

**长信金利趋势股票型证券投资基金  
更新的招募说明书  
2010年第2号**

**基金管理人：长信基金管理有限责任公司**

**基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司**

**二〇一〇年十二月**

## 重要提示

长信金利趋势股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2005年10月11日中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]168号文核准募集。本基金基金合同于2006年4月30日正式生效。

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

投资有风险，投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2010年10月30日，有关财务数据和净值表现自2010年7月1日至2010年9月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

## 目 录

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| 一、绪言 .....                  | 1   |
| 二、释义 .....                  | 2   |
| 三、基金管理人 .....               | 5   |
| 四、基金托管人 .....               | 17  |
| 五、相关服务机构 .....              | 22  |
| 六、基金的募集 .....               | 30  |
| 七、基金合同的生效 .....             | 31  |
| 八、基金份额的申购、赎回与转换 .....       | 32  |
| 九、基金的投资 .....               | 44  |
| 十、基金的投资组合报告 .....           | 53  |
| 十一、基金的业绩 .....              | 57  |
| 十二、基金的财产 .....              | 59  |
| 十三、基金资产的估值 .....            | 61  |
| 十四、基金收益与分配 .....            | 67  |
| 十五、基金费用与税收 .....            | 69  |
| 十六、基金的会计与审计 .....           | 71  |
| 十七、基金的信息披露 .....            | 72  |
| 十八、风险揭示 .....               | 77  |
| 十九、基金合同的变更、终止和基金财产的清算 ..... | 80  |
| 二十、基金合同的内容摘要 .....          | 83  |
| 二十一、基金托管协议的内容摘要 .....       | 100 |
| 二十二、基金份额持有人服务 .....         | 110 |
| 二十三、其他应披露事项 .....           | 113 |
| 二十四、招募说明书存放及查阅方式 .....      | 115 |
| 二十五、备查文件 .....              | 116 |



## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）和其他有关法律、法规的规定，以及《长信金利趋势股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“合同”或“基金合同”）编写。

本招募说明书阐述了长信金利趋势股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。本招募说明书的解释权由长信基金管理有限责任公司所有。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，或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

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：

| 释义               |  |
|------------------|--|
| 本合同、《基金合同》       | 指《长信金利趋势股票型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充  |
| 中国               | 指中华人民共和国（就本合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）   |
| 法律法规             | 指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件  |
| 《基金法》            | 指《中华人民共和国证券投资基金法》  |
| 《销售办法》           | 指《证券投资基金销售管理办法》  |
| 《运作办法》           | 指《证券投资基金运作管理办法》  |
| 《信息披露办法》         | 指《证券投资基金信息披露管理办法》  |
| 上海证交所《业务规则》      | 指 2005 年 7 月 14 日上海证券交易所发布并于 2005 年 7 月 14 日起施行的《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》   |
| 元                | 指中国法定货币人民币元  |
| 基金或本基金           | 指依据《基金合同》所设立的长信金利趋势股票型证券投资基金   |
| 招募说明书            | 指《长信金利趋势股票型证券投资基金招募说明书》，一份公开披露本基金管理人及托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的会计与审计、基金的信息披露、风险揭示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新 |
| 发售公告             | 指《长信金利趋势股票型证券投资基金基金份额发售公告》   |
| 业务规则             | 指《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》   |
| 中国证监会            | 指中国证券监督管理委员会   |
| 中国银监会            | 指中国银行业监督管理委员会  |
| 基金管理人或本基金管理人、本公司 | 指长信基金管理有限责任公司  |
| 基金托管人            | 指上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦东发展银行”）  |
| 基金销售代理人          | 指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构，以及可通过上海证券交易所系统办理销售服务业务的会员单位  |
| 会员单位             | 指具有开放式基金代销资格经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的，可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员单位   |
| 销售机构             | 指基金管理人及基金销售代理人   |
| 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   |
| 注册业务             | 指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等   |

|           |  |
|-----------|--|
| 基金注册登记机构  | 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《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体  |
| 个人投资者     | 指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人   |
| 机构投资者     | 指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有权部门批准设立的机构  |
| 合格境外机构投资者 | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者   |
| 投资者       | 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者的总称  |
| 基金合同生效日   | 基金达到法律规定及基金合同规定的基金备案条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日                                  |
| 募集期       | 指自基金份额发售之日起不超过 3 个月  |
| 基金存续期     | 指基金合同生效后合法存续的不定期之期间  |
| 日/天       | 指公历日   |
| 月         | 指公历月   |
| 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、赎回或办理其他基金业务的申请日  |
| T+n 日     | 指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）   |
| 认购或发售     | 指本基金在募集期内投资者购买本基金份额的行为   |
| 日常申购      | 指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理                            |
| 日常赎回      | 指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理                            |
| 场外或柜台     | 指不通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所  |
| 场内或交易所    | 指通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所   |
| 基金账户      | 指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的凭证  |
| 交易账户      | 指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户   |
| 转托管       | 指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务  |
| 基金转换      | 指投资者将其所持有的本基金管理人管理的任一开放式基金向本基金管理人提出申请将其原有基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为本基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为 |
| 定期定额投资计划  | 指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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者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                |
| 基金收益      | 指基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益  |
| 基金资产总值    | 指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和  |
| 基金份额净值    | 指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数   |

|        |  |
|--------|--|
| 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的过程   |
| 指定媒体   | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站   |
| 不可抗力   | 指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易 |



### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

| 基金管理人概况 |   |            |             |
|---------|---|------------|-------------|
| 名称      | 长信基金管理有限责任公司                              |            |             |
| 注册地址    | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼                      |            |             |
| 办公地址    | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼                      |            |             |
| 邮政编码    | 200120                                    |            |             |
| 批准设立机关  | 中国证券监督管理委员会                               |            |             |
| 批准设立文号  | 中国证监会证监基金字[2003]63 号                      |            |             |
| 注册资本    | 壹亿伍仟万元人民币                                 |            |             |
| 成立日期    | 2003 年 5 月 9 日                            |            |             |
| 组织形式    | 有限责任公司                                    |            |             |
| 法定代表人   | 田丹  |            |             |
| 电话      | 021-61009999                              |            |             |
| 传真      | 021-61009800                              |            |             |
| 联系人     | 尹克文                                       |            |             |
| 存续期间    | 持续经营                                      |            |             |
| 经营范围    | 基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营） |            |             |
| 股权结构    | <b>股东名称</b>                               | <b>出资额</b> | <b>出资比例</b> |
|         | 长江证券股份有限公司                                | 7350 万元    | 49%         |
|         | 上海海欣集团股份有限公司                              | 5149.5 万元  | 34.33%      |
|         | 武汉钢铁股份有限公司                                | 2500.5 万元  | 16.67%      |
|         | 总计  | 15000 万元   | 100%        |

#### (二) 主要人员情况

##### 1、基金管理人的董事会人员情况

| 董事会成员 |     |    |  |
|-------|-----|----|--|
| 姓名    | 职务  | 性别 | 简历   |
| 田丹    | 董事长 | 男  | 中共党员，硕士。曾任湖北省军区参谋、秘书，中国人民银行湖北省分行金融调研处科长，湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理，三峡证券公司副总经理，湖北证券有限责任公司董事、副总裁，长江证券有限责任公司董事、副总裁、财务负责人，长江证券有限责任公司董事、总裁。现任长信基金管理有限责任公司董事长。 |
| 胡运钊   | 董事  | 男  | 中共党员，研究生学历，高级经济师。曾任湖北省经委工业处处长、黄石市人民政府副市长、市委常委、常务副市长、湖北省人民政府副秘书长（正厅）、办公厅主任、办公厅党组副书记。现任长江证券股   |

|     |      |   |   |
|-----|------|---|---|
|     |      |   | 份有限公司党委书记、董事长。  |
| 王岑  | 董事   | 男 | 中共党员，硕士，高级工程师。历任武汉钢铁（集团）公司热轧厂技术员、科长、车间副主任、厂长助理、副厂长、厂长，武汉钢铁（集团）公司总经理助理兼武汉钢铁有限责任公司副总经理，武汉钢铁（集团）公司副总经理兼钢铁公司党委书记、副总经理，现任武汉钢铁股份有限公司董事、总经理。   |
| 李国洪 | 董事   | 男 | 硕士，曾在武汉市人民政府工作。曾任长江证券有限责任公司投资银行总部副总经理、资产保全事业部总经理、办公室总经理、长江证券股份有限公司副总裁。现任长江证券股份有限公司合规总监、长江证券承销保荐有限公司合规总监。  |
| 徐文彬 | 董事   | 男 | 中共党员。历任中国人民解放军 273 团政委，上海市松江区建设委员会党委书记，上海市松江区小昆山镇党委书记，上海市松江区洞泾镇党委书记。现任上海海欣集团股份有限公司党委书记、总裁。  |
| 陈谋亮 | 董事   | 男 | 中共党员，硕士，高级经济师。历任湖北经济学院讲师，扬子石化公司法律顾问，上海交大南洋股份有限公司部门经理兼证券事务代表，上海海欣集团股份有限公司董事会秘书兼战略投资管理部常务副总监、总裁助理。现任上海海欣集团股份有限公司副总监兼董事会秘书。  |
| 蒋学杰 | 董事   | 男 | 经济学硕士，澳大利亚墨尔本大学商学院 MBA。曾任中南财经大学财政金融学院财政系教师、武汉科技信托投资公司武昌证券营业部总经理，并兼公司总助，副总等职、Loftus Capital Partners Limited, Australia 旗下基金亚洲市场投资组合及私人股权投资投资的亚洲区域负责人、KVB Kunlun Pty Ltd, Australia 金融衍生产品持牌交易投资顾问、长信基金管理有限责任公司副总经理。现任长信基金管理有限责任公司总经理。 |
| 朱恒  | 独立董事 | 男 | 中共党员，本科，高级经济师。曾任中国人民银行、农业银行上海市奉贤支行副行长，中国农业银行上海市分行副行长，上海浦东发展银行副行长，万国证券公司、申银万国证券公司董事长，上海浦东发展银行党委副书记、副行长，上海轻工控股（集团）公司监事会主席。  |
| 余秉立 | 独立董事 | 男 | 中共党员，本科，注册会计师。历任武汉市财政局副科长、武汉市政府财贸办公室副科长、武汉市财政局副科长至副局长、武汉市审计局局长、党组书记、湖北省财政金融贸易办公室副主任、副书记、审计署驻武汉特派办特派员、书记、审计署驻武汉特派办正局级审计员。  |
| 黄宪  | 独立董事 | 男 | 中共党员，博士，博士生导师，曾任武汉大学教师、商学院副院长，美国新泽西西东大学访问学者，武汉大学珞珈城市信用社副董事长，中港合资武新公司财务总经理。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师。   |
| 宋晓燕 | 独立董事 | 女 | 中共党员，法学博士，律师。曾任武汉大学管理学院国际金融系教师。现任上海财经大学法学院教授。   |

