

长盛添利宝货币市场基金招募说明书

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

长盛添利宝货币市场基金（以下简称“本基金”）于2013年11月4日获中国证监会证监许可【2013】1403号文准予注册。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金为货币市场基金，属证券投资基金中的较低风险收益品种。投资者购买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，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，谨慎做出投资决策，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。

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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

目 录

第一节 绪言.....	1
第二节 释 义.....	2
第三节 基金管理人.....	7
第四节 基金托管人.....	16
第五节 相关服务机构.....	18
第六节 基金份额的类别.....	20
第七节 基金的募集.....	22
第八节 基金合同的生效.....	25
第九节 基金份额的申购与赎回.....	26
第十节 基金的投资.....	37
第十一节 基金的财产.....	45
第十二节 基金资产的估值.....	46
第十三节 基金的费用与税收.....	50
第十四节 基金的收益与分配.....	53
第十五节 基金的会计与审计.....	55
第十六节 基金的信息披露.....	56
第十七节 风险揭示.....	62
第十八节 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	65
第十九节 基金合同的内容摘要.....	67
第二十节 基金托管协议的内容摘要.....	84
第二十一节 对基金份额持有人的服务.....	95
第二十二节 招募说明书的存放和查阅方式.....	98
第二十三节 备查文件.....	99

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》”)《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(以下简称“《通知》”)《证券投资基金信息披露编报规则第5号<货币市场基金信息披露特别规定>》(以下简称“《信息披露特别规定》”)《证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号 基金合同的内容与格式》和其他相关法律法规的规定以及《长盛添利宝货币市场基金基金合同》(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,并经中国证监会注册。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

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指长盛添利宝货币市场基金
- 2、基金管理人：指长盛基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《长盛添利宝货币市场基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛添利宝货币市场基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《长盛添利宝货币市场基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《长盛添利宝货币市场基金基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指 2013 年 2 月 17 日经中国证券监督管理委员会第 28 次主席办公会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施并于 2012 年 6 月 19 日修订的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

14、**银行业监督管理机构**：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

15、**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

16、**个人投资者**：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

17、**机构投资者**：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、**合格境外机构投资者**：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

19、**投资人**：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及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人的合称

20、**基金份额持有人**：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、**基金销售业务**：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务。

22、**销售机构**：指长盛基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

23、**登记业务**：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

24、**登记机构**：指办理登记业务的机构。基金的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登记业务的机构

25、**基金账户**：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

26、**基金交易账户**：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管业务而引起基金的基金份额变动及

结余情况的账户

27、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

28、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

29、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过三个月

30、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

33、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)，n指自然数

34、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

35、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

36、《业务规则》：指《长盛基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守

37、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

38、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

39、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

40、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

41、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

42、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

43、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

44、元：指人民币元

45、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

46、摊余成本法：指估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益

47、每万份基金已实现收益：指按照相关法规计算的每万份基金份额的日已实现收益

48、七日年化收益率：指以最近 7 日(含节假日) 每万份基金已实现收益所折算的年资产收益率

49、销售服务费：指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用，该笔费用从基金财产中扣除，属于基金的营运费用

50、基金份额分类：本基金分设两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率

51、A 类基金份额：指按照 0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别

52、B 类基金份额：指按照 0.01%年费率计提销售服务费的基金份额类别

53、升级：指当投资人在单个基金账户保留的 A 类基金份额达到 B 类基金份额的最低份额要求时，基金的登记机构自动将投资人在该基金账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额

54、降级：指当投资人在单个基金账户保留的 B 类基金份额不能满足该类基金份额的最低份额要求时，基金的登记机构自动将投资人在该基金账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额

55、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应

收申购款及其他资产的价值总和

56、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

57、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

58、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每万份基金已实现收益、七日年化收益率的过程

59、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

60、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

61、中国：指中华人民共和国。就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

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诺德金融中心主楼 10D

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%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。截至 2013 年 10 月 31 日，基金管理人共管理两只封闭式基金、二十九只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

(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，管理学博士，经济学硕士，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，国元证券股份有限公司董事长、党委书记。

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，国元证券股份有限公司董事、总裁、党委副书记。

现任国元证券股份有限公司董事长、党委书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任公司党委委员，国元证券（香港）有限公司董事长。

钱正先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽省人大常委办公厅副处长、处长，安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记，安徽省国有资产管理局分党组书记。现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，安徽省投资集团控股有限公司董事长、党委书记。现任长安责任保险股份有限公司董事长。

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。

葛甘牛先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括所罗门兄弟公司、瑞士信贷第一波士顿银行（香港）有限公司、美林集团、德意志银行、荷兰银行、中银国际控股有限公司、瑞士信贷银行股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司。现任星展银行（中国）有限公司董事、行长/行政总裁。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。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，兼任长盛基金（香港）有限公司董事长。

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，博士，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、香港浸会大学工商管理学院院长。现任香港教育学院校长、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，学士，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，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

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。

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。

邓永明先生，监事，学士。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005 年 7 月底加入长盛基金管理有限公司，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任长盛基金管理有限公司权益投资部副总监，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

