

长盛基金管理有限公司

长盛全债指数增强型  
债券投资基金基金合同

基金发起人：长盛基金管理有限公司

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二三年十月

---

## 目 录

一、前言 .....	1
二、释义 .....	3
三、基金合同当事人 .....	6
四、基金合同当事人的权利义务 .....	8
五、基金份额持有人大会 .....	13
六、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 .....	20
七、基金的基本情况 .....	22
八、基金的募集 .....	24
九、基金的成立 .....	26
十、基金的日常申购和赎回 .....	27
十一、基金的托管 .....	33
十二、基金的销售与服务代理 .....	34
十三、基金的登记注册 .....	35
十四、基金的投资管理 .....	37
十五、基金的资产 .....	46
十六、基金资产估值 .....	47
十七、基金的费用与税收 .....	54
十八、基金的收益与分配 .....	57
十九、基金的会计与审计 .....	59
二十、基金的信息披露 .....	60
二十一、基金的终止与清算 .....	66
二十二、违约责任 .....	68
二十三、争议的处理 .....	69
二十四、通知与送达 .....	70
二十五、《基金合同》的效力 .....	72
二十六、《基金合同》的修改和终止 .....	73
二十七、其他事项 .....	74
二十八、基金合同内容摘要 .....	75

---

## 一、前言

（一）订立《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》的目的、依据和原则

1、订立《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“本基金合同”）的目的是保护基金投资人合法权益、明确本基金合同当事人的权利与义务、规范长盛全债指数增强型债券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）的运作。

2、订立本基金合同的依据是 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布的《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）、2000 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）发布的《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称《试点办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

（二）本基金由基金发起人/基金管理人依照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定发起设立。

中国证监会对本基金设立的批准，并不表明其对基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

（三）本基金合同的当事人按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定享有权利，同时须承担相应义务。

（四）本基金投资人自取得依本基金合同所发行的基金单位，即成为基金份额持有人和本基金的当事人，其持有基金单位的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定享受权利、承担义务。

（五）本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书。

---

（六）当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，且不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

---

## 二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

本合同、《基金合同》：指《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》

《暂行办法》：指 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布并施行的《证券投资基金管理暂行办法》

《试点办法》：指 2000 年 10 月 8 日由中国证监会发布并施行的《开放式证券投资基金试点办法》

《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集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

元：指人民币元

《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

基金或本基金：指依据本《基金合同》所设立的长盛全债指数增强型债券投资基金

招募说明书：指《长盛全债指数增强型债券投资基金招募说明书》及其更新

基金产品资料概要：指《长盛全债指数增强型债券投资基金基金产品资料概要》及其更新

中国证监会：指中国证券监督管理委员会

基金管理人：指长盛基金管理有限公司

基金发起人：指长盛基金管理有限公司

基金托管人：指中国农业银行

---

基金销售代理人：指依据有关代理销售协议办理本基金申购、赎回和其他基金业务的代理机构

基金登记注册人：指中国证券登记结算有限责任公司

基金合同当事人：指受基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体

个人投资人：指具有中国国籍的，有完全民事行为能力的自然人

机构投资者：指经有关政府部门批准设立并在中国境内合法注册的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

基金成立日：指自招募说明书公告之日起三个月内，在基金净销售额超过人民币 2 亿元，且认购户数达到或超过 100 户的条件下，基金发起人可以依据《试点办法》和实际发行情况停止发行，并宣告基金成立的日期

募集期：指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段，最长不超过 3 个月

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

T 日：指日常申购、赎回或其他交易的申请日

日常申购：指基金投资人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人提出购买基金单位的请求。基金的日常申购从基金成立后不超过 30 个工作日开始办理

日常赎回：指基金投资人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人提出卖出基金单位的请求。基金的日常赎回从基金成立后不超过 30 个工作日开始办理

基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益

基金份额分类：指根据申购费用、销售服务费收取方式的不同将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别代码不同，基金份额净值和基金份额累计净值或有不同。在投资者申购时收取前端申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，包括 A 类基金份额和 D 类基金份额；在投资者申购时不收取前端申购费用，在赎回时收取后端申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 B 类基金份额；不收取前/后端申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金

---

份额

销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用

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

基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值

基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金单位净值的过程

基金销售网点：指基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点

指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒体

流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

---

### 三、基金合同当事人

#### （一）基金发起人：

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：胡甲

设立日期：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】6 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币贰亿零陆佰万元整

存续期间：持续经营

#### （二）基金管理人

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：胡甲

设立日期：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会批准

设立文号：中国证监会证监基字【1999】6 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币贰亿零陆佰万元整

存续期间：持续经营

#### （三）基金托管人

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

---

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

#### （四）基金份额持有人

基金投资人自取得依本基金合同所发行的基金单位，即成为基金份额持有人，其持有基金单位的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人成为本基金合同的当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。

---

## 四、基金合同当事人的权利义务

### （一）基金发起人的权利与义务

#### 1、基金发起人的权利

- （1）申请设立基金；
- （2）法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### 2、基金发起人的义务

- （1）遵守基金合同；
- （2）公告招募说明书和发行公告；
- （3）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- （4）基金不能成立时在法定的时间内退还所募集资金本息并承担发行费用；
- （5）法律法规及基金合同规定的其他义务。

### （二）基金管理人的权利与义务

#### 1、基金管理人的权利

- （1）自本基金成立之日起，依据本基金合同及有关法律规定运用本基金资产；
- （2）依照《暂行办法》、《试点办法》及其他有关规定，代表基金对被投资的上市公司行使股东权利；
- （3）依据本基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，必要时应采取保护措施保护基金投资人的利益；
- （4）选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；
- （5）直接销售基金单位，获取认购（申购）费用；
- （6）依据本基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
- （7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理基金单位的申购和赎回；
- （8）依据基金合同的规定获得基金管理费收入；
- （9）法律法规及基金合同规定的其他权利。

---

## 2、基金管理人的义务

(1) 自基金成立之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产;

(2) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金资产;

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

(4) 配备足够的专业人员进行基金的登记注册或委托其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,保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立,保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立;

(6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外,不为自己及任何第三人谋取利益,不委托第三人运作基金资产;

(7) 接受基金托管人的监督;

(8) 按规定计算并公告基金资产净值及基金单位资产净值;

(9) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(10) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》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;

(11) 依据《基金合同》规定向基金份额持有人分配收益;

(12) 按照法律法规和本《基金合同》的规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回及分红款项;

(13) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

(14) 依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会;

(15) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上;

---

(16) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金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，并得到有关资料的复印件；

