投资将以国债和 AAA 级企业债券为主，到目前为止，尚未出现该类债券发行人违约情况。

#### 2、基金所投资股票大面积持续无量跌停

我国股票市场偶尔出现个别股票持续无量跌停，如果基金所投资股票组合中同时出现多只股票持续无量跌停，则将导致基金的收益资产跌破安全垫，从而使持有人本金受损。

本基金的股票投资以稳健投资、组合投资为原则，主要选取基本面好、流动性高、市盈率低或具有良好分红记录的价值股，构建股票组合。公司完善的内控制度和投资流程将保证本基金的投资严格遵守基金契约。

而且，本基金为确保本金安全，引入了担保机制。如果基金持有人持有到期，可赎回金额加上保本期间的累计分红金额低于其投资净额，担保人应保证向持有人承担上述差额部分的偿付并及时向基金持有人清偿。

### （二）流动性风险

流动性风险的定义是：基金资产不能迅速、低成本地转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者巨额赎回的风险。

前者是指金融资产不能及时变现或无法按照正常的市场价格交易而引起损失的可能性，特别地，当基金股票资产流动性差或者股票投资占基金净资产比例很高时，一旦股票市场波动幅度巨大，基金股票资产的损失有可能超过基金股票投资损失的限额，导致投资人本金受损。为控制此类风险，一方面，在每一保本周期开始前，基金管理人将根据对政策的把握和对市场的研判决定股票的投资比例；另一方面，在基金每一保本周期内，投资决策委员会定期调整 CPPI 策略各要素，并且基金经理根据研究团队的研究成果选择高流动性的资产构建投资组合分散风险。

后者是指在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金单位净值。为应付投资者的赎回，基金资产需保持一定的流动性，从而在收益性方面可能

会有些损失，影响基金投资目标的实现。基金管理人将通过保持适当的现金比例和债券股票投资组合的流动性应付持有人的赎回，而且，保本基金的运做模式、特点和费率结构也将降低投资人在保本周期中巨额赎回的可能性。

### （三）市场风险

#### 1、利率波动导致的风险

市场利率波动会导致债券市场的收益率和价格的变动，如果市场利率上升，本基金持有债券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，债券利息的再投资收益将面临下降的风险。基准利率调整作为货币政策的重要工具之一，在现代市场经济中发挥着越来越大的作用。随着中国经济由计划经济转为市场经济，市场由卖方市场转变为买方市场，利率政策的作用为经济决策者所知晓，利率政策在国民经济中的重要性不断上升。为维持经济增长速度和支持国有企业改革，从 96 年至今，人民银行已经多次下调了利率，使得利率水平已经处在低位，客观上存在利率上升的风险。

本基金主要投资剩余期限与保本周期相匹配的债券，相当于建立了免疫投资组合，其主要债券投资基本不受利率波动的影响。因此，利率波动的风险主要是无法买到足够量的剩余期限与本金保本周期相匹配的高信用等级的债券，国内债券市场的债券存量表明，在正常情况下，本基金能够买到足够量的剩余期限与本金保本周期相匹配的高信用等级的债券。

#### 2、利息再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，具体为当利率下降时，从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。中国保本基金在运作中缺乏剩余期限与本金保本周期相匹配的零息债券，本基金将面临债券利息再投资风险。在基金运作中，本基金将综合考虑利率风险和利息再投资风险以决定债券资产的投资。

### （四）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

### （五）担保风险

本基金在引入了担保人机制下也会因下列情况的发生而导致保本周期到期日不能偿付本金，由此产生担保风险，这些情况包括：在保本周期内本基金更换管理人，而担保人不同意继续承担保证责任；或发生不可抗力事件，导致担保人无法履行保证义务；或保本周期内担保人因经营风险丧失保证能力从而无法履行保证责任。

## 第二十一节 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金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。

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。

3、变更基金合同涉及的内容属于基金合同约定的无需召开基金份额持有人大会审议的事项的，无需召开基金份额持有人大会，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、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；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和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:

(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。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。