3. 管理层成员

凤良志先生，董事长，管理学博士，经济学硕士，高级经济师。同上。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

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，兼任长盛基金（香港）有限公司董事、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

张帆先生，1983年1月出生。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012年4月加入长盛基金管理有限公司，曾任非信用研究员。现任长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理，长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。拟任长盛添利宝货币市场基金基金经理。

（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

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。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，曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理、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等职务。现任公司总经理助理，权益投资部总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）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，现任公司总经理助理，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,历任星展珊瑚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,曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。现任国际业务部总监,长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,兼任长盛基金(香港)有限公司副总经理。

蔡宾先生,中央财经大学硕士,美国特许金融分析师 CFA。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、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务。现任固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

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总监,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。

魏斯诺先生,英国雷丁大学硕士。历任中国人寿资产管理有限公司投资组合经理、高级组合经理,合众资产管理有限公司组合管理部总经理。2013年7月加入长盛基金管理有限公司,现任社保业务管理部总监,社保组合组合经理。

刘旭明先生,清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013年7月加入长盛基金管理有限公司,现任研究部总监。

邓永明先生,监事,学士。同上。

李庆林先生,硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究发展部副总监,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基

金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任社保组合组合经理。

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、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值、各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率，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、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《基金法》及相关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反上述法律法规的行为发生；

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁

止的其他行为。

3、基金经理承诺

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

(2) 不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

(4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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

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

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

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

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

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

2、完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”(董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部)内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况，组织指导公司监察稽核工作，对基金运作、内部管理、

制度执行及遵纪守法进行监察稽核 ;公司风险控制委员会定期对基金资产运作的风险进行评估 ,对存在的风险隐患或发现的风险问题进行研究 ;监察稽核部负责日常的风险监控工作 ,对公司各部门业务流程的风险控制工作进行监察稽核 ,并通过全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度 ,从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面及时和全面揭示风险控制要素 ,明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法 ,使得对各风险点的监控真正落到实处。

3、内部控制制度的内容

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

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

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、稽核监察制度、投资管理制度、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总经理办公会批准。

公司的内部控制制度会随着市场的发展和金融创新来进行相关调整。一般而言 ,当市场有变化或主管部门有新的规章制度时 ,相关制度会相应更改。公司各部门对规章制度的调整与更新情况由监察稽核部负责监督。

4、内部控制实施

(1) 建立了详细的内部控制指引 ,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

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟捌佰肆拾捌万壹仟玖佰叁拾捌元整

法定代表人：田国立

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

(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，为充分体现“以客户为中心”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，现有员工120余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2013 年 9 月 30 日，中国银行已托管 233 只证券投资基金，其中境内基金 209 只，QDII 基金 24 只，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

中国银行托管及投资者服务部风险控制工作是中国银行风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管及投资者服务部风险控制工作贯穿所辖业务各环节，包括风险识别，风险评估，工作程序设计与制度建设，风险检视，工作程序与制度的执行，工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

中国银行托管业务从 2007 年已经连续四年通过美国“SAS70”准则和英国“AAF01/06”准则审计报告，是国内唯一一家通过两种国际准则的托管银行，内控制度完善、风险防范严密，能够有效保证托管资产的安全。2011、2012 年度，中国银行托管业务内部控制通过国际新准则“ISAE3402”，是国内第一家获得此报告的托管银行，再次领先于同业。

（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 相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

法定代表人：凤良志

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：田国立

联系人：宋府

电话：(010) 66594904

传真：(010) 66594942

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

（2）其他代销机构（详见本基金基金份额发售公告）

（二）登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

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：龚珉

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

联系人：张兰

经办律师：刘佳、张兰

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

执行事务合伙人：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办注册会计师：汪棣、叶尔甸

第六节 基金份额的类别

（一）基金份额分类

本基金根据基金份额持有人持有本基金的份额数量进行基金份额类别划分。本基金将设 A 类和 B 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，按照不同的费率计提销售服务费，并单独公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

A 类基金份额的基金代码为 000424，B 类基金份额的基金代码为 000425。

根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人可对基金份额分类进行调整并公告。

（二）基金份额类别的限制

投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别，不同基金份额类别之间不得互相转换，但依据基金合同、本招募说明书约定因认购、申购、赎回、基金转换等交易及每月收益结转份额而发生基金份额自动升级或者降级的除外。

本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额的适用费率和金额限制如表 1。

表 1：基金份额分类的适用费率和金额限制

	A 类基金份额	B 类基金份额
年销售服务费率	0.25%	0.01%
管理费	0.33%	0.33%
托管费	0.10%	0.10%
认（申）购费	0	0
赎回费	0	0
首次单笔认（申）购最低金额	1 元	500 万元
在基金账户保留的最低份额余额	——	500 万份

投资者在基金账户保留的 B 类基金份额最低余额为 500 万份（含 500 万份），若最低余额小于 500 万份，则本基金的登记机构自动将其基金账户的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，与基金托管人

协商一致并在履行相关程序后，调整认（申）购各类基金份额的最低金额限制及规则，基金管理人必须至少开始调整前 2 日在指定媒体上刊登公告。

（三）基金份额的自动升降级

当投资人在单个基金账户保留的 A 类基金份额满足 B 类基金份额类别的最低份额要求时，登记机构自动将投资人在该基金账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额。