(17) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

(19) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，采取适当合理的方式向基金投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

(20) 因估值错误导致投资人的损失，属管理人责任的，应承担赔偿责任，并采取适当、合理的方式向投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

(22) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

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

#### 2、基金托管人的义务

- (1) 依法持有基金资产；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并保管基金资产；
- (3) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保

---

证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(5) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(7) 以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来；

(8) 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》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；

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值；

(10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；

(11) 采取适当、合理的措施，使开放式基金单位的认购、申购和赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

(12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金单位认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定；

(14) 在定期报告内出具基金托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；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；

(15) 建立并保存基金份额持有人名册；

(16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

(17) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

---

(19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；

(21) 因过错导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(22) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金管理人追偿；

(23) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

(四) 基金份额持有人

#### 1、基金份额持有人的权利

(1) 取得基金收益；

(2) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；

(3) 监督基金运作状况，获取基金业务及财务状况的资料；

(4) 申购、赎回及其他对基金单位处分的权利，并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金单位；

(5) 因基金管理人、托管人、销售机构、登记注册机构的错误导致基金份额持有人利益受损害的情况下，要求赔偿的权利；

(6) 参与基金清算后的剩余资产的分配；

(7) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

同一类别每份基金单位具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的义务

(1) 遵守《基金合同》；

(2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；

(3) 以其持有的基金份额为限承担基金亏损或者终止的责任；

(4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；

(5) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

---

## 五、基金份额持有人大会

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。同一类别基金份额持有人持有的每一份基金份额拥有平等的投票权。

### （二）召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有10%以上（不含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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）提前终止基金合同；
- （2）基金扩募或延长基金合同期限；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）或提高销售服务费；
- （5）基金管理人、基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）对基金当事人权利和义务产生重大影响的基金合同修改，但基金合同及法律、法规另有规定的除外；
- （8）《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，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、销售服务费；
- （2）因相应的法律、法规（包括证券监督管理部门的要求，下同）发生变动必须对基金合同进行修改、变更；
- （3）对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （4）对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （5）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

### （三）会议召集方式

---

1、除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

3、代表基金份额 10%以上（不含 10%）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 10%（不含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；

4、代表基金份额 10%以上（不含 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，代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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。

#### (四)通知

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开时间、地点、方式；
- (2) 会议审议事项、议事程序、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) 代理投票委托书送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名、电话；

(6) 其他注意事项。

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

### (五)会议的召开方式

#### 1、会议方式

(1) 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；

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，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；

(3) 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；

(4) 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事宜或转换基金运作方式必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

#### 2、基金份额持有人大会召开条件

##### (1) 现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 15 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

---

## (2) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计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占在权益登记日基金总份额的 50%以上（不含 50%）；

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其它代表，同时提交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。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 15 个工作日后),但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## (六) 议事内容与程序

### 1、 议事内容及提案权

(1) 议事内容仅限于本基金合同“五、基金份额持有人大会（二）召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

(2) 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；

(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：

1) 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进行解释和说明；

2) 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。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上（不含 50%）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 10 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## (七) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议

(1) 一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%（不含 50%）以上通过方为有效；除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

(2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、提前终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

---

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

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

#### (八) 计票

##### 1、现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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，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三名代表担任监票人；

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

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

##### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若基金托管人担任召集人，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。

#### (九) 生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

---

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定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告。

(十) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、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二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

---

## 六、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### （一）基金管理人和基金托管人的更换条件

#### 1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的,经中国证监会批准,可更换基金管理人:

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

#### 2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的,经中国证监会和中国人民银行批准,可更换基金托管人:

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

### （二）基金管理人和基金托管人的更换程序

#### 1、基金管理人的更换程序

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

---

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

## 2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名；

(2) 决议：基金份额持有人大会对被提名的基金托管人形成决议；

(3) 批准：新任基金托管人经中国证监会和中国人民银行审查批准方可继任，原任基金托管人经中国证监会和中国人民银行批准方可退任；

(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会和中国人民银行批准后 5 个工作日内公告。新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。如果基金托管人和基金管理人同时更换，由基金发起人在获得中国证监会批准后 5 个工作日内进行公告。

---

## 七、基金的基本情况

(一) 基金的名称：长盛全债指数增强型债券投资基金

(二) 基金的类型：合同型开放式

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

(四) 基金预期发行规模：本基金不设目标发行规模。

(五) 基金单位每份面值和认购费用

1、基金单位面值为 1.00 元。

2、认购费用及计算公式见第八章。

(六) 基金存续期限：不定期

(七) 基金份额类别

本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，包含 A 类基金份额和 D 类基金份额；在投资者申购时不收取前端申购费用，在赎回时收取后端申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 B 类基金份额；不收取前/后端申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类、B 类、C 类和 D 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A/B 类、C 类、D 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择申购的基金份额类别。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。在不违反法律法规、基金合同以及不对基金份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人可根据实际情况，经与基金托管人协商一致，调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整、调整基金份额类别的费率结构、变

---

更收费方式或者停止现有基金份额的销售等，此项调整无需召开基金份额持有人大会，但须报中国证监会备案并提前公告。

---

## 八、基金的募集

除法规另有规定外，任何与基金单位发行有关的当事人不得预留和提前发售基金单位。

### （一）基金单位的募集期限、募集方式、募集对象

1、募集期限：自招募说明书公告之日起不超过 3 个月。

2、募集方式：通过本公司的直销网点和销售代理机构的代销网点进行公开募集。

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

### （二）募集资金利息的处理方法

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

### （三）基金单位面值、认购费用及计算公式

1、基金单位面值为 1.00 元。

#### 2、认购费用

本基金认购费用最高不超过认购金额的 3%，认购费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书和发行公告中列示。认购费用用于本基金的市场推广、销售等设立募集期间发生的各项费用。

#### 3、认购份数的计算

认购份数的计算方法如下：

认购费用=认购金额×认购费率

净认购金额=(认购金额-认购费用)+认购利息

认购份数=净认购金额/基金单位面值

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

### （四）募集规模

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

### （五）基金单位的认购限额

- 
- 1、本基金代销网点和直销中心的单笔最低认购金额为 1,000 元。
  - 2、投资人在发行期内可多次认购本基金。
  - 3、认购申请一经提出，不得撤销。
  - 4、发行期间，销售机构为投资人办理认购手续仅代表对投资人认购申请的受理，投资人认购成功与否应以基金募集结束后登记注册人的认购确认为准。
- 其他事项由基金管理人在招募说明书或发行公告中进行规定。

---

## 九、基金的成立

### （一）基金的成立条件

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

### （二）基金不能成立时募集资金的处理方式

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

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金成立后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。