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

## 2、监事会成员

| 监事会成员 |    |    |   |
|-------|----|----|---|
| 姓名    | 职务 | 性别 | 简历  |
| 郭自祥   | 监事 | 男  | 硕士，曾任武钢二钢厂宣传部部长、武钢工会副书记、副主席，武汉钢铁（集团）公司办公室主任。现任武汉钢铁集团公司企业管理部部长。  |
| 柳杨    | 监事 | 男  | 硕士，审计师。曾任长江证券有限责任公司财务总部会计员、核算部经理、总经理助理，现任长江证券股份有限公司财务负责人、财务总部总经理。   |
| 王罗洁   | 监事 | 女  | 大学本科，高级会计师，曾任核工业部国营 792 矿统计员、计划科长，上海海欣股份有限公司财务副经理、经理、财务副总监等职，现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。  |
| 李毅    | 监事 | 女  | 中共党员，硕士。曾任长信基金管理有限责任公司综合管理部副总监。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部（筹）负责人。   |
| 刘耘    | 监事 | 女  | 中共党员，硕士。曾任湖北经贸实业公司暨大通（中国）国际运输有限责任公司湖北分公司会计主管、深圳蓝天基金管理公司暨武汉蓝天房地产发展有限公司财务部经理、武汉国有资产经营公司资产财务部副经理、长信基金管理有限责任公司基金事务部总监、市场开发部副总监。现任长信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。 |

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

## 3、经理层人员

| 经理层成员 |      |    |   |
|-------|------|----|---|
| 姓名    | 职务   | 性别 | 简历  |
| 蒋学杰   | 总经理  | 男  | 简历同上。   |
| 付勇    | 副总经理 | 男  | 金融学博士，北京大学金融学专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾任中国建设银行个人金融业务部主任科员、华龙证券投资银行北京总部副总经理、东北证券北京总部总经理助理、东方基金副总经理。2006年1月至2010年2月任东方基金管理有限责任公司东方精选混合型开放式证券投资基金的基金经理，2008年6月至2010年2月任东方基金管理有限责任公司东方策略成长股票型开放式证券投资基金的基金经理。2010年3月加入长信基金管理有限责任公司，现任公司副总经理、投资总监、长信金利趋势股票型基金的基金经理。 |
| 覃波    | 副总经理 | 男  | 经济学学士，中南财经政法大学农业对外贸易专业本科毕业，具有基金从业资格。曾在长江证券公司从事资产管理和债券承销发行工作。2002年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经  |

|                          |     |   |  |
|--------------------------|-----|---|--|
|                          |     |   | 理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理，现任长信基金管理有限责任公司副总经理。   |
| 周永刚                      | 督察长 | 男 | 金融学硕士，EMBA。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。现任长信基金管理有限责任公司督察长。 |
| <b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b> |     |   |  |

#### 4、本基金基金经理（助理）

| 本基金历任基金经理情况 |                      |                      |   |
|-------------|----------------------|----------------------|---|
| 姓名          | 职务                   | 任职时间                 | 简历  |
| 许万国         | 基金经理                 | 2008年6月2日至今          | 经济学硕士，具有基金从业资格。曾任蔚深证券研究部研究员、深圳市恒宝鼎投资有限公司证券投资部负责人、融通基金管理有限公司策略研究员、融通基金蓝筹成长基金经理助理。先后从事上市公司行业研究、策略研究、投资管理等工作。2007年9月加入长信基金管理有限责任公司投资管理部，任基金经理助理一职。2008年6月起任本基金基金经理。  |
| 付勇          | 副总经理<br>投资总监<br>基金经理 | 2010年06月28日至今        | 金融学博士，北京大学金融学专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾任中国建设银行个人金融业务部主任科员、华龙证券投资银行北京总部副总经理、东北证券北京总部总经理助理、东方基金副总经理。2006年1月至2010年2月任东方基金管理有限责任公司东方精选混合型开放式证券投资基金的基金经理，2008年6月至2010年2月任东方基金管理有限责任公司东方策略成长股票型开放式证券投资基金的基金经理。2010年3月加入长信基金管理有限责任公司，现任公司副总经理、投资总监、长信金利趋势股票型基金的基金经理。 |
| 安昀          | 基金经理助理               | 2010年5月11日至今         | 经济学硕士，上海复旦大学经济学院数量经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。2006年起就职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，曾获2007年新财富最佳策略分析师评选第一名，2008年新财富最佳策略分析师评选第二名。2008年11月加入长信基金管理有限责任公司，担任策略研究员，从事策略研究工作。现任研究发展部副总监，2010年5月11日开始兼任长信金利基金的基金经理助理。  |
| 陆文俊         | 基金经理                 | 2006年7月6日至2008年6月12日 | 曾任本基金基金经理。  |

|                          |      |                           |            |
|--------------------------|------|---------------------------|------------|
|                          |      | 日                         |            |
| 梁晓军                      | 基金经理 | 2006年4月30日<br>至2006年9月22日 | 曾任本基金基金经理。 |
| <b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b> |      |                           |            |

### 5、投资决策委员会成员

| 投资决策委员会成员                |  |                  |
|--------------------------|--|------------------|
| 姓名                       | 职务   | 备注               |
| 蒋学杰                      | 总经理  | 公司国内股票基金投资决策小组成员 |
| 付 勇                      | 副总经理、投资总监、投资决策委员会主任委员、长信金利基金的基金经理              |                  |
| 叶 琦                      | 总经理助理、金融工程部总监、国际业务部总监                          |                  |
| 胡志宝                      | 投资管理部副总监、投资决策委员会执行委员、长信银利基金的基金经理、长信增利基金的基金经理   |                  |
| 钱 斌                      | 研究发展部总监、长信双利基金的基金经理                            |                  |
| 李洪书                      | 交易管理部副总监                                       |                  |
| 李小羽                      | 固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券基金的基金经理、长信中短债基金的基金经理 | 公司固定收益类投资决策小组成员  |
| 张大军                      | 专户理财部总监、投资决策委员会执行委员                            | 公司专户理财投资决策小组成员   |
| <b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b> |  |                  |

### （三）内部组织结构及员工情况

| 内部组织结构及员工情况   |   |           |           |
|---|---|-----------|-----------|
| 股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。 |   |           |           |
| 公司经营管理层下设的委员会   | 内部控制委员会、投资决策委员会等委员会   |           |           |
| 公司内部组织结构  | 金融工程部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、交易管理部、基金事务部、市场开发部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、专户理财部、国际业务部、产品开发部 |           |           |
| 分支机构  | 北京分公司、武汉办事处   |           |           |
| 员工总数  | 105人（截至2010年10月30日）   |           |           |
| 员工学历构成  | <b>学历</b>   | <b>人数</b> | <b>占比</b> |
|   | 博士  | 4人        | 4%        |
|   | 硕士  | 54人       | 51%       |
|   | 本科  | 39人       | 37%       |
|   | 专科  | 6人        | 6%        |
|   | 其它  | 2人        | 2%        |

|  |    |       |      |
|--|----|-------|------|
|  | 总计 | 105 人 | 100% |
|--|----|-------|------|

#### （四）基金管理人的职责

- 1、办理基金备案手续；
- 2、自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 3、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 4、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；
- 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,不得利用基金资产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产；
- 7、依法接受基金托管人的监督；
- 8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格；
- 9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 10、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务；
- 12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露；
- 13、按《基金合同》规定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；

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

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

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

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

21、基金托管人因违反《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托管人追偿；

22、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；

23、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活期存款利息在募集期结束后 30 天内退还基金认购人；

24、执行生效的基金份额持有人大会的决定；

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规和《基金合同》规定的其它义务。

## （五）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止以基金财产从事下列行为：

（1）将基金管理人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，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (10) 贬损同行，以提高自己；
- (11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 其他法律、行政法规禁止的行为。

5、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) 不得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) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## **(六) 基金管理人的风险管理和内部控制制度**