当投资人在单个基金账户保留的 B 类基金份额不能满足 B 类基金份额最低份额要求时，登记机构自动将投资人在该基金账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额。

（四）基金管理人可以在不违反法律法规的情况下，增加新的基金份额类别，或者调整现有基金份额类别设置及各类别的金额限制、费率水平、基金份额升降级数额限制及规则，或者停止现有基金份额类别的销售等，调整前基金管理人需及时公告并报中国证监会备案。

第七节 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 2013 年 11 月 4 日证监许可【2013】1403 号文准予注册。

（一）基金类别、存续期间与运作方式

- 1、基金类别：货币市场基金。
- 2、基金存续期间：不定期。
- 3、基金的运作方式：契约型开放式。

（二）募集概况

1、募集方式：本基金将通过基金管理人的直销机构及基金代销机构的代销网点或按基金管理人直销机构、代销机构提供的其他方式办理公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。本基金认购采取全额缴款认购的方式。基金投资者在募集期内可多次认购。认购一经受理不得撤销。

2、募集期限：本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及基金合同的规定确定，并在基金份额发售公告中披露。

3、募集对象：本基金的募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者及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。

4、基金募集规模：本基金的募集份额总额应不少于 2 亿份，基金募集金额应不少于 2 亿元人民币。

本基金不设募集规模上限。基金管理人可根据基金发售情况对本基金的发售进行规模控制，具体规定见本基金基金份额发售公告。

除法律、行政法规或中国证监会有关规定另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。

5、基金的面值、认购价格及认购费用

本基金每份基金份额初始面值为人民币 1.00 元，按初始面值发售，每份

基金份额认购价格为人民币 1.00 元。

本基金不收取认购费用。

6、认购期利息的处理方式

本基金的有效认购款项在基金募集期间产生的利息在基金合同生效后折算为基金份额，归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

7、认购份额的计算

本基金认购采用金额认购的方式。认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

认购份额的计算公式为：

认购份额 = (认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额发售面值

例 1：某投资人投资 100,000 元认购本基金 A 类基金份额，认购资金在认购期产生利息 50 元，则其可得到的认购份额为：

认购份额 = (100,000 + 50) / 1.00 = 100,050.00 份

即 投资人投资 100,000 元认购本基金的 A 类基金份额，在认购期结束时，加上认购资金在认购期内获得的利息，投资人账户登记有本基金 A 类基金份额 100,050.00 份。

8、基金的认购

(1) 认购场所

本基金可通过本公司的直销中心和中国银行等代销机构认购本基金。详细认购场所见基金份额发售公告。

(2) 时间安排

在发售期内，本基金的直销与代销机构在工作时间中持续办理本基金的认购手续。具体时间见基金份额发售公告和相关销售机构公告。

(3) 基本认购程序

1) 投资者认购本基金需首先办理开户手续，已经开立基金账户的客户无需重新开户。

2) 投资者依照销售机构的规定，在募集期的交易时间段内提出认购申请，并办理有关手续。

3) 本基金认购采取金额申报方式, 投资者认购本基金, 须按销售机构规定全额缴纳认购款项。

4) 在设立募集期内, 投资者可多次认购基金份额。认购申请一经受理不得撤销。

5) 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功, 而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况, 投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

(4) 认购限额

1) 在募集期内, 投资人通过本基金的直销与代销机构首次认购 A 类基金份额的单笔最低金额均为人民币 1 元, 追加认购的单笔最低金额均为人民币 1 元; 首次认购 B 类基金份额的最低单笔金额为人民币 5,000,000 元, 追加认购的单笔最低金额为人民币 500 元。

2) 本基金对单个基金账户持有基金份额没有最高比例或数量的限制。

9、基金募集期间的资金存入专门账户, 在基金募集行为结束前, 任何人不得动用。

第八节 基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第九节 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。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

（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。

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，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2、申购与赎回的开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3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3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，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

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或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，视为下一开放日的申购、赎回或转换申请。

（三）申购与赎回的原则

1、“确定价”原则，即申购、赎回价格以每份基金份额净值为 1.00 元的基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、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；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、基金份额持有人在全部赎回其持有的本基金余额时，基金管理人自动将该基金份额持有人的未付收益一并结算并与赎回款一起支付给该基金份额持有人；基金份额持有人部分赎回其持有的基金份额时，未付收益为正时，未付收益不进行支付；未付收益为负时，其剩余的基金份额需足以弥补其当前未付收益为负时的损益，否则将自动按比例结转当前未付收益，再进行赎回款项结算；

6、基金管理人有权决定基金份额持有人持有本基金的最高限额和本基金的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（四）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回

款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日(含T+1日)内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项本金退还给投资人。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，对上述业务办理时间进行调整，本基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

如果登记机构在T日对投资者持有的基金份额进行了升降级处理，那么投资者在该日对升降级前的基金份额提交的赎回、基金转换转出、转托管等交易申请将确认失败，基金管理人不承担由此造成的损失；从T+1日起，投资者可以正常提交上述交易申请。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购和赎回的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。