#### 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十五年以上。

## 第二十二节 基金合同内容摘要

### （一）基金合同当事人及其权利、义务

#### （A）基金管理人的权利和义务

##### 1、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- （3）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认购、申购、赎回、转托管、转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （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，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回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他费用；
- （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，依据法律法规和基金合同的规定对基金托管人进行必要的监督，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）根据有关法律法规、基金合同的规定选择适当的基金代销机构并对

基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行担任基金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) 以基金管理人的名义，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；

(14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(15) 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；

(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) 法律法规、基金合同所规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

(2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(3) 配备足够的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；

(4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金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法律法规规定外，不得以基

金财产为自己及任何第三人谋取不当利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 接受基金托管人依法进行的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(9) 按照有关法律法规规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(10) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关法律法规规定，履行信息披露及报告义务；

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

(12) 按基金合同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；

(13) 按照法律法规和基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

(14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关法律法规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) 保本周期到期日若发生需要保本赔付的情形，则基金管理人应补足保本赔付差额，并根据基金合同约定将该差额支付至指定账户。如基金管理人未能全额补足保本赔付差额，则应根据基金合同约定向担保人发出书面《履行保证责任通知书》，并要求担保人在收到通知书后的约定期限内将需清偿的金额支付至指定账户。基金管理人最迟应在保本周期到期日后 20 个工作日内将保本赔付差额支付给基金份额持有人；

(17) 按规定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；

(18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(19) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料在规定时间内发出,保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并得到有关资料的复印件;

(21) 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;

(22) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(23) 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;

(24) 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;

(25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动;

(26) 公平对待所管理的不同基金,防止在不同基金间进行有损基金份额持有人利益的资源分配;

(27) 以基金管理人的名义,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;

(28) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (B) 基金托管人的权利和义务

### 1、基金托管人的权利

(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;

(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) 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,负责基金财产托管事宜;

- (3) 按规定开设基金财产的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，不得以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) 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) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 根据法律法规及本基金合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，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；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核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；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 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；
- (16) 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；
- (17) 按照相关规定监督基金管理人的投资运作；
- (18) 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；
- (19) 因基金管理人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，除法律法规和本基金合同另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

(20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(C) 基金份额持有人的权利和义务

1、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，投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开或依法自行召集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、基金份额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、基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

(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、申购款项及基金合同规定的费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法权益的活动；

(5) 执行基金份额持有人大会的决议；

(6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(7) 遵守基金管理人、销售机构和基金注册登记机构的相关交易及业务规则；

(8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(A) 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或基金份额持有人的合法代理人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(B) 有以下事由情形之一时，应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、转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- 3、更换基金托管人；
- 4、更换基金管理人；
- 5、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；
- 6、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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”并按基金合同约定的“长盛同鑫行业配置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；
- 7、本基金与其他基金的合并；
- 8、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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的除外；
- 9、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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”并按《基金合同》约定的“长盛同鑫行业配置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；
- 10、变更基金份额持有人大会程序；
- 11、对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；

12、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。

(C) 以下情况不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费率、基金托管费率，或者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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”并按基金合同约定的“长盛同鑫行业配置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；

2、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“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”并按《基金合同》约定的“长盛同鑫行业配置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；

3、在法律法规和基金合同规定的范围内调低本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

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重大变化；

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、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、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；

9、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。

(D) 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（含百分之十）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（含百分之十）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（含百分之十）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（含百分之十）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。

#### （E）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前三十天，在中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。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应至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 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，还应载明具体通讯方式、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。

#### (F) 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；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。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

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、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，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的百分之五十(含百分之五十)。

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布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人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百分之五十(含百分之五十)；

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应保持不变。

(G) 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(二)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、单独或合并持有权益登记日本基金总份额百分之十或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) 单独或合并持有权益登记日基金总份额百分之十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，报中国证监会批准或备案；

若召集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以所持表决权的 50% 以上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。

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中提前十天公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关公证下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会批准或备案后生效。

## (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

### (A) 基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金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。

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。

3、变更基金合同涉及的内容属于基金合同约定的无需召开基金份额持有人大会审议的事项的，无需召开基金份额持有人大会，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### (B) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、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；

#### 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》《运作办法》《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

#### (C) 基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和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：

- (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。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。