---

## 十、基金的日常申购和赎回

### （一）日常申购与赎回的场所

- 1、基金管理人的直销网点；
- 2、基金管理人委托的代销机构的营业网点；

本公司直销中心及代销机构信息由招募说明书具体规定。基金管理人有权增加符合条件的销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化增加其销售城市（网点），并另行公示。条件成熟时，投资者可通过基金管理人或者指定的基金销售代理人以电话、传真或互联网等形式进行申购与赎回。

### （二）申购与赎回的开放日期及时间

- 1、申购与赎回的开始时间

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

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

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

### （三）申购与赎回的原则

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

- 2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

---

5、申购费用按对应类别基金份额单笔申购申请金额对应的费率计算，计算公式参见招募说明书；

6、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，但基金管理人必须在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

7、本基金暂不采用摆动定价机制。

#### （四）日常申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 个工作日及之后到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询；T 日申购成功的基金份额 T+2 个工作日后可以赎回。

##### 3、申购和赎回款项支付

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

基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项在不超过 7 个工作日之内划往赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照第（八）项有关条款处理。

#### （五）日常申购与赎回的数额规定

本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书或公开说明书中规定。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、

---

拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

#### （六）申购和赎回的价格和费用

1、申购费率最高不超过 3%，赎回费率不超过 1.5%。本基金的赎回费用由赎回人承担，用于支付相关手续费后余额归入基金资产。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。基金管理人对部分基金投资人费用的减免不构成对其他投资人的同等义务。

2、本基金各类基金份额申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的各类基金单位净值为基准进行计算。

3、T 日的各类基金单位净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。

4、本基金各类基金份额的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （七）拒绝或暂停申购与赎回的情况

##### 1、拒绝或暂停申购的情形与处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资人的申购申请：

（1）基金资产规模过大，使基金管理人认为继续扩大基金规模会影响基金投资业绩，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（2）证券交易所在交易时间非正常停市，或因不可抗力导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 登记注册人的一方或多方技术系统出现故障导致无法正常进行工作；

（4）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的申购；

（5）因不可抗力事件造成基金的申购事实上无法办理；

（6）接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50% 以上时；

---

(7) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

(8) 经中国证监会同意的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人立即在指定媒体上刊登暂停公告。

## 2、拒绝或暂停赎回的情形及处理方式

除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资人的赎回申请：

(1) 证券交易场所交易时间非正常停市；

(2) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；

(3) 基金管理人、基金托管人、基金销售代理人和登记注册人的一方或多方技术系统出现故障导致无法正常进行工作；

(4) 因不可抗力事件导致基金无法正常运作或基金的赎回无法进行；

(5) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；

(6) 法律、法规、规章允许的其他情形或其他在《基金合同》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

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

(八) 巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的情形及处理方式

(1) 巨额赎回的认定

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

(2) 巨额赎回的处理方式

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

---

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的赎回申请时，将按正常赎回程序处理投资人赎回申请。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为没有能力全部兑付投资人的赎回申请或全部兑付投资人的赎回申请可能对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在不低于上一日基金总份额的 10%，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至第二开放日办理，并以第二开放日该类基金份额的基金单位资产净值为依据计算赎回金额，直至将申请赎回份额全部赎回为止。投资人在申请赎回时有权对当日未获受理部分份额选择延迟赎回或放弃延迟赎回。

3) 若本基金发生巨额赎回的，且存在单个基金份额持有人单日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 以上的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 以上的部分进行自动延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的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，并与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权且以下一开放日该类基金份额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；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作延期赎回处理。

4) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点在 3 个证券交易所交易日内刊登公告，并说明有关处理方法。

## 2、连续巨额赎回成立的条件及处理方式

### (1) 连续巨额赎回的认定

本基金连续三个开放日发生巨额赎回，为连续巨额赎回。

### (2) 连续巨额赎回的处理方式

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

---

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

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

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

#### （九）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

---

## 十一、基金的托管

基金托管人与基金管理人必须按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及有关规定订立《长盛全债指数增强型债券投资基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金资产的保管、基金资产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

---

## 十二、基金的销售与服务代理

本基金的认购、申购、赎回及相关的客户服务等业务由基金管理人和基金管理人委托其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金上述业务的，应与代理人按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定就本基金的销售和服务事项签订《长盛全债指数增强型债券投资基金销售和服务代理协议》。订立代理协议的目的是为了明确基金销售代理人和基金管理人之间在基金单位认购、申购、赎回以及相关的客户服务等事宜中的权利、义务和职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

---

## 十三、基金的登记注册

### （一）委托与更换程序

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

登记注册人的更换程序如下：

（1）提名：由基金管理人提名。

（2）审批：新任登记注册人报中国证监会审查资格并批准后，原任登记注册人方可退任；

（3）公告：基金登记注册人更换，由基金管理人在更换前 30 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（4）交接：原基金登记注册人应做出处理基金登记注册事务的报告，并与新任基金登记注册人完成业务移交手续，向新任基金登记注册人提交完整的书面材料和电子数据；新任基金登记注册人与基金管理人核对全部基金份额持有人账户资料，确保准确无误；在业务移交后，原基金登记注册人仍有义务保留本基金正式移交日之前的登记注册业务的全部资料和电子数据一年，并有义务在该期限内协助新任基金登记注册人处理有关问题，保障基金份额持有人的合法权益；如因原基金登记注册人业务移交产生的问题，原基金登记注册人仍有协助解决之义务。

（二）基金管理人目前委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金的登记注册业务。

### （三）基金登记注册人概况

基金登记注册人：证券登记结算有限责任公司

法定代表人：陈耀先

注册资本：6 亿元

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

组织形式：有限责任公司

---

营业期限：长期

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

公司实行董事会领导下的总经理负责制，设有 5 个部门和 2 个分公司，分别是综合管理部、登记托管部、结算部、技术部、业务发展部、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。中国证券监督管理委员会是公司主管部门，公司业务接受中国证券监督管理委员会的监管。

公司经营范围：

- 1、证券账户和结算账户的设立和管理；
- 2、证券登记与过户；
- 3、证券托管与转托管；
- 4、证券和资金的清算与交收；
- 5、受发行人委托办理证券权益分配等代理人服务；
- 6、中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