(五) 申购与赎回的限制

1、申购与赎回的数额限制

(1) 投资人通过本基金的直销与代销机构首次申购A类基金份额的单笔最低金额均为人民币1元，追加申购的单笔最低金额均为人民币1元；首次申购B类基金份额的最低单笔金额为人民币5,000,000元，追加申购的单笔最低金额为人民币500元。

(2) 基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。

(3) 投资者在基金账户保留的B类基金份额最低余额为500万份(含500

万份),若最低余额小于 500 万份,则本基金的登记机构自动将其基金账户的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

(4) 基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

2、单个基金账户持有本基金份额的限制

本基金对单个基金账户持有基金份额没有最高比例或数量的限制,但法律法规、中国证监会另有规定的除外。

根据市场情况,基金管理人可以调整单个基金账户持有本基金份额的限制,基金管理人进行前述调整必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(六) 基金的申购费与赎回费及其用途

1、申购费用

本基金不收取申购费用。

2、赎回费用

本基金不收取赎回费用。

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费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更,基金管理人应在调整实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(七) 申购份额和赎回金额的计算方式

本基金的申购、赎回价格为每份基金 1.00 元。投资人申购所得的份额等于申购金额除以 1.00 元,赎回所得的金额等于赎回份额乘以 1.00 元。

1、本基金申购份额的计算:

本基金申购份额的计算公式如下:

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / 1.00$$

申购份额的计算结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位,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。

例 2:假定投资者在 T 日投资 20,000 元申购 A 类基金份额,其可得 A 类基金份额的申购份额计算如下:

申购份额=20,000/1.00 = 20,000.00 份

即：投资人投资 20,000 元申购本基金 A 类基金份额，其可得 20,000.00 份 A 类基金份额。

2、本基金赎回金额的计算：

采用“份额赎回”方式，赎回价格为每份基金份额净值 1.00 元。赎回金额的确定分两种情况处理：

(1) 部分赎回

1) 投资者部分赎回基金份额时，如其未付收益为正或该笔赎回完成后剩余的基金份额按照 1.00 元人民币为基准计算的价值足以弥补其累计至该日的未付收益负值时，赎回金额如下计算：

赎回金额=赎回份额×1.00

赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.00 元计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例 3：某投资者持有本基金 A 类基金份额 5 万份，累计收益为 200 元，T 日该投资者赎回 3 万份，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=30,000×1.00=30,000.00 元

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 3 万份时，其可得到的赎回金额为 3 万元，投资者账户内 A 类基金份额余额为 2 万份，剩余累计收益为 200 元。

例 4：某投资者持有本基金 A 类基金份额 5 万份，累计收益为 - 200 元，T 日该投资者赎回 3 万份。此时，投资者部分赎回其持有的 A 类基金份额，赎回后剩余 2 万份，足以弥补其累计至 T 日的累计收益 - 200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=30,000×1.00=30,000.00 元

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 3 万份时，其可得到的赎回金额为 3 万元，投资者账户内 A 类基金份额余额为 2 万份，剩余累计收益为 - 200 元。

2) 投资者部分赎回基金份额时，如其该笔赎回完成后剩余的基金份额按照每份 1.00 元为基准计算的价值不足以弥补其账户中累计至该日的未付收益负值时，则将自动按部分赎回份额占投资者账户总份额的比例结转当前未付

收益，赎回金额按如下公式计算：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times 1.00 + \text{赎回份额按比例结转的累计未付收益}$$

其中，赎回份额对应的累计收益 = (申请赎回的基金份额 / 账户基金总份额) × 账户当前累计收益

赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.00 元计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例 5：投资者持有本基金 A 类基金份额 5 万份，累计收益为 - 1,000 元，T 日该投资者赎回 49,200 份。此时，该投资者部分赎回其持有的 A 类基金份额，赎回后剩余 800 份，按照 1.00 元人民币为基准计算的价值不足以弥补其累计至该日的累计收益 - 1,000 元，则：

$$\text{赎回份额对应的累计收益} = - 1,000 \times (49,200 / 50,000) = - 984.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 49,200 \times 1.00 - 984.00 = 48,216.00 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 49,200 份时，其可得到的赎回金额为 48,216.00 元，投资者账户内 A 类基金份额余额为 800 份，剩余累计收益为 - 16 元。

(2) 全部赎回

投资者全部赎回本基金份额余额时，基金管理人自动将投资者账户中的累计未付收益一并结算并与赎回款一起支付给投资者，赎回金额按如下公式计算：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times 1.00 + \text{该份额对应的累计未付收益}$$

赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.00 元计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例 6：投资者持有本基金 A 类基金份额 5 万份，累计收益为 200 元，T 日该投资者全部赎回其持有的 A 类基金份额，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 50,000 \times 1.00 + 200 = 50,200.00 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 5 万份时，其可得到的赎回金额为 50,200.00 元。

（八）申购和赎回的登记

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，基金登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理登记手续，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，基金登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上公告。

（九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、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。

5、基金资产规模过大，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利益的情形。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十一）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未

能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回:连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒体上刊登公告。

(十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

3、如果发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周(含 2 周),基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并于重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