### (四) 争议的处理

(A) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(B) 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，根据提交仲裁时该会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。

(C) 除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

### (五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同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。

## 第二十三节 基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

本基金托管协议当事人基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

### (二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

#### A. 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(A) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，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。

(1) 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时，投资范围、投资对象适用如下约定：

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于股票（包括一级、二级市场股票）资产占基金资产的比例不高于 30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产（包括国债、央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）占基金资产的比例不得低于 70%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

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。

(2) 本基金在过渡期内时，基金的投资范围、投资对象适用如下约定：基金管理人应在过渡期内使可变现的基金资产保持为现金形式。

(3) 若本基金保本周期到期后变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，则基金的投资适用如下约定：

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 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（包括一年以内的短期国债、回购协议等）、资产支持证券以及法律法规或中国证

监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 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%。

基金管理人应将拟投资的股票库、债券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，并及时通知基金托管人。

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：

本基金在非过渡期内，投资组合比例限制如下：

- (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) 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%；
- (5) 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%；
- (6) 本基金持有的同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (8) 本基金管理人管理的全部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%；
- (9) 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；
- (10) 本基金不投资于权证，若转型为非保本其他类型基金时，则遵循转型后的基金组合对于投资权证所约定的相关限制；
- (11) 本基金投资于股票（包括一级、二级市场股票）资产占基金资产的比例不高于 30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产（包括国债、

央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等)占基金资产的比例不得低于70%；

(12)本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的流通受限证券,且投资流通受限证券的锁定期不得超过当期保本周期的剩余存续期；

(13)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

3、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。

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库,交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。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。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应在交易对手库中。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否在交易对手库中进行监督。

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督：

基金管理人应按照审慎的风险控制原则,对银行间交易对手的资信状况进行评估,控制交易对手的资信风险,确定与各类交易对手所适用的交易结算方式,在具体的交易中,应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失,基金托管人不承担赔偿责任。

6、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在名单中进行监督。

7、对法律法规规定的基金投资的其他方面进行监督。

(B)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监督和核查。

B. 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,基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

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。

### (三) 基金财产的保管

#### (A) 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、除依据《基金法》《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### (B) 基金合同生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期限届满或基金管理人宣布停止募集时,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《基金法》《运作办法》等有关规定的,由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所

所对基金进行验资,并出具验资报告,出具的验资报告应由参加验资的2名以上(含2名)中国注册会计师签字方为有效。

2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中,并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

#### (C) 基金的银行账户的开设和管理

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银行账户。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,均需通过本基金的银行账户进行。

3、本基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;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、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### (D) 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料,并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### (E) 基金证券账户和资金账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金,以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户,亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### (F) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### (G) 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### (H) 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

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。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。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 15 年。

### (四) 基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值。

2、基金管理人应每工作日对基金财产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。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，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的该基金份额净值，以约定方式报给基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按照规定对外公布。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3位内（含第3位）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；当计价错误达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。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、除本协议和基金合同另有规定外，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及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。

7、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算机构发送的数据错误，基金管理人及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，基金管理人及基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人及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。

8、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意见，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。

## （五）基金份额持有人名册的登记与保管

### （A）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。

### （B）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 个工作日内向基金托管人提供。

### （C）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基金份额持有人名册，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。

## （六）争议解决方式

（A）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商或调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，并按届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。

（B）除争议所涉及的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定

## （七）托管协议的变更与终止

### （A）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准，并依法公告。

#### (B) 托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 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。

### 第二十四节 对基金份额持有人的服务

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。

基金管理人不定期发送不同资讯,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.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)

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

## 第二十五节 其他应披露的事项

(一) 本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

(二) 最近3年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚。

(三) 2011年12月21日本基金管理人发布长盛同鑫保本混合型证券投资基金(更新)全文及其摘要。

(四) 2012年1月16日本基金管理人发布长盛同鑫保本混合型证券投资基金收益分配公告。

(五) 2012年1月16日本基金管理人发布长盛基金关于开通旗下部分基金转换业务的公告。

(六) 2012年1月20日本基金管理人发布长盛同鑫保本混合型证券投资基金2011年第4季度报告。

(七) 2012年2月1日本基金管理人发布关于增加民生证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告。