基金管理人高度重视内部风险控制，建立了完善的风险管理体系和控制体系，从制度上保障本基金的规范运作。

### **1、公司内部控制的总体目标**

- (1) 保证公司经营管理活动的合法合规性；
- (2) 保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；
- (3) 实现公司稳健、持续发展、维护股东权益；
- (4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

### **2、内部控制制度遵循的原则**

- (1) 合法合规性原则：公司内部控制制度应当符合国家法律法规和各项规定。
- (2) 全面性原则：内部控制制度应当覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工。
- (3) 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，内部控制制度应当具有高度的权威性，任何员工不得拥有超越制度约束的权利。
- (4) 独立性原则：公司在精简的基础上设立能够充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立。公司固有财产、基金财产和其他财产的运作应当分离。
- (5) 相互制约原则：公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
- (6) 防火墙原则：公司基金投资、交易、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应当制定严格的审批程序和监管措施。
- (7) 审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。
- (8) 适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

(9) 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。

(10) 保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上。

(11) 定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和操作性。

### 3、内部风险控制体系结构

公司内控体系由以下不同层面构成。公司董事会、经营管理层（包括督察长）、内部控制委员会、监察稽核部及公司其他部门、各岗位在各自职责范围内承担风险控制责任。

(1) 董事会：全面负责公司的风险控制工作，对建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；

(2) 经营管理层：负责日常经营管理中的风险控制工作，对内部控制制度的有效执行承担责任；督察长：负责对公司内部管理、资产运作以及经营管理层、内部各部门、各岗位执行制度及遵纪守法情况进行监督和检查，并对公司内部风险控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价；

(3) 内部控制委员会：协助经营管理层负责公司风险控制工作，主要负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制定相应的控制制度，协调处理突发性重大事件或危机事件。内部控制委员会由公司总经理、副总经理、监察稽核部总监、基金事务部总监、市场开发部总监和部分从事内部控制方面的业务骨干组成；

(4) 监察稽核部：负责检查评价公司内部控制制度的合法性、合规性、完备性、有效性以及执行情况；对公司经营业务和基金运作情况进行日常稽核；对各部门、各岗位、各项业务的风险控制情况实施全面的监督检查，并及时报告检查结果。监察稽核部独立行使检查权并对经营管理层负责；

(5) 业务部门和公司各岗位：公司业务部门根据公司各项基本管理制度，结合部门具体情况制定本部门的管理办法和实施细则，加强对各项业务和各业务环节的风险控制；公司各岗位：根据岗位职责和业务操作流程，按业务授权规范操作，严格控制操作风险。

#### 4、内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的内部风险控制制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成，按照其效力大小分为四个层面：

第一个层面是公司章程。

第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司自定各项规章制度的基础和依据，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

第三个层面是公司基本管理制度，它包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源制度、业绩评估考核制度和危机处理制度，等等。

第四个层面是公司各部门业务规章、实施细则等。部门业务规章、实施细则是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

#### 5、内部风险管理体系

基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险以及不可抗力风险。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理程序，具体包括以下内容：

- (1) 投资风险的管理；
- (2) 交易风险管理；
- (3) 巨额赎回风险管理；
- (4) 基金注册登记风险管理；
- (5) 基金核算风险管理；
- (6) 市场开发风险管理；
- (7) 信息披露风险管理；
- (8) 不可抗力风险管理。

#### 6、风险管理和内部控制的措施

- (1) 建立内控结构，完善内控制度：建立、健全了行之有效的内控制度，确保

各项业务活动都有适当的授权和明确的分工，确保监察稽核活动的独立性、权威性；

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立了明确的岗位分离制度，做到研究、决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，同时进行空间隔离，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密，从制度上降低和防范风险；

(3) 建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每位员工都明确自己的任务、职责，及时上报各自工作领域中发现的风险隐患，以防范和化解风险；

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了内部控制委员会，使用适合的程序和方法，确认和评估公司经营管理和基金运作中的风险；建立自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策，减少风险造成的损失；

(5) 建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如计算机预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

(6) 使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

(7) 提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，不断提高员工素质和职业技能，防范和化解风险。

## **7、基金管理人关于内部合规控制声明书**

(1) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

成立时间：1992年10月19日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；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；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；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；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；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：114.7906亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105号

联系人：朱萍

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行经过十多年的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快的增长，各项经营指标在新兴股份制商业银行中处于领先水平。截止到2010年6月30日，全行总资产规模已达17,812.61亿元人民币，各项存款余额14,446.93亿元人民币，各项贷款余额10,506.10亿元人民币，实现净利润90.81

亿元人民币，每股收益0.791元。

上海浦东发展银行总行设资产托管部，资产托管部下设市场发展部、托管运作部、技术保障部、内控管理部四个职能部门，现有员工 37 人。

## （二）主要人员情况

吉晓辉，男，1955 年出生，工商管理硕士，高级经济师。曾任中国工商银行上海浦东分行行长、党委副书记；中国工商银行上海市分行副行长兼浦东分行行长；中国工商银行上海市分行副行长、党委副书记（主持工作）；中国工商银行上海市分行行长、党委书记；上海市政府副秘书长、上海市金融工作党委副书记、上海市金融服务办公室主任。现任上海浦东发展银行股份有限公司董事长、党委书记，上海国际集团有限公司董事长、党委书记、上海汽车股份有限公司董事。第十届、十一届全国政协委员，中共上海市第九届委员会候补委员。

傅建华，男，1951 年出生，硕士，高级经济师。曾任中国建设银行江西省分行副行长，中国建设银行上海市分行办公室主任、上海市分行副行长，中国建设银行信贷管理部总经理，中国建设银行上海市分行副行长，上海银行党委书记、行长、副董事长、董事长。现任上海浦东发展银行副董事长、行长、党委副书记。

刘信义，男，1965 年出生，研究生学历，高级经济师，曾任上海浦东发展银行空港支行副行长(主持工作)、上海浦东发展银行上海地区总部副总经理、党委委员。2002 年 10 月上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行副行长，现任上海浦东发展银行副行长、财务总监。

刘长江，男，资产托管部总经理，曾就职于中国工商银行总行基金托管部，对银行业务、证券投资基金及基金托管业务具有丰富的经验。

## （三）基金托管业务经营情况

上海浦东发展银行股份有限公司于 2003 年 9 月 10 日获得基金托管资格，截止到 2010 年 6 月 30 日，共托管国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、嘉实优质企业基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金七只开放式证券投资基金，托管基金资产净值总规模为 239.96 亿元。

## （四）基金托管人的禁止行为

- 1、以违反法律法规、《基金合同》及其他规定之方式保管基金资产；
- 2、除《信托法》、《基金法》及其他有关法律法规和《基金合同》的有关规定明

确规定的情形之外，委托第三人托管基金资产；

- 3、对基金管理人的正常指令拖延和拒绝执行；
- 4、除依据基金管理人指令或《基金合同》另有规定的，自行运用、处分和分配基金资产；
- 5、将基金资产转为其自有财产，将自有财产与基金资产进行交易，或者将不同基金资产进行相互交易；
- 6、同意基金管理人将基金资产用于违反有关法律法规及《基金合同》规定的投资；
- 7、提供虚假的或者隐瞒重要事实的财务会计报告、统计报告、定期报告；
- 8、从事法律、行政法规、中国证监会规定、《基金合同》及其他规定所禁止的其它任何行为。

### **（五）基金托管人的内部控制制度**

公司董事会一贯重视履行建立健全并有效实施内部控制的责任，治理结构和议事规则规范，决策、执行、监督等方面的职责权限明确，为公司实施内部控制奠定了坚实基础。

通过开展风险评估，能够识别与实现控制目标相关的内部风险和外部风险，确定相应的风险承受度，采取审慎的风险偏好策略。本报告期，公司以监管政策为指引进行了系统性风险评估，以新资本协议为抓手开展了信用、市场和操作风险评估，以规章制度为依据组织了合规风险评估，以应对本外币流动性压力强化了流动性风险评估。

公司在各项控制活动中，不断完善内部控制制度建设，优化内部控制措施，强化内部控制制度执行力，确保业务流程和风险处于受控状态。公司持续开展各项控制活动，表现在：制度控制持续完善，岗位控制持续加强，授权控制持续强化，流程控制持续优化，系统控制持续提升，应急能力持续增强，以进一步提高内部控制的充分性、合规性、有效性和适宜性。

公司基本建立了与业务、经营规模相适应的检查和监督机制。本报告期，对内部控制绩效情况实施各项监督，表现在：业务监督力度加大，风险监督统筹兼顾，合规监督切合实际，审计监督突出重点，监事会监督注重规范。

通过对公司内部控制的自我评估，尚未发现公司存在内部控制设计或执行方面

的重大缺陷，但仍然存在政府融资平台贷款增长较快，部分分支机构负债业务发展不够稳定，个别业务制度缺失，内控措施执行力有待提高等问题，尽管这些问题对公司内部控制目标尚不构成严重负面影响或潜在严重负面影响，公司仍高度重视，并采取整改措施。

综上公司内部控制制度基本健全、执行有效，内控水平有了进一步提高，内控体系日趋完善。公司将根据内外部环境的变化以及业务发展的需要，不断完善内部控制管理。

## （六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《证券投资基金运作管理办法》；
- （4）《证券投资基金销售管理办法》
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