4、如果发生暂停的时间超过 2 周,基金管理人应在暂停期间每 2 周至少重复刊登暂停公告一次。当连续暂停时间超过 2 个月的,基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

（十三）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,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基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

（十四）转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管,基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

（十五）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十六）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠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;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、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

（十七）基金的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的,被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付,被冻结部分产生的权益一并冻结。法律法规另有规定的除外。

如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。

第十节 基金的投资

（一）投资目标

以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。

（二）投资范围

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金；通知存款；短期融资券；一年以内（含一年）的银行定期存款、银行协议存款和大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券和中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购和中央银行票据；以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他货币市场工具。

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）投资策略

本基金在投资组合管理中采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。

1、短期市场利率预期策略

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

2、期限结构的滚动配置策略

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

3、投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下,在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益最大化,约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约束等。

4、无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同,市场中常常存在无风险套利机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高,无风险套利的机会与收益会不断减少,但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会,基金管理人将贯彻谨慎的原则,充分把握市场无风险套利机会,为投资人带来更大收益。同时,随着市场的发展、新的货币投资工具的推出,会产生新的无风险套利机会,本基金将加强对市场前沿的研究,及时发现市场中新的无风险套利机会,扩大基金投资收益。

5、各类资产配置策略

(1) 类属资产配置策略

通过比较各类短期固定收益工具如央行票据、债券、短期融资券、银行存款、债券回购等投资品种在流动性、收益率水平和风险参数等指标的差异,确定这些投资品种的合理配置比例,以保证投资组合在低风险的前提下尽可能提高组合收益率。

(2) 银行存款投资策略

本基金在向交易对手银行进行询价的基础上,重点分析各存款银行的信用等级和存款利率,综合考量整体利率市场环境及其变动趋势,同时注重分散投资,降低交易对手风险,在严控风险的前提下选取利率报价较高的几家银行进行存款投资。

(3) 债券或债券回购投资策略

本基金投资组合将根据市场形势灵活把握投资品种的主动选择,具有下列一项或多项特征的投资品种是本基金重点投资的对象:

- 1) 在相似到期期限和信用等级下,收益率较高的债券或债券回购;
- 2) 相似条件下,流动性较高的债券;

3) 相似条件下, 交易对手信用等级较高的债券或债券回购。

(四) 投资决策依据

1、决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的规定;
- (2) 国家宏观经济环境及其对债券市场的影响;
- (3) 国家货币政策、财政政策以及证券市场政策;
- (4) 债券发行人财务状况、行业处境、经济和市场的需求状况;
- (5) 货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。

2、决策程序

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制, 建立了严谨、科学的投资管理流程, 具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全过程。

(1) 投资研究及投资策略制定

本基金管理人实行投资策略研究专业化分工制度, 由基金经理与研究员组成专业小组, 进行宏观经济及政策、产业结构、金融市场、单个证券等领域的深入研究, 并分别从利率、债券信用风险、相对价值等角度, 提出独立的投资策略建议。经固定收益投资团队讨论, 并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。

(2) 投资决策

基金经理在基金管理人固定收益证券总体投资策略的指导下, 根据基金合同关于投资目标、投资范围及投资限制等规定, 制定相应的投资计划, 报投资决策委员会审批。

投资决策委员会是基金投资的最高决策机构, 决定基金总体投资策略及资产配置方案, 审核基金经理提交的投资计划, 提供指导性意见, 并审核其他涉及基金投资管理的重大问题。

(3) 投资组合构建

基金经理根据投资决策委员会的决议, 在权限范围内, 评估债券的投资价值, 选择证券构建基金投资组合, 并根据市场变化调整基金投资组合, 进行投资组合的日常管理。

(4) 交易执行

交易员负责在合法合规的前提下，执行基金经理的投资指令。

(5) 风险管理及绩效评估

风险分析专业人员对投资组合的风险水平及基金的投资绩效进行评估，报风险管理委员会，抄送投资决策委员会、投资总监及基金经理，并就基金的投资组合提出风险管理建议。

监察稽核部对基金的投资行为进行合规性监控，并对投资过程中存在的风险隐患向基金经理、投资决策委员会及风险管理委员会进行风险提示。

(五) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金的业绩比较基准以中国人民银行公布的金融机构人民币存款基准利率为准。

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推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

(六) 风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

(七) 投资限制

1、组合限制

本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票、权证及股指期货；
- (2) 可转换债券；
- (3) 剩余期限超过 397 天的债券；
- (4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；
- (5) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化

后另有规定的，从其规定；

- (6) 非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；
- (7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制的，本基金将不受上述限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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。

3、基金投资组合比例限制

(1) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(2) 除发生巨额赎回的情形外，货币市场基金的投资组合中，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整；

(3) 本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；

(4) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；

(5) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天；

(6) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮

动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；

(7) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；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%；本基金持有的同一（指同一信用级）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金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%；本基金应投资于信用级别评级为或相当于 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(9) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

3) 本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

(10) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

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，本基金可相应调整或取消禁止行为和投资限制规定，不需要经基金份额持有人大会审议。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例