(八) 2012年2月1日本基金管理人发布关于增加五矿证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出网上申购费率优惠活动的公告。

(九) 2012年3月15日本基金管理人发布关于在部分代销机构开通旗下基金转换业务的公告。

(十) 2012年3月15日本基金管理人发布关于中国农业银行系统升级暂停网上交易的通知。

(十一) 2012年3月28日本基金管理人发布长盛同鑫保本混合型证券投资基金2011年年度报告全文及其摘要。

(十二) 2012年4月17日本基金管理人发布长盛基金管理有限公司上海分公司注册地址及负责人变更的公告。

(十三) 2012年4月20日本基金管理人发布关于旗下部分开放式基金参与申银万国证券申购费率优惠及定期定额投资业务的公告。

(十四) 2012年4月20日本基金管理人发布关于增加红塔证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告。

(十五) 2012年4月21日本基金管理人发布长盛同鑫保本混合型证券投

资基金 2012 年第 1 季度报告。

(十六)2012 年 4 月 28 日本基金管理人发布关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告。

## 第二十六节 招募说明书的存放和查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 第二十七节 备查文件

### (一) 备查文件目录

- 1、中国证监会批准长盛同鑫保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《保证合同》
- 4、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金保函》
- 5、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、关于募集长盛同鑫保本混合型证券投资基金的法律意见书；
- 7、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 9、担保人的基本资料。

### (二) 备查文件存放地点

本基金管理人长盛基金管理有限公司办公地点—北京海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层。

### (三) 投资者查阅方式

可咨询本基金管理人，部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

长盛基金管理有限公司

二 一二年六月十二日

## 附件一、《保证合同》

甲 方: 长盛基金管理有限公司

公司地址: 北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人: 凤良志

电话: 010-82019988

传真: 010-82255988

邮编: 100088

乙 方: 安徽省信用担保集团有限公司

公司地址: 安徽省合肥市长江西路 200 号

法定代表人: 钱正

电话: 0551-5227521

传真: 0551-5176256

邮编: 230031

乙方同意为甲方在《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》中承担的保本义务向认购长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金份额并持有到期的基金份额持有人以保证的方式提供担保, 甲、乙双方依照国家法律法规的规定, 经协商一致, 订立本合同。

### 第一条 释 义

- 1.1 基金或本基金: 指长盛同鑫保本混合型证券投资基金;
- 1.2 《基金合同》: 指《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及对《基金合同》的任何有效的修订和补充;
- 1.3 基金份额持有人: 指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金份额的投资者;
- 1.4 保本周期到期日: 指本基金保本周期届满的最后一日。本基金的

保本周期为三年，自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日；

- 1.5 持有到期：指基金份额持有人在保本周期内一直持有其所认购的基金份额的行为；
- 1.6 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 1.7 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值。
- 1.8 不可抗力：指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征收征用、没收、法律法规变化、恐怖袭击、传染病传播或其他突发事件。

《基金合同》与本合同项下之词语和表述均应具有相同的含义，如有冲突，以《基金合同》为准。

## **第二条 担保额度**

- 2.1 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。
- 2.2 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。
- 2.3 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。

## **第三条 保证先决条件**

除非本条所规定的保证先决条件已获满足或已被乙方放弃，否则，乙方有权拒绝为甲方提供保证。

- 3.1 甲方作为本基金的管理人，自主承担基金的投资管理和风险控制义务，对基金的投资运作负全部责任；
- 3.2 乙方作为本基金保本的担保人，对基金的运作享有必要的知情权和监控权，其监控行为以不侵害基金份额持有人的利益，不影响甲方独立按照法律、法规、基金合同及相关各方签订的法律文件进行自主基金管理运作为限；
- 3.3 乙方在不违反法律法规、监管机构相关政策和保守甲方商业秘密的前提下，可获得甲方提供的风险监控信息；
- 3.4 《基金合同》项下与保本及保本的保证有关的约定不得违反本合同项下的约定；