---

## 十四、基金的投资管理

### (一) 投资目标

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

### (二) 投资范围

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

### (三) 投资理念

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

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

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

2、标普中国全债指数能够直接、比较真实地刻画债券市场走势。

标普中国全债指数是一个全面反映整个债券市场的综合性权威债券指数。

3、基于债券市场现存的结构性问题，我们将采用指数化的增强性投资。现阶段的债券市场作为一个新兴市场，存在一些结构性问题，主要表现在利率期限结构难以体现风险补偿、相似期限债券品种存在较大的收益率差异和不同市场收益率水平的差异。债券市场现存的结构失衡，既对基金管理人提出了在

---

指数化投资的基础上进行低风险的积极性管理的要求，也为基金管理人提供了一定程度积极性管理的机会。

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

4、动态资产组合管理是确保投资目标实现的关键。

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

#### （四）标的指数

本基金标的指数为标普中国全债指数。

标的指数编制方法具体见招募说明书的规定。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

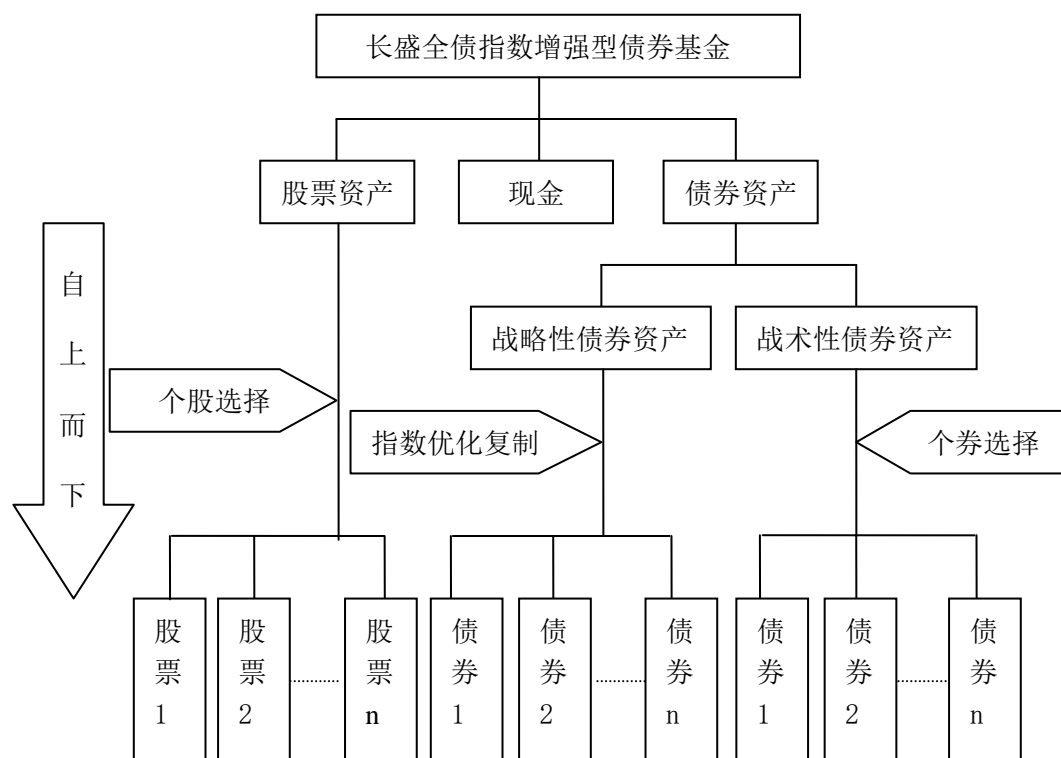
自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

#### （五）投资策略

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

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

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



2、运用指数化的增强性投资策略，获得超过目标指数的收益水平。

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

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

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

本基金还将充分利用以下无风险套利机会提高资产盈利水平：

---

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

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

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

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

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

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

## (六)投资决策与流程

### 1、研究过程

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

### 2、决策机制与决策过程

#### (1)决策依据

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

#### (2)决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的报告对基金的资产配置及指数化的增强性投资下达指导性意见，基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责；

### 3、投资组合的构建

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

#### A、债券投资组合的构建。

在债券投资方面，本基金将债券资产配置分为战略性资产和战术性资产两部分。

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

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

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

本基金对战略性债券资产和战术性债券资产实行“分户经营，统一管理”。

#### B：股票投资组合的构建。

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

股票投资组合的构建过程是自下而上进行个股选择的过程。

本基金投资组合的构建应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资于债券、股票的比例，不低于本基金资产总值的 80%；
- (2) 本基金投资于目标指数的比例不低于本基金资产净值的 64%，其中投资于国债的比例不低于本基金资产净值的 20%；

- 
- (3) 本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- (5) 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期，且债券回购融入的资金余额不得超过基金净资产的 40%；
- (6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (7) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (8) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证不得超过该权证的 10%；
- (9) 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%；
- (10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；
- (11) 本基金与本基金管理人管理的其他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%；
- (12) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%；
- (13) 本基金投资的资产支持证券的信用评级，不高于国内信用评级机构评定的 BBB 级或相当于 BBB 级的信用级别。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。
- (14) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；
- (15) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

---

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(17) 中国证监会规定的其它比例限制。

在本基金成立六个月内，应达到上述比例限制。除上述第（13）、（15）、（16）项外，因基金规模或市场剧烈变动导致投资组合不符合上述规定时，管理人应在合理期限内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

#### 4、交易过程

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

#### 5、投资组合调整过程

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

#### 6、业绩与风险评估过程

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

### (七) 证券选择标准

#### 1、个券选择标准

本基金在进行指数化的增强性投资时，其个券选择主要标准如下：

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

#### 2、个股选择标准

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

#### (八) 业绩比较基准

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

基金业绩比较基准=标普中国全债指数收益率×92%+沪深 300 指数收益率×8%。

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，或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经基金托管人同意，并按照监管部门要求履行适当程序后根据实际情况调整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审议。

#### (九) 投资限制

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、动用银行信贷资金从事证券买卖；
- 4、将基金资产用于非法担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、以基金资产进行房地产投资；
- 7、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 8、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 9、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格；
- 10、进行内幕交易、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为；
- 11、通过股票投资取得对上市公司的控制权；

---

12、因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他持有 5%以上投票权的股东恶意串通，致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法权益；

13、证券法规规定禁止从事的其他行为。

（十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

（十一）侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

---

## 十五、基金的资产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金资产的账户

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

### （四）基金资产的保管和处分

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

---

## 十六、基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （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

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值原则

对于存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确定计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

### （五）估值方法

#### 1、证券交易所上市交易的有价证券的估值

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

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权和含权固定收益品种（另有规定的除外），采用估值技术确定公允价值；

（3）交易所上市交易或挂牌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，按成本估值；

（4）交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中

---

所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；

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

(3) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

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

4、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。

5、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

6、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。

7、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見，按照基金管理人對基金淨值的計算結果對外予以公布。