符合基金合同的约定。除上述（2）、（8）和（9）外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

（八）投资组合平均剩余期限计算方法

1、平均剩余期限（天）的计算公式如下：

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

其中：

投资于金融工具产生的资产包括现金类资产（含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金）、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、期限在一年以内(含一年)的逆回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。

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

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

2、各类资产和负债剩余期限的确定

（1）银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为 0 天；证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；

（2）一年以内(含一年)银行定期存款、大额存单的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限以存款协议中约定的通知期计算；

（3）组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算；允许投资的含回售条款债券的剩余期限以计算日至

回售日的实际剩余天数计算；

(4) 回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。

(5) 中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；

(6) 买断式回购产生的待回购债券的剩余期限为该基础债券的剩余期限；

(7) 买断式回购产生的待返售债券的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

(8) 短期融资券的剩余期限以计算日至短期融资券到期日所剩余的天数计算。

(9) 对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限。

平均剩余期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限计算方法另有规定的从其规定。

(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) 基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

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

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

第十一节 基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金的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

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金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

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人和基金销售机构不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

第十二节 基金资产的估值

（一）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交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的各类证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值方法

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

2. 为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，同时基金管理人应编制并披露临时报告。

3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

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

(四) 估值程序

1、每万份基金已实现收益是按照相关法规计算的每万份基金份额的日已实现收益,精确到小数点后第4位,小数点后第5位四舍五入。本基金的收益分配是按日结转份额的,七日年化收益率是以最近7日(含节假日)每万份基金已实现收益所折算的年资产收益率,精确到0.001%,百分号内小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

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

(五) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利益,已决定延迟估值;

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(六) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值、各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值、各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率并发送给基金托管人。基金托管人复

核确认后发送给基金管理人，由基金管理人予以公布。

（七）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金资产的估值导致任一类基金份额的每万份基金已实现收益小数点后4位或七日年化收益率百分号内小数点后3位以内发生差错时，视为估值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此

部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

4、基金资产净值计算错误导致估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

(八) 特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 3 项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

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

第十三节 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、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易或结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。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 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。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 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额，年销售服务费率应自其降级后的下一日起按照 A 类基金份额的费率计提。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额，年销售服务费率应自其升级后的下一日起按照 B 类基金份额的费率计提。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。

4、本条第（一）款第 4 至第 9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金管理费、基金托管费、销售服务费的调整

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

(五) 基金税收

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。

第十四节 基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

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

（二）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
2. 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
3. “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；
4. 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
5. 本基金每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；
6. 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；
7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（三）收益分配方案

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。本基金按日计算并分配收益，基金管理人另行公告基金收益分配方案。

（四）收益分配的时间和程序

本基金每个工作日进行收益分配。每个开放日公告前一个开放日各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，披露节假日期间的各类基金份额每万份基金已实现收益和节假日最后一日的七日年化收益率，以及节假日后首个开放日的各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金每月 1 日例行对上月实现的收益进行收益结转(如遇节假日顺延)，具体做法是将基金投资者账户的当前累计收益结转为该基金投资者账户的本基金份额。每月例行的收益结转不再另行公告。

（五）本基金各类基金份额每万份基金已实现收益及七日年化收益率的计算见基金合同第十八部分。

第十五节 基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

第十六节 基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时, 本基金从其最新规定。

(二) 信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息, 并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内, 将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露, 并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息, 不得有下列行为:

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

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字; 除特别说明外, 货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（A）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒体上；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网站上。

（B）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媒体上。

（C）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

（D）基金资产净值、各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值、各类基金份额每万份基金已实现

收益和七日年化收益率；

每万份基金已实现收益和七日年化收益率的计算方法如下：

日每万份基金已实现收益 = 当日该类基金份额的已实现收益 / 当日该类基金份额总额 × 10000

七日年化收益率的计算方法：

七日年化收益率以最近七个自然日的每万份基金已实现收益按每日复利折算出的年收益率。计算公式为：

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

其中， R_i 为最近第 i 个自然日(包括计算当日)的每万份基金已实现收益。

每万份基金已实现收益采用四舍五入保留至小数点后第 4 位，七日年化收益率采用四舍五入保留至百分号内小数点后第 3 位。

2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值、各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率登载在指定媒体上。

(E) 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年结束之日起 90 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媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 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媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 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媒体上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、

半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

(F) 临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在2个工作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的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;
- 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百分之五十;
- 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百分之三十;
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁;
- 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、基金管理费、基金托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和

费率发生变更；

17、以“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离度绝对值达到或超过 0.5%；

18、基金改聘会计师事务所；

19、变更基金销售机构；

20、更换基金登记机构；

21、本基金开始办理申购、赎回；

22、本基金收费方式发生变更；

23、本基金发生巨额赎回并延期支付；

24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26、变更基金份额类别的设置；

27、本基金推出新业务或服务；

28、中国证监会规定的其他事项。

(G) 澄清公告

在《基金合同》存续期限内，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。

(H) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

(I) 中国证监会规定的其他信息。

(六) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的

约定,对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额每万份基金已实现收益和七日年化收益率、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒体披露信息,但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息,并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

(七) 信息披露文件的存放与查阅

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

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,以供公众查阅、复制。

(八) 当出现下述情况时,基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息:

- (1) 不可抗力;
- (2) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- (3) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的情况。

第十七节 风险揭示

(一) 投资于本基金的主要风险

1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

(1) 政策风险。货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

(2) 经济周期风险。资本市场是国民经济的重要组成部分，在宏观经济运行中发挥着重要的功能。证券市场是国民经济的晴雨表，而经济增长具有周期性特征。对经济增长和经济周期的预期变化，以及宏观经济运行的实际状况将对证券市场的资产价值产生重要影响，从而对基金投资形成风险。

(3) 利率风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。在利率上升时，基金持有的债券价格下降，如基金组合久期较长，则将造成基金资产的损失。

(4) 购买力风险。本基金的投资目的是为投资者获得超过业绩比较基准的收益，若发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀所抵消，从而使基金的实际收益下降。

(5) 再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险(即利率风险)互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率，这将对基金的净值增长率产生影响。

(6) 债券回购风险。债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操

作时,回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大,致使整个组合风险放大的风险;而波动性加大的风险是指在进行回购操作时,在对基金组合收益进行放大的同时,也对基金组合的波动性(标准差)进行了放大,即基金组合的风险将会加大。回购比例越高,风险暴露程度也就越高,对基金净值造成损失的可能性也就越大。

2、信用风险

信用风险主要指债券发行人因经营情况恶化等因素发生违约,或债券发行人拒绝履行还本付息义务,或由于债券发行人或债券本身信用等级降低导致债券价格波动等风险。信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

3、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足,导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括基金出现巨额赎回,致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

4、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等,会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断,从而影响基金收益水平。因此,本基金可能因为基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

5、操作风险

基金运作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

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

6、合规性风险

基金管理或运作过程中,因违反国家法律、法规、监管部门的规定以及

基金合同有关规定而给基金财产带来损失的风险。

7、本基金特有的风险

本基金投资于货币市场工具，可能面临较高流动性风险以及货币市场利率波动的系统性风险。一方面，货币市场的利率波动会影响基金的再投资收益，并影响到基金资产公允价值和交易价格的变动。另一个方面，为应对赎回而卖出证券时，尤其是出现巨额赎回时，可能存在由于货币市场工具交易量不足而产生的流动性风险。

8、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

(二) 声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

第十八节 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本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续后生效，自决议生效之日起在指定媒体公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7) 对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第十九节 基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

(一) 基金管理人

1、基金管理人简况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D

法定代表人：凤良志

设立日期：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【1999】6 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币壹亿伍仟万元整

存续期限：持续经营

联系电话：(010) 82019988

2、基金管理人的权利

根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集基金；

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

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

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

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

- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通业务；
- (13) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (15) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
- (16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

3、基金管理人的义务

根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额

持有人利益向基金托管人追偿；

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人

1、基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

2、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

(4) 根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时,提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

3、基金托管人的义务

根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的每万

份基金已实现收益和七日年化收益率；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

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

人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

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

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1) 终止《基金合同》,法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外;

(2) 更换基金管理人;

(3) 更换基金托管人;

(4) 转换基金运作方式;

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,提高销售服务费率,但法律法规要求提高该等报酬和费率标准的除外;

(6) 变更基金类别;

(7) 本基金与其他基金的合并,法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外;

(8) 变更基金投资目标、范围或策略,法律法规和中国证监会另有规定的除外;

(9) 变更基金份额持有人大会程序;

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

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

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份

额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和销售服务费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和本基金合同规定的范围内，在不影响现有持有人利益的前提下，调低基金的销售服务费率或变更收费方式、调整基金份额类别的设置；
- (4) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在不影响现有持有人利益的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；
- (5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (7) 按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提

议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督

的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 $1/2$ （含 $1/2$ ）。

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 $1/3$ 以上（含 $1/3$ ）基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 1/2 (含 1/2)；

参加基金份额持有人大会的基金份额持有人的基金份额低于上述规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，应当有代表 1/3 以上 (含 1/3) 基金份额的基金份额持有人或其代理人参加，方可召开。

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

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

3、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。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和

公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 5 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的

基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定,凡是直接引用法律法规或监管规则的部分,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自完成备案手续后生效,自决议生效之日起在指定媒体公告。

(二)《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,在履行相关程序后,《基金合同》应当终止:

- 1、基金份额持有人大会决定终止的;
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止,在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
- 3、《基金合同》约定的其他情形;
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

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

进行基金清算。

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

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

4、基金财产清算程序：

(1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3)对基金财产进行估值和变现；

(4)制作清算报告；

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告。

(7)对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

(四)清算费用

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

(五)基金财产清算剩余资产的分配

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

(六)基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七)基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁，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，仲裁费用和律师费由败诉方承担。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。

《基金合同》受中国法律管辖。

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或办公地址，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

第二十章 基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

成立时间：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[1999]6 号

组织形式：有限责任公司 (中外合资)

注册资本：人民币壹亿伍仟万元

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同

业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 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。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金；通知存款；短期融资券；一年以内（含一年）的银行定期存款、银行协议存款和大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券和中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购和中央银行票据；以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他货币市场金融工具。