### 2、监督内容

对证券投资基金的监督是指对基金的资金用途、对基金管理人投资行为的监督、对基金的运作的监督，具体包括但不限于：

- （1）资金用途；
- （2）投资范围；
- （3）投资比例；
- （4）投资限制；
- （5）基金资产估值；
- （6）基金投资人的权力维护；
- （7）法律、法规规定的相关监督指标。

### 3、监督方法

- （1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独



立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

(2) 在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

(3) 对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

#### 4、监督结果的处理方式

(1) 基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

(2) 若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，应以提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

(3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

|                               |                       |
|-------------------------------|-----------------------|
| <b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>    |                       |
| 注册地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心九楼 |                       |
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心九楼 |                       |
| 法定代表人：田丹                      | 联系人：孙赵辉               |
| 电话：021-61009916               | 传真：021-61009917       |
| 客户服务电话：400-700-5566           | 公司网站：ww.cxfund.com.cn |
| <b>2、场外代销机构</b>               |                       |
| (1) 中国邮政储蓄银行有限责任公司            |                       |
| 注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号       |                       |
| 办公地址：北京市西城区金融大街 3 号金鼎大厦 6 层   |                       |
| 法定代表人：刘安东                     | 传真：010-68858116       |
| 客户服务电话：95580                  | 网址：www.psbc.com       |
| (2) 中国农业银行股份有限公司              |                       |
| 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号        |                       |
| 办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号        |                       |
| 法定代表人：项俊波                     | 联系人：滕涛                |
| 电话：010-85108229               | 传真：010-85109219       |
| 客户服务电话：95599                  | 网址：www.abchina.com    |
| (3) 中国建设银行股份有限公司              |                       |
| 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号          |                       |
| 办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼    |                       |
| 法定代表人：郭树清                     |                       |
| 客户服务电话：95533                  | 联系人：张静                |
| 传真：010-66275654               | 网址：www.ccb.com        |
| (4) 交通银行股份有限公司                |                       |
| 注册地址：上海市银城中路 188 号            |                       |
| 办公地址：上海市银城中路 188 号            |                       |
| 法定代表人：胡怀邦                     | 联系人：曹榕                |
| 电话：021-58781234               | 传真：021-58408483       |
| 客户服务电话：95559                  | 网址：www.bankcomm.com   |
| (5) 招商银行股份有限公司                |                       |
| 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦     |                       |
| 办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦     |                       |

|  |                       |
|--|-----------------------|
| 法定代表人：秦晓                                   | 联系人：邓炯鹏               |
| 电话：0755-83198888                           | 传真：0755-83195109      |
| 客户服务电话：95555                               | 网址：www.cmbchina.com   |
|  |                       |
| (6) 上海浦东发展银行股份有限公司                         |                       |
| 注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号                     |                       |
| 办公地址：上海市中山东一路 12 号                         |                       |
| 法定代表人：吉晓辉                                  | 联系人：徐伟、虞谷云            |
| 电话：021-61618888                            | 传真：021-63604199       |
| 客户服务电话：95528                               | 网址：www.spdb.com.cn    |
|  |                       |
| (7) 兴业银行股份有限公司                             |                       |
| 注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦                      |                       |
| 办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦                      |                       |
| 法定代表人：高建平                                  | 联系人：曾鸣                |
| 电话：0591-87839338                           | 传真：0591-87841932      |
| 客户服务电话：95561                               | 网址：www.cib.com.cn     |
|  |                       |
| (8) 中国民生银行股份有限公司                           |                       |
| 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号                      |                       |
| 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号                      |                       |
| 法定代表人：董文标                                  | 联系人：董云巍、吴海鹏           |
| 电话：010-58351666                            | 传真：010-83914283       |
| 客户服务电话：95568                               | 网址：www.cmbc.com.cn    |
|  |                       |
| (9) 中信银行股份有限公司                             |                       |
| 注册地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座               |                       |
| 办公地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座               |                       |
| 法定代表人：孔丹                                   |                       |
| 电话：010-65557083                            | 联系人：丰靖                |
| 客户服务电话：95558                               | 公司网址：bank.ecitic.com  |
|  |                       |
| (10) 安信证券股份有限公司                            |                       |
| 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |                       |
| 办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 |                       |
| 法定代表人：牛冠兴                                  | 联系人：俞江                |
| 电话：0755-82558305                           | 传真：0755-28558355      |
| 客户服务电话：4008-001-001                        | 网址：www.essence.com.cn |
|  |                       |
| (11) 长江证券股份有限公司                            |                       |
| 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦                     |                       |
| 办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦                     |                       |
| 法定代表人：胡运钊                                  | 联系人：李良                |
| 电话：027-65799999                            | 传真：027-85481900       |

|                                     |                      |                  |
|-------------------------------------|----------------------|------------------|
| 客户服务电话：95579 或 4008-888-999         |                      | 网址：www.95579.com |
|                                     |                      |                  |
| (12) 大通证券股份有限公司                     |                      |                  |
| 注册地址：辽宁省大连市中山区人民路 24 号              |                      |                  |
| 办公地址：辽宁省大连市中山区延安路 1 号保嘉大厦 15-16 层   |                      |                  |
| 法定代表人：于宏民                           | 联系人：谢立军              |                  |
| 电话：0411-39673202                    | 传真：0411-39673219     |                  |
| 客户服务电话：4008-169-169                 | 网址：www.daton.com.cn  |                  |
|                                     |                      |                  |
| (13) 德邦证券有限责任公司                     |                      |                  |
| 注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼         |                      |                  |
| 办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼        |                      |                  |
| 法定代表人：方加春                           | 联系人：罗芳               |                  |
| 电话：021-68761616                     | 传真：021-68767981      |                  |
| 客户服务电话：400-8888-128                 | 网址：www.tebon.com.cn  |                  |
|                                     |                      |                  |
| (14) 东方证券股份有限公司                     |                      |                  |
| 注册地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 层 |                      |                  |
| 办公地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 层 |                      |                  |
| 法定代表人：潘鑫军                           | 联系人：吴宇               |                  |
| 电话：021-63325888                     | 传真：021-63326786      |                  |
| 客户服务电话：95503                        | 网址：www.dfzq.com.cn   |                  |
|                                     |                      |                  |
| (15) 东吴证券股份有限公司                     |                      |                  |
| 注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦            |                      |                  |
| 办公地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦            |                      |                  |
| 法定代表人：吴永敏                           | 联系人：方晓丹              |                  |
| 电话：0512-65581136                    | 传真：0512-65588021     |                  |
| 客户服务电话：0512-33396288                | 网址：www.dwzq.com.cn   |                  |
|                                     |                      |                  |
| (16) 光大证券股份有限公司                     |                      |                  |
| 注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号               |                      |                  |
| 办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号               |                      |                  |
| 法定代表人：徐浩明                           | 联系人：刘晨、李芳芳           |                  |
| 电话：021-22169999                     | 传真：021-22169134      |                  |
| 客户服务电话：4008888788、10108998          | 网址：www.ebscn.com     |                  |
|                                     |                      |                  |
| (17) 广发华福证券有限责任公司                   |                      |                  |
| 注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层        |                      |                  |
| 办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层     |                      |                  |
| 法定代表人：黄金琳                           | 联系人：张腾               |                  |
| 电话：0591-87841160                    | 传真：0591-87841150     |                  |
| 客户服务电话：0591-96326                   | 网址：www.gfhfzq.com.cn |                  |
|                                     |                      |                  |

|                                |                      |
|--------------------------------|----------------------|
| (18) 国都证券有限责任公司                |                      |
| 注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9楼10层 |                      |
| 办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9楼10层 |                      |
| 法定代表人：常喆                       | 联系人：黄静               |
| 电话：010-84183389                | 传真：010-84183311-3389 |
| 客户服务电话：400-818-8118            | 网址：www.guodu.com     |
| (19) 国金证券股份有限公司                |                      |
| 注册地址：成都市东城根上街95号               |                      |
| 办公地址：成都市东城根上街95号               |                      |
| 法定代表人：冉云                       | 联系人：金喆               |
| 电话：028-86690126                | 传真：028-86690126      |
| 客户服务电话：4006600109              | 网址：www.gjzq.com.cn   |
| (20) 国联证券股份有限公司                |                      |
| 注册地址：江苏省无锡市县前东街168号            |                      |
| 办公地址：江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6-8楼    |                      |
| 法定代表人：雷建辉                      | 联系人：徐欣               |
| 电话：0510-82831662               | 传真：0510-82830162     |
| 客户服务电话：4008885288              | 网址：www.glsc.com.cn   |
| (21) 国泰君安证券股份有限公司              |                      |
| 注册地址：上海市浦东新区商城路618号            |                      |
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼  |                      |
| 法人代表人：祝幼一                      | 联系人：芮敏祺              |
| 电话：021-38676666                | 传真：021-38670666      |
| 客户服务热线：4008888666              | 网址：www.gtja.com      |
| (22) 海通证券股份有限公司                |                      |
| 注册地址：上海市淮海中路98号                |                      |
| 办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦          |                      |
| 法定代表人：王开国                      | 联系人：李笑鸣              |
| 电话：021-23219000                | 传真：021-23219100      |
| 客户服务电话：400-8888-001 或 95553    | 网址：www.htsec.com     |
| (23) 宏源证券股份有限公司                |                      |
| 注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦        |                      |
| 办公地址：北京市西城区太平桥大街19号宏源证券        |                      |
| 法定代表人：冯戎                       | 联系人：李巍               |
| 电话：010-88085858                | 传真：010-88085195      |
| 客户服务电话：4008-000-562            | 网址：www.hysec.com     |
| (24) 华安证券有限责任公司                |                      |
| 注册地址：安徽省合肥市长江中路357号            |                      |