#### （六）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。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。

#### （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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2、差错处理原则

---

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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，则差错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差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他方式处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

---

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为该类基金份额净值错误。

任一类基金份额净值出现错误时，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；当错误达到或超过该类基金资产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当任一类基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

---

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（4）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （八）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者的利益，已决定延迟估值；
- 4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 5、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （九）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。

基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的各类基金份额净值计算结果发送给基金托管人。

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，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

---

本基金各类基金份额净值的计算均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。

国家另有规定的，从其规定。

(十) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(十一) 实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

---

## 十七、基金的费用与税收

(一) 基金运营过程中，从基金资产中支付的费用

### 1、费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 销售服务费；
- (4) 证券交易费用；
- (5) 基金信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (8) 基金分红手续费；
- (9) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

### 2、费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计算。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

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

(2) 基金托管人的托管费

---

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计算。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### （3）销售服务费

本基金 A 类、B 类、D 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述（一）项 1 中（4）至（9）项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金成立前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

### 3、不列入基金费用的项目

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

---

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

#### （二）申购和赎回费用

1、本基金 A 类、B 类、D 类基金份额申购费用最高为不超过申购金额的 3%。A 类、B 类、D 类基金份额申购费用由该类基金份额申购人承担，不列入基金资产，C 类基金份额不收取申购费用。

2、本基金赎回费用最高为不超过赎回金额的 1.5%。赎回费由赎回人承担。本基金对持续持有期少于 7 日（不包括 7 日）的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

3、本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （三）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

#### （四）基金的税收

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

---

## 十八、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其它合法收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

1、本基金的收益以现金形式进行分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的该类基金份额净值自动转为相应类别的基金份额再投资于本基金。红利再投资免收手续费，并不受最低申购金额限制；除非基金份额持有人成功办理了选择取得红利再投资，否则其持有本基金基金份额的默认分红方式为现金红利。

2、由于各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

3、基金收益分配比例按有关规定制定；

4、基金投资当年亏损，则不进行收益分配；

5、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

7、基金收益分配后各类基金份额资产净值不能低于面值；

8、法律法规以及中国证监会的其它规定。

### （四）收益分配方案

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

---

由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

（五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定后五个工作日内公告。

（六）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收申购费用；

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。若投资者的现金红利不足以支付银行转帐或其它费用，基金登记注册人将投资者的现金红利按分红实施日的基金单位净值自动转为相应类别的基金单位，不足0.01份基金单位的，四舍五入。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

---

## 十九、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请具有证券从业资格的注册会计师对基金进行年度审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案；
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。更换会计师事务所需在 5 个工作日内公告。

---

## 二十、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《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。

### （一）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、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。指定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。

（二）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、法人或者非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本发生歧义的，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。

### (三) 公开披露的信息

#### 1、招募说明书、基金产品资料概要

本基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在 3 个工作日内更新招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。本基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

#### 2、成立公告书

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

#### 3、年度报告、中期报告、季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 3 个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载于指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 2 个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在指定网站上，将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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网站上，将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金持续运作过程中，基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

---

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### 4、基金份额净值公告

每开放日的次日披露该开放日本基金的各项基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### 5、临时公告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- 2) 终止《基金合同》、基金清算；
- 3) 转换基金运作方式、基金合并；
- 4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- 9) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

- 
- 11) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁;
  - 12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚, 基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;
  - 13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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, 或者从事其他重大关联交易事项, 中国证监会另有规定的情形除外;
  - 14) 基金收益分配事项;
  - 15) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
  - 16) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五;
  - 17) 本基金开始办理申购、赎回;
  - 18) 本基金在发生巨额赎回并延期办理;
  - 19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;
  - 20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请;
  - 21) 本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;
  - 22) 基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 6、澄清公告

在《基金合同》存续期限内, 任何公共媒介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, 以及可能损害基金份额持有人权益的, 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。

## 7、清算报告

《基金合同》终止的, 基金管理人应当依法组织清算组对基金财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计, 并由律师事务所出具法律意见书。清算组应当将清算报告登载在指定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

---

## 8、实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。

## 9、中国证监会规定的其他信息。

### （四）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，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金管理人、基金托管人应加强对未公开披露基金信息的管控，并建立基金敏感信息知情人登记制度。基金管理人、基金托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的基金信息。

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、各类基金份额净值、各类基金份额申购赎回价格、基金定期报告和更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或者电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊，单只基金只需选择一家报刊。

基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，基金管理人应当按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息，基金销售机构应当按照中国证监会规定做好信息传递工作。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，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。

---

（五）基金信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

---

## 二十一、基金的终止与清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

1. 基金经持有人大会表决终止的；
2. 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
3. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；
4. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；
5. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
6. 出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
7. 中国证监会允许的其他情况。

### （二）基金的清算

#### 1、基金清算小组

（1）自基金终止之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

（3）基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

#### 2、清算程序

- （1）基金终止后，由基金清算小组统一接管基金；
- （2）对基金资产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金资产进行估值；
- （4）对基金资产进行变现；

---

(5)将清算结果报告中国证监会；

(6)公布基金清算公告；

(7)对基金资产进行分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金资产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后三个工作日内公告。

### 6、清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

---

## 二十二、违约责任

（一）由于《基金合同》一方当事人的过错，造成《基金合同》不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属《基金合同》双方或多方当事人的过错，根据实际情况，双方或多方当事人分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、基金管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或现时有效的法律、法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；

2、在没有过错的情况下，基金管理人由于按照本《基金合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权利而造成的损失等。

（二）《基金合同》当事人违反《基金合同》，给其他方造成直接损失的，应进行赔偿。

（三）《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。

---

## 二十三、争议的处理

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，应由各方通过协商予以解决。协商自一方向其他各方发出书面协商通知之日开始。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权就该争议向有管辖权的人民法院提起诉讼。在争议处理期间，除争议事项外，《基金合同》的其他条款继续全面有效，各方当事人均应遵守、履行。

---

## 二十四、通知与送达

(一) 与本合同有关的任何事宜，如需书面告知本合同的当事人，应以下述方式作出书面通知：

- 1、如通知基金发起人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 2、如通知基金管理人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 3、如通知基金托管人：采用面呈递交、挂号邮寄或传真的方式；
- 4、如通知基金份额持有人：采用挂号邮寄、电子邮件、传真或公告的方式。