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。

基金管理人应将拟投资的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：

(1) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(2) 除发生巨额赎回的情形外，货币市场基金的投资组合中，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%；因发生巨额赎回致使货币市场基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整；

(3) 本基金的存款银行应当是具有证券投资基金托管人资格、证券投资基金代销业务资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行；

(4) 本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；

(5) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天；

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

(7) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；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%；本基金持有的同一（指同一信用级）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金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%；本基金应投资于信用级别评级为或相当于 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(9) 本基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准：

1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近 3 年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A- 级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+ 级）。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

3) 本基金持有短期融资券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标

准，应在评级报告发布之日起 20 个交易日内予以全部减持。

(10) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

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，本基金可相应调整或取消禁止行为和投资限制规定，不需要经基金份额持有人大会审议。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的约定。除上述(2)、(8)和(9)外，因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合《基金合同》约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自《基金合同》生效之日起开始。

(二) 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、各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率计算、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复核。

(三) 基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(四) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

(五) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或

举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率、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。

四、基金财产的保管

(一) 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,与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理,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。

(二)《基金合同》生效前募集资金的验资和入账

1、基金募集期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。

(三)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。

(四)基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以本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，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。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。

(五)基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

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。

5、因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和《基金合同》的规定,在基金管理人和基金托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

6、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

(六) 债券托管专户的开设和管理

《基金合同》生效后,基金管理人负责以本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;基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限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。

(七) 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责任。

(八) 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。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供合同复印件，并在复印件上加盖公章，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。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。

五、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负债后的价值。

2、基金管理人应每个开放日对基金财产估值。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各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率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开放日结束后计算得出当日的各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率，并以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述数据后对净值计算结果进行复核，并将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人依照《信息披露办法》以及《基金合同》的相关规定对外公布。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每万份基金已实现收益小数点后 4 位或七日年化收益率百分号内小数点后 3 位以内发生差错时，视为估值错误。当基金资产净值计算错误导致估值错误时，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；错误偏差达到基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金资产净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。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》另有约定外，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了赔偿责任,则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人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、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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,基金管理人可以按照其对各类基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率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。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

(一) 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。

(二) 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。

（三）基金份额持有人名册的保管

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

七、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）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，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费、律师费用由败诉方承担。

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

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、托管协议的变更与终止

（一）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或备案。

（二）托管协议的终止

发生以下情况，经履行适当程序后，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。

第二十一节 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）基金份额持有人登记服务

基金管理人委托或作为登记机构为基金份额持有人提供登记服务。基金登记机构配备安全、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

本基金收益分配方式为红利再投资。登记机构将投资者所得红利自动转为基金份额。

（三）定期投资计划

在条件成熟时，基金管理人可通过代销机构和网上直销为基金份额持有人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金份额持有人可以通过固定的渠道，定期申购基金份额，该定期申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。

（四）网上交易服务

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

（五）主动通知服务

基金管理人通过邮寄、电子邮件、短信、主动致电等方式为基金份额持有人提供各项主动通知服务，包括邮寄季度交易对账单、发送月度电子对账单、交易确认的电子邮件和短信通知、对账单寄送失败的电子邮件或短信通知、公司公告及重要信息的电子邮件或短信主动通知等服务。

（六）查询服务

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

具体查询内容:

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

短信查询:基金净值情况、账户情况;

或可直接致电客户服务热线转人工查询。

(七) 资料索取服务

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

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

同时,公司网站上提供各种资料、业务表单及公告下载。

(八) 资讯服务定制

为进一步提升服务品质,满足客户个性化需要,基金管理人推出全方位资讯服务定制计划。基金份额持有人可通过客服热线、公司网站、短信定制各种资讯,公司通过 EMAIL、短信等多渠道发送资讯定制服务。

基金管理人会按照基金份额持有人要求定期提供日报、月度电子对账单、电子成交确认单、短信成交通知、持有基金每周净值短信、临时公告短信等。

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

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

(九) 投资业务咨询

基金管理人拥有一支训练有素、专业知识全面的投资顾问队伍,为更好地

与基金份额持有人进行沟通,公司的专业客户服务代表在工作时间内为客户解答疑问,提供关于基金投资全方位的咨询服务。同时,还提供在线交流及手机短信交流。

(十) 投诉建议受理

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

(十一) 互动活动

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

(十二) 长盛客户服务中心联系方式

长盛基金管理有限公司客户服务热线： (010) 62350088
400-888-2666

长盛基金管理有限公司网址： www.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

第二十二节 招募说明书的存放和查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（<http://www.csfunds.com.cn>）查阅和下载招募说明书。

第二十三节 备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会批准长盛添利宝货币市场基金募集的文件；
- 2、《长盛添利宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《长盛添利宝货币市场基金托管协议》；
- 4、关于募集长盛添利宝货币市场基金的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会规定的其它文件。

（二）备查文件存放地点与投资者查阅方式

本节第（一）部分中的第6项备查文件存放在基金托管人的办公场所，其他文件存放在基金管理人的办公场所。

本基金管理人长盛基金管理有限公司办公场所位于北京海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层。基金投资者在营业时间内可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。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 一三年十一月十五日