|  |                      |
|--|----------------------|
| 办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24-32 层                   |                      |
| 法定代表人：李工   | 联系人：甘霖               |
| 电话：0551-5161666  | 传真：0551-5161600      |
| 客户服务电话：96518、400-80-96518                              | 网址：www.hazq.com      |
|  |                      |
| (25) 华宝证券有限责任公司  |                      |
| 注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层                         |                      |
| 办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层                         |                      |
| 法定代表人：陈林   | 联系人：陈康菲              |
| 电话：021-50122222  | 传真：021-50122218      |
| 客户服务电话：400-820-9898                                    | 网址：www.cnhbstock.com |
|  |                      |
| (26) 华龙证券有限责任公司  |                      |
| 注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号                                   |                      |
| 办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号                                   |                      |
| 法定代表人：李晓安  | 联系人：李昕田              |
| 电话：0931-4890100  | 传真：0931-4890118      |
| 客户服务电话：0931-8730264                                    | 网址：www.hlzqgs.com    |
|  |                      |
| (27) 华泰联合证券有限责任公司                                      |                      |
| 注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层                            |                      |
| 办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层 |                      |
| 法定代表人：马昭明  | 联系人：盛宗凌、庞晓芸          |
| 电话：0755-82492000                                       | 传真：0755-82492962     |
| 客户服务电话：95513   | 网址：www.lhzq.com      |
|  |                      |
| (28) 华泰证券股份有限公司  |                      |
| 注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦                                |                      |
| 办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦                                |                      |
| 法定代表人：吴万善  | 联系人：樊昊               |
| 电话：0086-25-84457777                                    | 传真：0086-25-84579763  |
| 客户服务电话：95597   | 网址：www.htsc.com.cn   |
|  |                      |
| (29) 江海证券有限公司  |                      |
| 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号                               |                      |
| 办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号                               |                      |
| 法定代表人：孙名扬  | 联系人：徐世旺              |
| 电话：0451-82336863                                       | 传真：0451-82287211     |
| 客户服务电话：400-666-2288                                    | 网址：www.jhzq.com.cn   |
|  |                      |
| (30) 中航证券有限公司  |                      |
| 注册地址：南昌市抚河北路 291 号                                     |                      |
| 办公地址：南昌市抚河北路 291 号                                     |                      |
| 法定代表人：杜航   | 联系人：余雅娜              |

|                                     |                    |
|-------------------------------------|--------------------|
| 电话：0791-6768763                     | 传真：0791-6789414    |
| 客户服务电话：400-8866-567                 | 网址：www.avicsec.com |
| (31) 齐鲁证券有限公司                       |                    |
| 注册地址：山东省济南市经十路 20518 号              |                    |
| 办公地址：山东省济南市经十路 20518 号              |                    |
| 法定代表人：李玮                            | 联系人：吴阳             |
| 电话：0531-81283938                    | 传真：0531-81283900   |
| 客户服务电话：95538                        | 网址：www.qlzq.com.cn |
| (32) 上海证券有限责任公司                     |                    |
| 注册地址：上海市西藏中路 336 号上海证券              |                    |
| 办公地址：上海市西藏中路 336 号                  |                    |
| 法定代表人：郁忠民                           | 联系人：张瑾             |
| 电话：021-53519888                     | 传真：021-53519888    |
| 客户服务电话：4008918918、021-962518        | 网址：www.962518.com  |
| (33) 天风证券有限责任公司                     |                    |
| 注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼 |                    |
| 办公地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼 |                    |
| 法定代表人：余磊                            | 联系人：翟璟             |
| 电话：027-87618882                     | 传真：027-87618863    |
| 客服电话：028-86711410                   | 网址：www.tfzq.com    |
| (34) 天相投资顾问有限公司                     |                    |
| 注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701     |                    |
| 办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层      |                    |
| 法定代表人：林义相                           | 联系人：潘鸿             |
| 电话：010-66045446                     | 传真：010-66045500    |
| 客户服务电话：010-66045678                 | 网址：www.txsec.com   |
| (35) 天源证券经纪有限公司                     |                    |
| 注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼           |                    |
| 办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼           |                    |
| 法定代表人：裴东平                           | 联系人：关键             |
| 电话：0755-33331188-8101               | 传真：0755-33329815   |
| 客户服务电话：400-65432-18                 | 网址：www.tyzq.com.cn |
| (36) 西藏同信证券有限责任公司                   |                    |
| 注册地址：拉萨市北京中路 101 号                  |                    |
| 办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号         |                    |
| 法定代表人：贾绍君                           | 联系人：王伟光            |
| 电话：021-36533016                     | 传真：021-36533017    |
| 客户服务电话：400-8811-177                 | 网址：www.xzsec.com   |

|  |                           |
|--|---------------------------|
| (37) 湘财证券有限责任公司                        |                           |
| 注册地址: 长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼          |                           |
| 办公地址: 上海银城中路 188 号交银金融大厦               |                           |
| 法定代表人: 陈学荣                             | 联系人: 杜颖灏                  |
| 电话: 021-68634518                       | 传真: 021-68865938          |
| 客户服务电话: 400-888-1551                   | 网址: www.xcsc.com          |
| (38) 兴业证券股份有限公司                        |                           |
| 注册地址: 福州市湖东路 268 号                     |                           |
| 办公地址: 浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层 |                           |
| 法定代表人: 兰荣                              | 联系人: 谢高得                  |
| 电话: 021-38565785                       |                           |
| 客户服务电话: 400-8888-123                   | 网址: www.xyzq.com.cn       |
| (39) 招商证券股份有限公司                        |                           |
| 注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层            |                           |
| 办公地址: 广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层         |                           |
| 法定代表人: 宫少林                             | 联系人: 林生迎                  |
| 电话: 0755-82960223                      | 传真: 0755-82943121         |
| 客户服务电话: 95565 或 400-8888-111           | 网址: www.newone.com.cn     |
| (40) 中国民族证券有限责任公司                      |                           |
| 注册地址: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层      |                           |
| 办公地址: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层      |                           |
| 法定代表人: 赵大建                             | 联系人: 姜建平                  |
| 电话: 010-59355543                       | 传真: 010-66553791          |
| 客户服务电话: 40088-95618                    | 网址: www.e5618.com         |
| (41) 中国银河证券有限责任公司                      |                           |
| 注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座        |                           |
| 办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座        |                           |
| 法定代表人: 顾伟国                             | 联系人: 田薇                   |
| 电话: 010-66568888                       | 传真: 010-66568536          |
| 客户服务电话: 4008-888-888                   | 网址: www.chinastock.com.cn |
| (42) 中信建投证券有限责任公司                      |                           |
| 注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼              |                           |
| 办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号                 |                           |
| 法定代表人: 张佑君                             | 联系人: 权唐                   |
| 电话: 010-85130588                       | 传真: 010-65182261          |
| 客户服务电话: 400-8888-108                   | 网址: www.csc108.com        |
| <b>3、场内销售机构</b>                        |                           |



场内代销机构是指有资格的上交所会员，名单详见上海证券交易所网站：  
[http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg\\_szjtt.jsp](http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjtt.jsp)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

## （二）与本基金有关的注册登记机构、律师事务所、会计师事务所信息：

| 信息类型  | 注册登记机构                  | 律师事务所                      | 会计师事务所                   |
|-------|-------------------------|----------------------------|--------------------------|
| 名称    | 中国证券登记结算有限责任公司          | 上海源泰律师事务所                  | 毕马威华振会计师事务所              |
| 注册地址  | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层 | 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室 | 北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层  |
| 办公地址  | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层 | 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室 | 上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼   |
| 法定代表人 | 陈耀先                     | 廖海（负责人）                    | 萧伟强                      |
| 联系电话  | 010-58598839            | 021-51150298               | 021-22122888             |
| 传真    | 010-58598907            | 021-51150398               | 021-62881889             |
| 联系人   | 朱立元                     | 廖海、吴军娥（已离职）                | 彭成初<br>（黄小熠、王国蓓为经办注册会计师） |

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定募集，基金募集申请于 2005 年 10 月 11 日经中国证监会证监基金字[2005]168 号文核准。

本基金募集期为 2006 年 3 月 27 日至 2006 年 4 月 25 日。经会计师事务所验资，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，基金募集期共募集 613,254,516.24 份基金份额，有效认购户数为 6,606 户。

## 七、基金合同的生效

(一) 根据《基金法》、《运作办法》和基金合同的有关规定, 本基金符合基金合同生效的条件, 本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续, 并于 2006 年 4 月 30 日获得证监会书面确认, 基金合同从即日起生效。自基金合同生效之日起, 本基金管理人正式开始管理本基金。

### (二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

在基金的存续期间内, 本基金的基金份额持有人数量不满 200 人, 或基金资产净值低于人民币 5000 万元, 基金管理人应当及时向中国证监会报告; 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提出解决方案。存续期间内, 本基金的基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人, 或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元, 基金管理人有权宣布基金合同终止。法律法规另有规定的, 从其规定办理。

## 八、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购和赎回的场所

1、基金管理人的直销网点；

2、不通过上海证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外基金销售机构，详见前文第五“相关服务机构”之“代销机构”的详细内容。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告；