(二) 上述通知应当送达至相关当事人的下述地址或号码：

1、基金份额持有人：在认购或申购基金时登记的通信地址或其更改后的通信地址，采用公告通知的方式除外。

2、基金发起人：长盛基金管理有限公司

地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271，邮政编码：100028

传真：010-64689475

收件人：长盛基金管理有限公司

3、基金管理人：长盛基金管理有限公司

地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 2271，邮政编码：100028

传真：010-64689475

收件人：长盛基金管理有限公司

4、基金托管人：中国农业银行

地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦 7 层，邮政编码：  
100037

传真：010-68424181

收件人：中国农业银行托管部负责人

(三) 送达

- 1、以面呈递交方式作出的通知，面呈递交时即视为送达；
- 2、以挂号邮寄方式作出的通知，在邮件发出后第七日即视为送达；
- 3、以传真的方式作出的通知，在传真发出后即视为送达；

---

4、以公告方式作出的通知，在公告发布当日即视为送达，但法律法规另有规定的除外。

---

## 二十五、《基金合同》的效力

（一）本《基金合同》经基金发起人、基金管理人、基金托管人三方盖章以及三方法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。

（二）本《基金合同》的有效期限自其生效之日起至本基金清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

（三）本《基金合同》自生效之日起对包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

（四）本《基金合同》及其修订本正本一式五份，除上报有关监管机构二份外，基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

（五）本《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资人可免费查阅；也可按工本费购买本《基金合同》印制件或复印件，但应以《基金合同》正本为准。

---

## 二十六、《基金合同》的修改和终止

### （一）《基金合同》的修改

- 1、本基金合同的修改应经基金发起人、基金管理人和基金托管人同意；
- 2、修改本基金合同应召开基金份额持有人大会，基金合同修改的内容应经基金份额持有人大会决议通过；
- 3、基金合同的修改应报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属本基金合同必须遵照进行修改的情形或基金合同的修改事项对基金份额持有人的利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

### （二）《基金合同》的终止

- 1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：
  - （1）基金经持有人大会表决终止的；
  - （2）因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
  - （3）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理人承受其原有权利及义务；
  - （4）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的基金托管人承受其原有权利及义务；
  - （5）由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
  - （6）出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
  - （7）中国证监会允许的其他情况。
- 2、《基金合同》的终止。本基金终止后，须依法和本《基金合同》对基金进行清算。本《基金合同》于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

---

## 二十七、其他事项

基金合同当事人应遵守《长盛全债指数增强型债券投资基金业务规则》(以下简称《业务规则》)。《业务规则》由基金管理人制订,并由其解释与修改。

本基金合同未尽事宜,由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。如果协商的结果导致本基金合同的修改,则应召开持有人大会,对基金合同的修改达成决议。

---

## 二十八、基金合同内容摘要

### (一) 基金合同当事人的权利义务

#### 1、基金发起人的权利与义务

本基金的基金发起人为长盛基金管理有限公司。

##### (1) 基金发起人的权利

- 1) 申请设立基金；
- 2) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

##### (2) 基金发起人的义务

- 1) 遵守基金合同；
- 2) 公告招募说明书和发行公告；
- 3) 不从事任何有损基金及其它基金当事人利益的活动；
- 4) 基金不能成立时在法定的时间内退还所募集资金本息并承担发行费用；
- 5) 法律法规及基金合同规定的其它义务。

#### 2、基金管理人的权利与义务

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司。

##### (1) 基金管理人的权利

- 1) 自本基金成立之日起，依据本基金合同及有关法律运用本基金资产；
- 2) 依照《暂行办法》、《试点办法》及其它有关规定，代表基金对被投资的上市公司行使股东权利；
- 3) 依据本基金合同及有关法律监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，必要时应采取保护措施保护基金投资者的利益；
- 4) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理；
- 5) 直接销售基金单位，获取认购（申购）费用；
- 6) 依据本基金合同及有关法律决定基金收益的分配方案；
- 7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理基金单位的申购和赎回；

---

8) 依据基金合同的规定获得基金管理费收入;

9) 法律法规及基金合同规定的其它权利。

(2) 基金管理人的义务

1) 自基金成立之日起, 以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产;

2) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金资产;

3) 配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购和赎回业务或委托其它机构代理该项业务;

4) 配备足够的专业人员进行基金的登记注册或委托其它机构代理该项业务;

5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立, 保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立;

6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不为自己及任何第三人谋取利益, 不委托第三人运作基金资产;

7) 接受基金托管人的监督;

8) 按规定计算并公告基金净值;

9) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定, 履行信息披露及报告义务;

10) 保守基金商业秘密, 不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》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;

11) 依据《基金合同》规定向基金份额持有人分配收益;

12) 按照法律法规和本《基金合同》的规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

13) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

14) 依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会;

15) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上;

---

16) 确保向基金投资者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规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

17) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

19) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，采取适当合理的方式向基金投资者进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

20) 因估值错误导致投资人的损失，属管理人责任的，应承担赔偿责任，并采取适当、合理的方式向投资人进行赔偿，其过错责任不因其退任而免除；

21) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

22) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

本基金的基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

#### (1) 基金托管人的权利

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

#### (2) 基金托管人的义务

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

### 2、基金托管人的义务

- 1) 依法持有基金资产；
- 2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并保管基金资产；
- 3) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格

---

的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

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

5) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；

6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

7) 以基金的名义设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来；

8) 保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》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；

9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及各类基金份额单位基金净值；

10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；

11) 采取适当、合理的措施，使开放式基金单位的认购、申购和赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金单位认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定；

14) 在定期报告内出具基金托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；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；

15) 建立并保存基金份额持有人名册；

16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

17) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

---

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

19) 参加基金清算小组, 参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;

20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会和中国人民银行, 并通知基金管理人;

21) 因过错导致基金资产的损失时, 应承担赔偿责任, 其过错责任不因其退任而免除;

22) 基金管理人因过错造成基金资产损失时, 应代表基金向基金管理人追偿;

23) 法律、法规和《基金合同》规定的其他义务。

#### 4、基金份额持有人的权利与义务

##### (1) 基金份额持有人的权利

1) 取得基金收益;

2) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 并行使表决权;

3) 监督基金运作状况, 获取基金业务及财务状况的资料;

4) 申购、赎回及其它对基金单位处分的权利, 并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金单位;

5) 因基金管理人、托管人、销售机构、登记注册机构的错误导致基金份额持有人利益受损害的情况下, 要求赔偿的权利;

6) 参与基金清算后的剩余资产的分配;

7) 法律、法规和《基金合同》规定的其他权利。

同一类别每份基金单位具有同等的合法权益。

##### (2) 基金份额持有人的义务

1) 遵守《基金合同》;