#### **第四条 保证内容**

##### **4.1 保证的范围**

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金额的差额部分。

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。

##### **4.2 保证期间**

基金保本周期到期日起六个月。

#### 4.3 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。

#### 4.4 保证受益人

认购本基金并持有到期的基金份额持有人。

#### 4.5 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金额;
- (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, 导致本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务。

#### 第五条 担保费的收取

- 5.1 甲方应按本条规定向乙方支付担保费。
- 5.2 担保费收取方式: 担保费从甲方收取的本基金管理费中列支, 按 5.3 款公式每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付。甲方应自每月收到基金管理费之日起 2 个工作日内向乙方支付担保费。
- 5.3 每日担保费计算公式=担保费计提日前一日基金资产净值×0.2%×1/当年日历天数

## 第六条 到期偿付制度安排

### 6.1 到期保本偿付准备及代偿准备

#### 6.1.1 保本偿付准备:

- (1) 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;
- (2) 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。
- (3) 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。

### 6.1.2 代偿准备

- (1) 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；
- (2) 在保本周期到期日后十个工作日内，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。

## 6.2 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，且根据本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：

- (1) 本合同第 6.1.1（3）约定的共管帐户内的风险准备金；
- (2) 甲方的自有资金；
- (3) 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一次性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，而不得对甲方调度自有资金的情况及方式提出异议，乙方对相关基金份额持有人的保证责任即视为履行完毕，代偿款项的分配与支付由甲方负责。

### 6.3 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。

## 第七条 乙方的追偿权

乙方承担了保证责任后，即有权要求甲方在乙方代偿之日起三十日内归还乙方为承担保证责任支付的全部款项和自乙方代偿之日起以乙方支付的全部款项为基数，按每日万分之四计算应付给乙方的资金占用费。

## 第八条 甲方的权利与义务

### 8.1 甲方权利义务

- (1) 甲方有权在遵守《基金合同》和《风险监管协议》条款的前提下自主进行本基金的管理及运作。
- (2) 甲方应按约定向乙方支付担保费。
- (3) 若甲方未能按本合同第七条约定向乙方清偿本合同第七条约定的全部款项，逾期每日须加付未付款项万分之二的违约金。
- (4) 未经乙方书面同意，甲方不得以任何形式对《基金合同》的条款进行修改，加重乙方保证责任，但根据法律法规要求进行修改除外。

### 8.2 乙方权利义务

- (1) 乙方有权按约定收取担保费；
- (2) 乙方有义务按照本合同的约定提供和承担保证责任；

- (3) 乙方承担了保证责任后, 有权按本合同第七条的约定, 要求甲方归还乙方为承担保证责任支付的全部款项;
- (4) 受限于本合同 3.2 条, 乙方有权对甲方管理、运作本基金的行为进行监控, 具体内容见乙方与甲方签订的《风险监控协议》。

### 8.3 双方的通知义务

除本合同另有规定, 在本合同有效期内, 合同任何一方有下列情形之一, 应自知悉以下情形之日起三日内, 以书面形式通知对方:

- (1) 发生或可能发生合并、分立、重组、兼并、股份制改造等公司形式的重大变更情形;
- (2) 发生或可能发生超过净资产(指最近一次经审计的净资产)10%的重大资产转让、处置、举借新债或其他可能导致同等影响的财务状况变更;
- (3) 信用评级机构对一方的信用评级发生消极变化;
- (4) 变更名称、住所、经营范围、注册资本、法定代表人;
- (5) 发生或可能发生被监管机构吊销营业执照、取消业务资格等导致丧失履行本合同民事权利能力或行为能力的情形;
- (6) 发生或可能发生终止经营、清算、申请解散、被接管或撤销、被法院宣告破产、被责令关闭、被行政管理机关、监管机构处罚等事宜;
- (7) 发生或可能发生的资产被查封、冻结、扣押或被采取其它强制措施等情形;
- (8) 发生致使一方不再符合担任本基金的基金管理人或担保人

的任何情形;