3、通过上海证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的会员单位。

投资者可通过上述场所按照规定的方式进行申购或赎回。本基金管理人可根据情况增减销售机构，并予以公告。

4、投资者也可通过本基金管理人或者指定基金销售代理人提供的其他方式（例如：电话、传真或网上交易）办理基金的申购与赎回。

5、投资者还可登陆本公司网站（[www.cxfund.com.cn](http://www.cxfund.com.cn)），在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后，通过本公司网上交易系统办理开户、申购等业务（目前本公司仅对个人投资者开通网上交易服务）。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资者办理基金申购和赎回等业务的证券交易所交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应对投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日3个工作日前在至少一种证监会指定的媒体上公告。

2、申购的开始时间及业务办理时间

本基金合同生效后不超过3个月时间内开始办理申购。具体业务办理时间在开放申购公告中规定。

3、赎回的开始时间及业务办理时间

本基金合同生效后不超过3个月时间内开始办理赎回。具体业务办理时间在开

放赎回公告中规定。

4、在确定申购开始时间和赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （三）申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

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、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者申（认）购的先后次序进行顺序赎回；

4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （四）申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

本基金的申购和赎回采取书面形式、电话、或管理人同意的其他交易形式。基金投资者必须按销售机构规定的手续向基金管理人提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资者申请赎回时，其在销售机构必须有足够的基金份额余额。

#### 2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购和赎回的成交情况。

#### 3、申购和赎回的款项支付

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，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

## （五）申购和赎回的数额约定

1、代销网点每次申购本基金的最低金额为 1,000 元（如选择前端收费模式含申购费）。

直销网点首次申购本基金的最低金额为 10 万元（如选择前端收费模式含申购费），追加申购的最低金额为 1,000 元。已在直销网点有该基金认购记录的投资人不受首次申购最低金额的限制。在本公司网上交易系统可接受个人投资者单笔申购金额在 1,000 元人民币以上（含 1,000 元）的申购申请（如选择前端收费模式含申购费）。具体申购限额以投资者指定结算机构的规定为准。

代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。

投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 1.00 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1.00 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、申购份额及余额的处理方式：场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支；场内申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，保留到整数位，剩余部分折回金额返回投资者。

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

6、基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

## （六）申购费率和赎回费率

1、申购费

(1) 投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

(2) 投资者选择交纳前端申购费用时，采用外扣法计算。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

| 申购金额 (M, 含申购费)    | 前端申购费率 |
|-------------------|--------|
| M < 100 万元        | 1.5%   |
| 100 万 ≤ M < 500 万 | 1.0%   |
| M ≥ 500 万         | 1000 元 |

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

(3) 投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率按持有时间递减，具体费率如下：

| 持有时间 (N, 年)   | 后端申购费率 |
|---------------|--------|
| N < 1 年       | 1.5%   |
| 1 年 ≤ N < 3 年 | 1.2%   |
| 3 年 ≤ N < 5 年 | 0.8%   |
| N ≥ 5 年       | 0      |

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额，不再收取后端申购费用。

## 2、赎回费

本基金根据投资者认（申）购方式采用不同的赎回费率。

投资者选择交纳前端认（申）购费用时，适用固定的赎回费率，定为 0.5%。

投资者选择交纳后端认（申）购费用时，适用变动的赎回费率。赎回费率按持有时间递减，具体费率如下：

| 持有时间          | 赎回费率  |
|---------------|-------|
| N ≤ 2 年       | 0.5%  |
| 2 年 < N ≤ 3 年 | 0.25% |
| N > 3 年       | 0     |

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可决定实际执行的申购、赎回费率和收费模式，并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率和收费模式时，应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

4、本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时，将在开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

## (七) 赎回费的归属

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，扣除注册登记费和其他手续费后的余额为赎回费总额的 25%，归入基金财产。

## （八）申购份额和赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算公式

#### （1）前端收费模式

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例 1：某投资者投资 10,000 元申购长信金利趋势基金，假设申购当日基金份额净值为 2.5600 元，对应的申购费率为 1.5%，则可得到的申购份额为：

| 申购金额     | 申购费率 | 净申购金额      | 申购费用     | 基金份额净值   | 申购份数       |
|----------|------|------------|----------|----------|------------|
| 10,000 元 | 1.5% | 9,852.22 元 | 147.78 元 | 2.5600 元 | 3,848.52 份 |

#### （2）后端收费模式

申购份额 = 申购金额 / T 日基金份额净值

例 2：某投资人投资 10,000 元申购长信金利趋势基金，采用后端收费模式，假定申购当日基金份额净值为 1.1 元，则其可得到的申购份额为：

| 申购金额     | 基金份额净值  | 申购份数       |
|----------|---------|------------|
| 10,000 元 | 1.100 元 | 9,090.91 份 |

（3）场外申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金财产。场内申购时，以申请当日基金份额净值为基准计算，保留到整数位，剩余部分折回金额返回投资者。计算折回金额时，因四舍五入产生的误差，归入基金财产。

### 2、赎回金额的计算

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

#### （1）前端收费模式

如果投资者在申购（认购）时选择交纳前端申购（认购）费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用



## (2) 后端收费模式

如果投资者在申购（认购）时选择交纳后端申购（认购）费用，则赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{后端申购（认购）费用} = \text{赎回份额} \times \text{申购日基金份额净值（基金份额面值）} \times \text{后端申购（认购）费率}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{后端申购（认购）费用} - \text{赎回费用}$$

例 3：某投资者赎回持有期未满足一年的长信金利趋势基金 10,000 份，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.1 元，其在申购时已交纳前端申购费用，则其赎回费用和可得到的赎回金额为：

| 赎回份额     | 赎回费率 | 赎回总额     | 赎回费用 | 赎回当日基金份额净值 | 赎回金额     |
|----------|------|----------|------|------------|----------|
| 10,000 份 | 0.5% | 11,000 元 | 55 元 | 1.100 元    | 10,945 元 |

例 4：假定某投资者申购本基金份额当日的基金份额净值为 1.1 元，该投资者选择交纳后端申购费用，并在持有期未满足一年时赎回 10,000 份，对应的赎回费率为 0.5%，对应的后端申购费率为 1.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.2 元，则其可得到的赎回金额为：

| 赎回份额     | 赎回当日基金份额净值 | 赎回总额     | 申购当日基金份额净值 | 后端申购费率 | 后端申购费用 | 赎回费率 | 赎回费用 | 赎回金额     |
|----------|------------|----------|------------|--------|--------|------|------|----------|
| 10,000 份 | 1.200 元    | 12,000 元 | 1.100 元    | 1.5%   | 165 元  | 0.5% | 60 元 | 11,775 元 |

(3) 赎回金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金财产。

### 3、基金份额净值的计算公式为：

$$\text{基金份额净值} = \text{基金资产净值总额} / \text{发行在外的基金份额总数}$$

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

## (九) 申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金。

投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### **(十) 拒绝或暂停申购的情形及处理方式**

除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
- (2) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金净值；
- (3) 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，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- (5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述 (1) 至 (4) 项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种证监会指定的媒体上刊登暂停申购公告。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在至少一种证监会指定的媒体上刊登暂停申购公告。

### **(十一) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式**

本基金必须保持足够的现金或者到期日在一年内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。除出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- (3) 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；
- (4) 法律法规、本基金合同规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分按每个赎回

申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时在出现上述第（3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在至少一种证监会指定的媒体上公告。投资者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。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

## （十二）巨额赎回的认定及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金在单个开放日内，基金净赎回申请（赎回申请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）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

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

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的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基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。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；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售代理人的网点刊登公告，或以邮寄、传真等方式通知基金份额持有人，并说明有关处理

方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在至少一种证监会指定的媒体上公告。

### （十三）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本基金的基金份额净值。

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，基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定的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基金份额净值。

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。暂停结束基金重新开放申购和赎回时，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的媒体上连续刊登该基金重新开放申购和赎回的公告，并在重新开放申购和赎回日公告最新的基金份额净值。

### （十四）基金的转换

本公司已开通了长信金利趋势股票基金与长信利息收益货币基金、长信银利精选股票基金、长信增利动态策略股票基金、长信双利优选混合基金、长信利丰债券基金、长信恒利优势股票基金之间实现双向转换。同时实行前端收费基金和前端收费互转，前后端收费基金不得互转。

1、根据中国证监会[2009]32号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，本公司从2010年4月23日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下：

（1）投资者进行基金转换时，转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

（2）转换份额的计算公式：

### 1) 非货币基金之间转换

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值

赎回费 = 转出确认金额 × 赎回费率

补差费 = (转出确认金额 - 赎回费) × 补差费率 ÷ (1 + 补差费率)

转入确认金额 = 转出确认金额 - 赎回费 - 补差费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 转入基金份额净值

(若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时, 补差费为零)

### 2) 货币基金转至非货币基金

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值 + 转出份额对应的未结转收益

补差费 = 转出份额 × 转出基金份额净值 × 补差费率 ÷ (1 + 补差费率)

转入确认金额 = 转出确认金额 - 补差费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 转入基金份额净值

(货币基金份额净值为 1.00 元, 没有赎回费)

2、在法律法规规定的限制内, 基金管理人可决定实际执行的转换业务模式, 并在《招募说明书》中进行公告。本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时, 将在开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

## (十五) 转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。

进行份额转托管时, 投资者可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务的基金份额持有人只需在转出方办理基金份额转托管手续。对于有效的转托管申请, 转出的基金份额将于 T+1 转入其指定的交易账户, 投资者可于 T+2 日起对该部分基金份额进行正常交易。具体办理方法参照《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》的有关规定以及基金销售代理人的业务规则。