2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用;

3) 以其持有的基金份额为限承担基金亏损或者终止的责任;

4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动;

5) 法律、法规和《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

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。同一类别基金份额持有人持有的每一份基金份额拥有平等的投票权。

### 2、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有10%以上（不含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）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）提前终止基金合同；
- （2）基金扩募或延长基金合同期限；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）或提高销售服务费；
- （5）基金管理人、基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （6）更换基金管理人、基金托管人；
- （7）对基金当事人权利和义务产生重大影响的基金合同修改，但基金合同及法律、法规另有规定的除外；
- （8）《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，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、销售服务费；
- （2）因相应的法律、法规（包括证券监督管理部门的要求，下同）发生变动必须对基金合同进行修改、变更；
- （3）对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （4）对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （5）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

### 3、会议召集方式

- （1）除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理

---

人召集，基金份额持有人大会的开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

（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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

（3）代表基金份额 10%以上（不含 10%）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 10%（不含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；

（4）代表基金份额 10%以上（不含 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，代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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。

#### 4、通知

（1）召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1) 会议召开时间、地点、方式；
- 2) 会议审议事项、议事程序、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) 代理投票委托书送达时间和地点;
  - 5) 会务常设联系人姓名、电话;
  - 6) 其他注意事项。

(2) 如召集人为基金管理人, 还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金托管人, 则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金份额持有人, 则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

## 5、会议的召开方式

### (1) 会议方式

- 1) 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;
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席, 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;
- 3) 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;
- 4) 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事宜或转换基金运作方式必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### (2) 基金份额持有人大会召开条件

#### 1) 现场开会

必须同时符合以下条件时, 现场会议方可举行:

a) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示, 有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的 50% (不含 50%);

b) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备, 到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定, 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。

未能满足上述条件的情况下, 则召集人可另行确定并公告重新开会的时间 (至少应在 15 个工作日后) 和地点, 但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

#### 2) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时, 通讯会议方可举行:

---

a) 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；

b) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

c) 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占在权益登记日基金总份额的 50% 以上（不含 50%）；

d) 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它代表，同时提交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。

如表决截止日前（含当日）未达到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 15 个工作日后），但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 6、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

1) 议事内容仅限于本基金合同“五、基金份额持有人大会（二）召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

2) 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；

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。

### （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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10%以上（不含 10%）的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上（不含 50%）多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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）、身份证号码、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 10 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 7、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议

1) 一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%（不含 50%）以上通过方为有效；除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、提前终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否

---

则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

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

## 8、计票

### （1）现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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，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三名代表担任监票人；

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

3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若基金托管人担任召集人，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。

## 9、生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告。

---

#### 10、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、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二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

#### **（三）基金收益分配原则、执行方式**

##### 1、基金收益的构成

- ①买卖证券差价；
- ②基金投资所得红利、股息、债券利息；
- ③银行存款利息；

---

④已实现的其它合法收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约应计入收益。

## 2、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

## 3、收益分配原则

①本基金的收益以现金形式进行分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的该类基金单位净值自动转为相应类别的基金单位再投资于本基金。红利再投资免收手续费，并不受最低申购金额限制；除非基金份额持有人成功办理了选择取得红利再投资，否则其持有本基金基金单位的默认分红方式为现金红利。

②由于各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

③基金收益分配比例按有关规定制定；

④基金投资当年亏损，则不进行收益分配；

⑤基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

⑥在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

⑦基金收益分配后各类基金单位资产净值不能低于面值；

⑧法律法规以及中国证监会的其它规定。

## 4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。由于不同基金份额类别对应的可分配收益不同，基金管理人可相应制定不同的收益分配方案。

## 5、收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在五个工作日内公告。

## 6、收益分配中发生的费用

---

(1) 收益分配采用红利再投资方式免收申购费用；

(2) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

若投资者的现金红利不足以支付银行转帐或其它费用，基金登记注册人将投资者的现金红利按分红实施日的基金单位净值自动转为相应类别的基金单位，不足 0.01 份基金单位的，四舍五入。

#### 7、实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

#### (四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### 1、基金运营过程中，从基金资产中支付的费用

###### (1) 费用种类

- 1) 基金管理人的管理费；
- 2) 基金托管人的托管费；
- 3) 销售服务费
- 4) 证券交易费用；
- 5) 基金信息披露费用；
- 6) 基金份额持有人大会费用；
- 7) 与基金相关的会计师费和律师费；
- 8) 基金分红手续费；
- 9) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

###### (2) 费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计算。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

---

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

## 2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计算。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

## 3) 销售服务费

本基金 A 类、B 类、D 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述 1、项（1）中 4）至 9）项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金成立前所发生

---

的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

### （3）不列入基金费用的项目

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

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

## 2、申购和赎回费用

（1）本基金 A 类、B 类、D 类基金份额申购费用最高为不超过申购金额的 3%。A 类、B 类、D 类基金份额申购费用由该类基金份额申购人承担，不列入基金资产，C 类基金份额不收取申购费用。

（2）本基金赎回费用最高为不超过赎回金额的 1.5%。赎回费由赎回人承担。本基金对持续持有期少于 7 日（不包括 7 日）的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规或中国证监会规定的比例下限。

（3）本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人确定并在招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟须于新的费率或收费方式开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## 3、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