(9) 出现导致其不能履行本合同项下义务的其它情形。

## 第九条 权利、义务的转让

未经另一方书面同意, 本合同任何一方不得将其在本合同项下的权利、义务转让给任何其他第三方。

## 第十条 违约责任

10.1 本合同期限内, 如出现不可抗力因素, 致使本合同无法正常履行时, 双方对本合同均不承担责任。遭遇不可抗力一方应在其能力范围内积极采取措施以阻止损失进一步扩大, 对其未尽合理努力导致损失进一步扩大的, 就该损失扩大部分向对方承担赔偿责任。

10.2 甲方没有按约定向乙方支付担保费的, 应按逾期支付部分每日万分之二的标准向乙方支付违约金, 但违约金总额不超过逾期款项的 3%。

10.3 乙方没有按 6.2 条的约定向基金份额持有人进行偿付的, 应按未偿付部分 3%的标准向甲方支付违约金。

10.4 甲方没有按约定向乙方偿付代偿款的, 应按逾期支付部分每日万分之二的标准向乙方支付违约金, 但违约金总额不超过逾期款项的 3%。

10.5 若因一方违约给另一方造成损失且违约金不足以弥补全部损失的, 则违约一方应支付相应的赔偿金, 同时应承担对方为实现债权付出的合理费用。

10.6 违约方就迟延履行支付违约金后, 还应当履行债务并继续履行本合同项下义务。

## 第十一条 义务和责任的连续性

本合同项下双方义务与责任不因任何一方与其它单位签订任何协议、合同、文件的无效等情形而免除；不因任何一方发生变更法人名称、法定代表人、承办人等情形而免除。本合同双方当事人如发生合并、分立等变更情形时，发生变更的一方应确保由变更后的当事人承担或分别承担本合同项下的义务与责任。

## 第十二条 通知送达

12.1 甲乙双方之间的书面通知，可由专人送达、挂号邮递、特快专递、传真等方式传送。

12.2 下列情形视为通知送达：

- (1) 专人递送的通知，在专人递送之交付日为有效送达；
- (2) 以挂号信发出的通知，在寄出(以邮戳为凭)后的第 4 日为有效送达；
- (3) 以特快专递发出的通知，在寄出(以邮戳为凭)后的第 3 日为有效送达；
- (4) 以传真发出的通知，在传真发出时视为送达。

12.3 双方在本合同中填写的住所地即为其有效的通讯地址。

12.4 双方有权在任何时候更改其通讯地址，但应当在发生变更之日起三个工作日内根据本条规定及时向对方送达变更通知。

## 第十三条 合同的签署、生效、终止、变更和解除

13.1 双方保证代表其签署本合同的为其法定代表人或其合法的授权代表；

13.2 双方保证签署和履行本合同是其真实意思表示，双方已依照各自的公司章程和相关法律法规的规定经过所有必需的同意、批准和授权（包括但不限于股东会决议或董事会决议）；

13.3 本合同自甲乙双方法定代表人(或授权代理人)签字并加盖公司公章之日起生效。

13.4 本基金保本周期到期日后，甲乙双方全面履行了本合同及《基金合同》规定的义务的，本合同终止。乙方承诺继续对下一保本周期提供担保的，双方另行签署合同。

13.5 本合同生效后，甲、乙双方任何一方不得擅自变更或提前解除本合同，如本合同需要解除时，应经甲、乙双方协商一致，并达成书面协议。但在依据有关法律法规的规定，一方已不具备继续担任本基金管理人或担保人的资质时，另一方有权书面通知另一方解除本合同。甲方依据本条解除本合同后，有权依据《基金合同》的约定重新聘任担保机构。须报请主管部门批准的，合同的解除在批准后生效。

#### **第十四条 合同的补充、修改和解释**

14.1 本合同生效后的任何补充或修改均须由各方协商一致并均应以书面形式作出，并构成本合同的组成部分。须报请监管部门批准的，合同的补充或修改在批准后生效；

14.2 本合同的解释应当按照本合同的目的、所使用的词句、有关条款、交易习惯以及诚实信用原则，确定合同条款的真实意思。

#### **第十五条 争议的解决**

在履行本合同过程中发生争议时，甲乙双方应通过协商解决；协商不成的，任何一方可提请中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁地点在北京，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的裁决是终局的，对双方均有约束力。在协商或仲裁期间，本合同不涉及争议部分的条款，仍须履行。