## (十六) 定期定额投资计划

定期定额投资计划是指投资者通过有关销售机构提出申请, 约定每期扣款日、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者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

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资者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。

### （十七）基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、司法执行等情况下的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他社会团体；“遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；“自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金份额因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金份额划转至另一方名下；“分家析产”指原属家庭共有（如父子共有、兄弟共有等）的基金份额从某一家庭成员名下划转至其他家庭成员名下的行为；“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转；“资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金份额随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；“机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金份额分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金份额分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；“企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企

业持有的基金份额直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金份额的划转；“司法执行”是指根据生效法律文书，有履行义务的当事人（基金份额持有人）将其持有的基金份额依生效法律文书之规定自动过户给其他人，或法院依据生效法律文书将有履行义务的当事人（基金份额持有人）持有的基金份额强制划转给其他人。

办理非交易过户必须提供基金注册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注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### **（十八）基金的冻结**

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化三大中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，谋求基金资产的长期稳定增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股，股票选择是基于中国趋势点分析、品质分析和持续增长分析等方面的深入分析论证。

### （二）投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中债券包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券等。

### （三）投资理念

1、选择受益于城市化、工业化和老龄化等中国趋势点的上市公司股票进行投资，促使基金资产充分分享社会经济发展的收益。

从中长期看，中国经济正处于强劲增长趋势，具有工业化、城市化和老龄化等中国趋势点，受益于中国趋势点的上市公司在未来将获得广阔的成长空间。本基金将通过深入研究来精选投资于那些受益于中国趋势点的上市公司股票以充分分享经济增长的成果。

2、中国趋势点分析、品质分析、持续增长分析是股票选择的前提。

本基金认为，从中长期看，只有受益于中国趋势点的、并具有良好品质和持续增长性的上市公司股票才具有良好的投资价值。本基金所投资的上市公司股票必须是受益于中国趋势点的、经过严格的品质分析和持续增长分析的股票。

### （四）投资策略

本基金采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判中国经济增长趋势、中国趋势点和资本市场发展趋势的基础上，深入分析研究受益于中国趋势点的持续增长的上市公司证券，以期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。

### （五）资产配置

基于中国经济增长长期向好，股票市场的发展将趋于不断规范和良好，故较高比例地投资于股票市场不仅能够很好地分享中国经济增长成果，而且能够很好地



实现投资增值。因此本基金在通常情况下将较高比例地投资于股票市场。

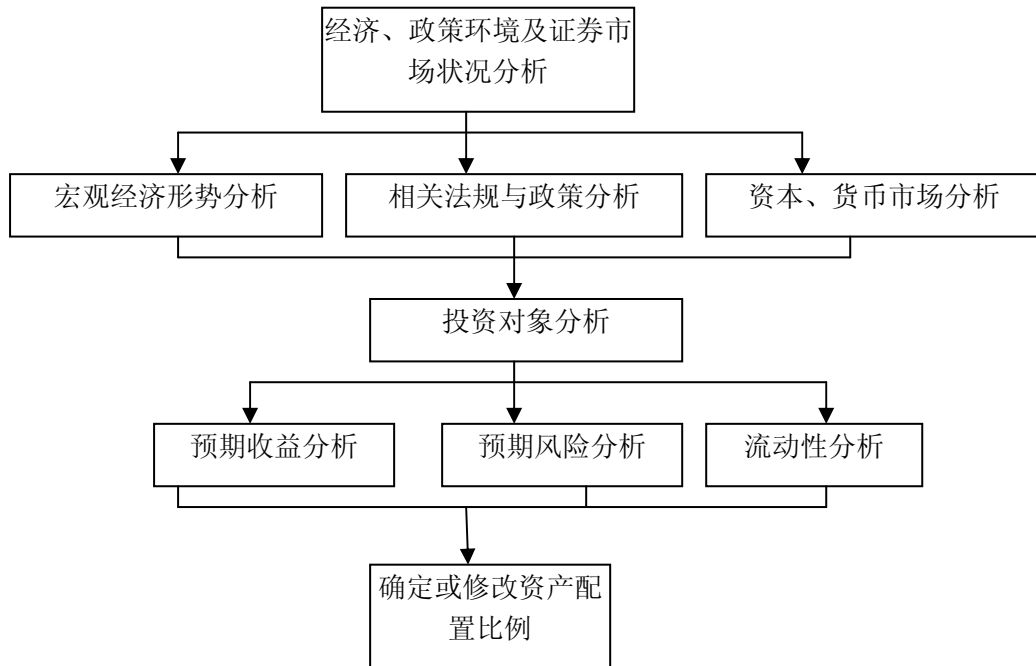
### 1、资产配置比例

本基金投资的资产类别包括股票、债券和货币市场工具。其中，股票类资产包括上市公司流通股股票和其他具有股权性质的证券；债券类资产包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券等。

本基金投资于三类资产的比例范围为：股票类资产投资比例为 60-95%，债券类资产投资比例为 0-35%，货币市场工具投资比例为 5-15%。

### 2、资产配置决策流程

在遵守各类资产比例限制的前提下，本基金通过调整股票、债券和现金的持有比例，力争在一定的风险范围内实现投资组合的收益最大化。



图：长信金利趋势基金资产配置决策流程图

### 3、股票投资组合的行业配置

本基金管理人对行业配置权重的确定或调整分三个方面进行：第一方面，分析中国趋势点、宏观经济因素、政策因素对行业发展前景和行业结构调整的影响，包括经济周期、市场需求结构、宏观经济政策和产业政策等方面影响的分析；第二方面，行业分析，分析的重点是行业的成长性、行业盈利能力、行业的二级市场表现，

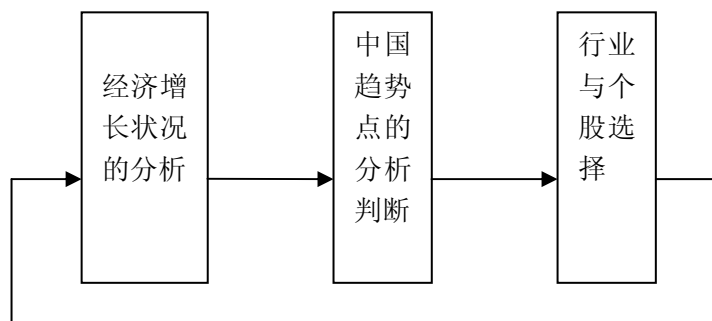
分析的指标包括行业销售增长率、行业利润增长率、行业净资产收益率、行业每股收益、行业指数相对于市场指数的超额收益率、行业市净率等；第三方面，分析研究比较基准的行业权重。在综合系统地考虑上述分析结果基础上，确定股票投资组合中的行业配置权重。

#### 4、股票选择方法

本基金的股票选择主要包括中国趋势点分析、品质分析、持续增长分析、估值分析和市场分析五方面。本基金利用中国趋势点选股模型、品质分析系统和持续增长公司评价模块对符合中国趋势点的上市公司股票进行品质分析、持续增长分析，所采用的方法为定性分析、定量分析和深入调查研究相结合的方式，充分挖掘上市公司的内在投资价值，择优买进优质的持续增长的上市公司股票。随后作进一步的估值分析和市场分析。股票选择方法主要包括以下方面：

(1) 根据中国趋势点对所有的行业和上市公司进行筛选

##### 1) 中国趋势点选股模型与方法



图：中国趋势点选股模型

资料来源：长信基金管理有限责任公司

根据中国趋势点选股模型（见图），对中国经济增长状况进行分析，进而从中长期来判断中国趋势点。

##### 2) 对当前中国趋势点的判断

中国趋势点是从中长期看受益于社会经济发展趋势的一些产业或行业，中国趋势点的分析判断需在经济增长背景分析的基础上来加以判断论证。

从中长期看，我国经济增长将处于强劲上升的趋势。本基金认为，构成未来中国经济增长的中国趋势点主要包括城市化、工业化和老龄化等。

##### 3) 中国趋势点分析

###### a、城市化趋势点

城市化是指第一产业人口不断减少，第二、三产业人口逐渐增加的过程。城市化在经济领域的体现就是各种非农产业发展的经济要素向城市集聚的过程，这不仅包括农村劳动力向城市第二、三产业的转移，还包括非农产业投资及其技术、生产能力在城市的集聚。未来中国的城市化空间将是非常大的，城市化将推动相关产业的快速发展和产业结构的升级。城市化对经济增长的影响主要表现为产业集聚、城市建设和城镇居民消费，进而受益于城市化发展的行业包括制造业、金融、交通运输、房地产、教育、商业、旅游、娱乐等。

#### b、工业化趋势点

工业化是一个伴随着人均收入增长的产业结构变迁过程，是工业部门在国民经济中的比重上升的过程。目前我国三次产业的产出结构所反映的工业化水平基本达到工业化的中、后期阶段，即工业现代化水平提高的阶段，这一阶段具有较高技术含量和技术创新的工业企业发展最为强劲并具有竞争优势，受益于这一增长点的行业主要包括电子及通信设备制造业、医药制造业、电气机械及器材制造和交通运输设备制造业等。

#### c、老龄化趋势点

老龄化是随着战后世界经济高速发展后而带来的社会问题。主要发达国家如美国、日本、欧洲已先后进入老龄化社会。中国已经于 1999 年步入人口老龄化社会，部分经济发达地区如上海早在 1979 年就进入老龄化社会。随着我国经济不断增长，医疗保健水平不断提高，生活质量不断改善，我国老龄化将加快发展。预计至 2050 年，65 岁以上的老龄人口比例将达到 23.32%，65 岁以上的老龄人口规模将达到 3.36 亿人。