## 4、基金的税收

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

## （五）基金财产的投资方向和投资限制

### 1、投资目标

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

---

## 2、投资范围

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

## 3、投资理念

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

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

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

(2)标普中国全债指数能够直接、比较真实地刻画债券市场走势。

标普中国全债指数是一个全面反映整个债券市场的综合性权威债券指数。

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

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

(4)动态资产组合管理是确保投资目标实现的关键。

---

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

#### 4、标的指数

本基金标的指数为标普中国全债指数。

标的指数编制方法具体见招募说明书的规定。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

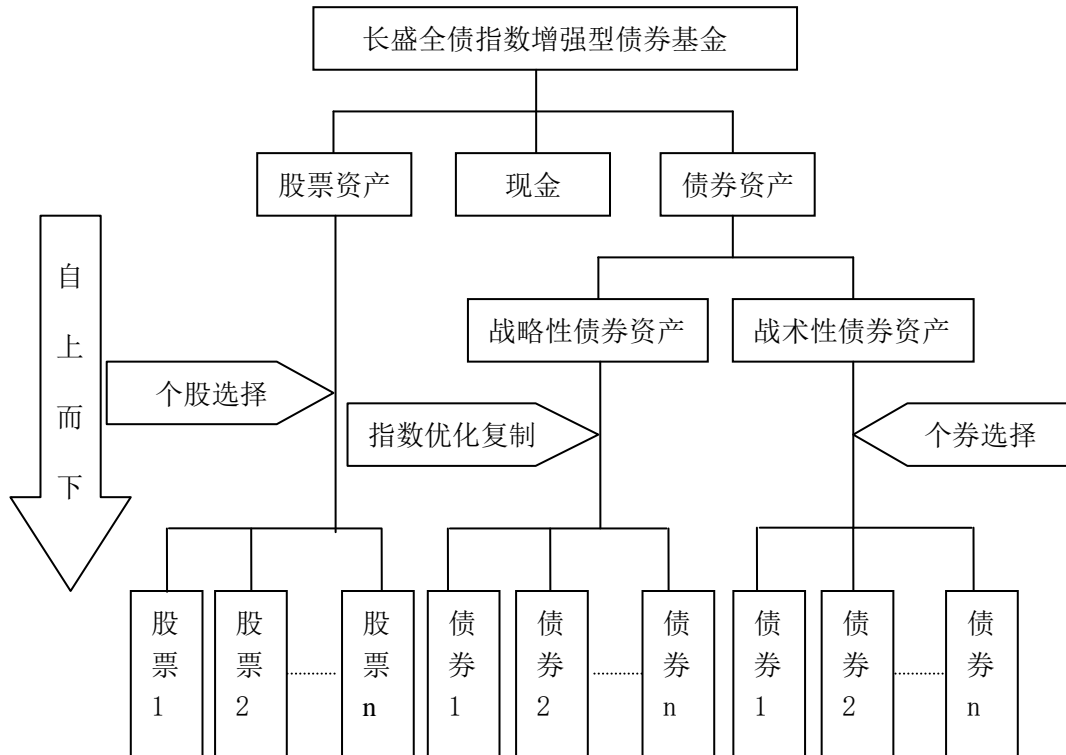
自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

#### 5、投资策略

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

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

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



(2)运用指数化的增强性投资策略，获得超过目标指数的收益水平。

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

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

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

本基金还将充分利用以下无风险套利机会提高资产盈利水平：

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

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

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

---

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

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

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

## 6、投资决策与流程

### (1)研究过程

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

### (2)决策机制与决策过程

#### 1)决策依据

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

#### 2)决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的报告对基金的资产配置及指数化的增强性投资下达指导性意见，基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责；

### (3)投资组合的构建

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

#### A、债券投资组合的构建。

在债券投资方面，本基金将债券资产配置分为战略性资产和战术性资产两部分。

战略性资产配置体现指数化投资原则，将以标普全债指数样本券为基础，通过保持投资组合久期与目标指数久期有限度的偏离(偏离度 5%)，实现对目标

指数的优化复制。战略性债券资产配置的最低比例为基金净资产的 64%。随着债券市场有效性的提高，战略性债券资产配置的比重可适度增加。

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

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

本基金对战略性债券资产和战术性债券资产实行“分户经营，统一管理”。

#### B: 股票投资组合的构建。

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

股票投资组合的构建过程是自下而上进行个股选择的过程。

本基金投资组合的构建应遵循以下限制：

- a. 本基金投资于债券、股票的比例，不低于本基金资产总值的 80%；
- b. 本基金投资于目标指数的比例不低于本基金资产净值的 64%，其中投资于国债的比例不低于本基金资产净值的 20%；
- c. 本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；
- d. 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- e. 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期，且债券回购融入的资金余额不得超过基金净资产的 40%；

---

f.本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

g.本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

h.本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证不得超过该权证的10%；

i.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%；

j.本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的10%；

k.本基金与本基金管理人管理的其他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%；

l.本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

m.本基金投资的资产支持证券的信用评级，不低于国内信用评级机构评定的BBB级或相当于BBB级的信用级别。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。

n.本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%；

o.本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

p.本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

q.中国证监会规定的其它比例限制。

---

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

#### (4)交易过程

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

#### (5)投资组合调整过程

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

#### (6)业绩与风险评估过程

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

### 7、证券选择标准

#### (1) 个券选择标准

本基金在进行指数化的增强性投资时，其个券选择主要标准如下：

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

#### (2) 个股选择标准

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

### 8、业绩比较基准

本基金为增强性指数化债券型投资基金，对目标指数的投资在资产配置中最低比例为 64%，股票资产配置最高比例为 16%，现金持有最低比例为 3%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。由于本基金主要投

---

资于债券，股票投资是作为增强型投资提高收益的一种手段，预计股票投资比例的平均值为 8%，因此将基金业绩比较设定为：

基金业绩比较基准=标普中国全债指数收益率×92%+沪深 300 指数收益率×8%。

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，或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经基金托管人同意，并按照监管部门要求履行适当程序后根据实际情况调整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审议。

## 9、投资限制

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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

## 10、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- (1) 不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；

- 
- (2) 有利于基金资产的安全和增值；
  - (3) 独立行使股东权利，保护基金投资人的利益；
  - (4) 基金管理人按照有关规定代表基金行使股东权利。

#### 11、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。

#### **(六) 基金资产净值的计算方法和公告方式**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金份额净值公告是指每开放日的次日披露该开放日本基金的各项基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### **(七) 基金合同的修改和终止**

##### 1、《基金合同》的修改

- (1) 本基金合同的修改应经基金发起人、基金管理人和基金托管人同意；
- (2) 修改本基金合同应召开基金份额持有人大会，基金合同修改的内容应经基金份额持有人大会决议通过；

(3) 基金合同的修改应报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属本基金合同必须遵照进行修改的情形或基金合同的修改事项对基金份额持有人的利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

##### 2、《基金合同》的终止

- (1) 出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：
  - 1) 基金经持有人大会表决终止的；
  - 2) 因重大违法行为，基金被中国证监会责令终止的。
  - 3) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的

---

职务，而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；

4) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其他适当的托管机构承受其原有权利及义务；

5) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

6) 出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

7) 中国证监会允许的其他情况。

(2) 《基金合同》的终止。本基金终止后，须依法和本《基金合同》对基金进行清算。本《基金合同》于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

#### **(八) 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，应由各方通过协商予以解决。协商自一方向其他各方发出书面协商通知之日开始。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权就该争议向有管辖权的人民法院提起诉讼。在争议处理期间，除争议事项外，《基金合同》的其他条款继续全面有效，各方当事人均应遵守、履行。

#### **(九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

本《基金合同》及其修订本正本一式五份，除上报有关监管机构二份外，基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

本《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资人可免费查阅；也可按工本费购买本《基金合同》印制件或复印件，但应以《基金合同》正本为准。