**第十六条 不放弃权利**

乙方除以书面形式表示放弃本合同项下权利外，对全部或部分权利未行使、延迟行使或对甲方降低条件和程序要求的，不视为乙方对权利的放弃。

**第十七条 其他**

本合同文本一式六份，甲方执 份，乙方执 份。本合同序言和附件是本合同的一部分，与本合同具有同等法律效力。

(本页为签署页，无正文)

甲方：长盛基金管理有限公司  
(公章)

法定代表人或授权代表：

(签字): \_\_\_\_\_

乙方：安徽省信用担保集团有限公司  
(公章)

法定代表人或授权代表：

(签字): \_\_\_\_\_

签署日期： 年 月 日

签署地点：

附件:

## 履行保证责任通知书

[?]:

长盛基金管理有限公司发行的长盛同鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)保本周期已于 年 月 日到期,保本周期到期日本基金的基金份额净值为:人民币[?]元;基金份额持有人认购并持有到期的基金份额总数为 。至保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的每一基金份额在持有期内累计分红款项为:人民币[?]元,保本周期内累计分红款项为:人民币[?]元。

根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”),本基金未能实现到期保本。保本周期到期日,本基金认购保本差额以及对应的基金份额持有人认购并持有到期的基金份额分别如下:

认购保本差额为:

基金份额持有人认购并持有到期的基金份额总数为:

本基金保本差额总额为人民币[?]元,本公司已经按照《基金合同》的约定调度自有资金向基金持有人支付人民币[?]元,尚需贵公司代偿人民币[?]元(以下简称“代偿款项”)。请贵公司按照《保证合同》的约定,在收到此通知书之日起五个工作日将代偿款项支付至本基金在基金托管人处开立的以下账户中:

户名: [?]

开户行: [?]

帐号: [?]

贵公司将代偿款项支付至该账户后即为全部履行了保证责任。代偿款项的分配与支付由本公司负责,贵公司对此不承担责任。

本通知书中所有数据及计算以基金托管人复核的数据为依据。

长盛基金管理有限公司

[?]年 [?]月[?]日

## 附件二、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金保函》

致：长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金份额持有人

本保函是安徽信用担保集团有限公司为认购长盛同鑫保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）并持有基金份额到本基金保本周期到期日的基金份额持有人的利益而订立，在符合法律、法规及本保函规定之前提下，认购基金份额并持有到期的基金份额持有人可有效地享有本保函的利益。

在《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）中，基金管理人同基金份额持有人约定了持有到期基金份额投资金额损失风险的保本条款（见《基金合同》第十四部分）。为保障基金份额持有人利益，本担保人愿就基金管理人对该条款的履行提供不可撤销的连带责任保证。

除非本保函另有约定，本保函所使用的词语或简称与其在《基金合同》中的释义部分具有相同含义。

### 一、保证的范围和最高限额

保证范围：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。

保本周期到期日是指本基金保本周期届满的最后一日。本基金的保本周期为 3 年，自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

### 二、保证期间

保证期间为基金保本周期到期日起六个月。

### 三、保证的方式

在保证期间，本担保人在保证范围内承担不可撤销的连带保证责任。

### 四、保证责任的履行

在保本周期到期日，如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，且基金管理人未按基金合同的约定向基金份额持有人支付该差额的，本担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》（应当载明保本差额总和）后的五个工作日内主动将差额款项一次性足额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户中。担保人将差额款项足额划入本基金在基金托管人处开立的上述账户中后即为全部履行了保证责任，无须对基金份额持有人逐一进行清偿，代偿款的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

担保人逾期未主动履行保证责任的，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担保人按照本保函的约定履行保证责任。

### 五、除外责任

下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：

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，且担保人不同意继续承担保证责任；

6、在保本周期到期日后（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，导致本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务。

## 六、适用法律及争议解决方式

本保函适用中华人民共和国法律。发生争议时，各方应通过协商解决；协商不成的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

七、本保函自基金合同生效之日起生效。

担保人：安徽省信用担保集团有限公司（盖章）

法定代表人或委托代理人（签字）：

年 月 日