老龄化的发展将对医疗保健和生活质量等方面提出越来越高的要求。受益于老龄化增长点的行业主要包括医药保健行业、旅游业等。

#### (2) 运用股票品质评价体系对上市公司股票进行品质分析

本基金管理人将从遵纪守法、法人治理、信息披露、财务会计、关联交易、经营管理等 6 个方面（见表 1-1）对上市公司的品质进行综合判断。

**表：上市公司品质评价标准**

| 考察内容 | 评价标准   |
|------|--|
| 遵纪守法 | 公司遵循诚信原则，守法合规经营，公司及其董事、监事、经营管理层最近一年没有受到证券监管机关、自律机构、行业主管部门或其他国家部门的处 |

|      |  |
|------|--|
|      | 罚。   |
| 法人治理 | 公司的股东大会、董事会、监事会依法独立履行职责、行使权力，不存在股东直接干涉公司经营管理或内部人控制等问题；<br>公司与股东在业务、资产、人员、机构、财务等方面基本全面分开，独立运作。  |
| 信息披露 | 公司信息披露及时、准确、完整，最近一年未出现虚假记载、误导性陈述或重大遗漏等情形，没有因违反信息披露规定或未履行报告义务受到中国证监会公开批评或证券交易所公开谴责；<br>公司披露的财务资料合规并且真实、准确、完整，能充分反映公司的财务信息，最近一年内财务会计文件不存在虚假记载。 |
| 财务会计 | 公司财务报告最近一年被会计师事务所出具无保留意见的审计报告；<br>公司及其附属公司最近一年内不存在资金、资产被实际控制及关联人严重占用的情况。   |
| 关联交易 | 公司公平对待所有股东，关联交易符合相关规定，在进行关联交易时不存在损害公司或其他股东利益的行为。   |
| 经营管理 | 公司的管理层及核心技术人员稳定，最近一年没有出现对公司的经营管理有重大负面影响的人员变化；<br>公司募集资金的投向基本遵守承诺，变更募集资金投向遵守法定程序，不存在频繁变更募集资金投向的情形；<br>注册会计师在评价报告中认为公司内部控制制度完整、合理和有效。          |

资料来源：长信基金管理有限责任公司

### (3) 持续增长分析

本基金利用持续增长公司评价模块（SGCAM）对上市公司历史持续增长性和未来预期增长性进行综合评价，以评判上市公司的持续增长性。

利用历史持续增长公司评价模型（HSGCAM）量化分析上市公司的历史持续增长性，并通过研究员的实地调研和分析预测来评估其未来增长性。

本基金认为，缺乏以良好的历史持续增长性为基础的上市公司，其未来预期增长性将面临着较大的不确定性，因此，持续增长公司是指具有良好的历史持续增长性并在未来延续持续增长趋势的上市公司。

本基金采用历史持续增长公司评价模型，利用质量、增长两类指标对上市公司的历史持续增长性进行综合评价。然后，研究员对历史持续增长性良好的上市公司股票进行实地调研和专题研究，并对未来 2-5 年的持续增长性进行明确预测，预测指标主要包括主营业务收入增长率、净利润增长率和总资产增长率等，若具备良好的未来增长性，则为持续增长公司。

### (4) 估值分析

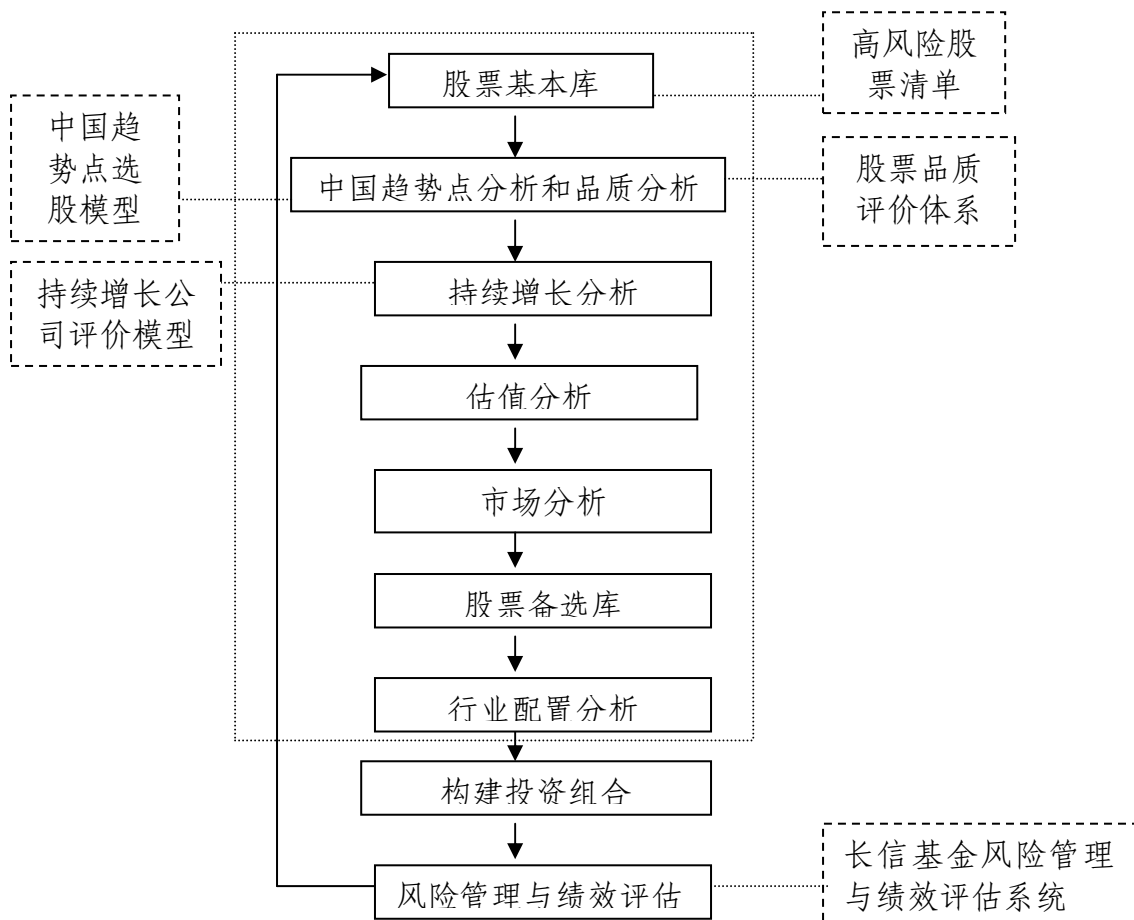
估值合理是本基金选股的核心要求。采用市净率（P/B）、动态市盈率（PEG）、动态市售率（PSG）、市现率（P/C）等估值指标并参考国际估值分析方法综合评估入选的上市公司股票，选取估值相对低的上市公司股票。

(5) 市场分析

通过对市场发展趋势和流动性的分析，选择既满足本基金资产流动性的需要又符合市场发展趋势的股票。就市场趋势而言，重点分析股票市场的市场走势、体制改革与政策调整等对股票市场走势的影响等。就流动性而言，本基金通过建立系统化和自动化的流动性风险控制体系，对个股的流动性进行分析判断，以选择流动性满足本基金要求的股票。

5、股票投资组合构建流程

本基金的股票投资组合构建流程，具体如下（见图）：



图：长信金利趋势基金股票投资组合构建流程

6、债券投资策略

为降低基金组合的系统性风险，本基金将适度投资于债券类资产。

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

(1) 个券选择策略

在个券选择上，本基金将综合运用利率预期、信用等级分析、到期收益率分析、

流动性评估等方法来评估个券的风险收益。

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金重点关注的对象：

- a. 有较高信用等级的债券；
- b. 在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，到期收益率较高的债券；
- c. 有良好流动性的债券；
- d. 风险水平合理、有较好下行保护的债券。

## （2）债券投资组合策略

在债券投资组合的构建上，本基金将在综合分析经济增长趋势和资本市场发展趋势的基础上，采用久期控制下的主动性投资策略，并本着风险收益配比最优的原则来确定债券资产的类属配置比例。

在债券投资组合的调整与管理上，本基金将综合运用久期管理、期限结构配置、跨市场套利和相对价值判断等组合管理手段进行日常管理。

## （六）投资决策依据

- 1、国家有关法律法规和本基金合同的有关规定；
- 2、宏观经济形势及前景、有关政策趋向对证券市场的影响等；
- 3、国家财政政策、货币政策、产业政策，以及利率走势、通货膨胀预期等；
- 4、股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

## （七）投资程序

本基金采取投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1、研究发展部、固定收益部提交有关宏观经济分析、投资策略、债券分析、行业分析和上市公司研究等各类报告和投资建议，为投资运作提供决策支持；

2、投资决策委员会对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等因素进行综合分析，制定本基金投资组合的资产配置比例等重大决策；

3、基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则的前提下，拟定投资方案；

4、投资决策委员会委员对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；

5、基金经理根据决策纪要构造具体的投资组合及操作方案，交由交易管理部执行；

6、金融工程部定期对基金投资组合进行绩效和风险评估，并提出风险控制意见；

7、基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理

的调整。

### **（八）投资限制**

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 3、本基金财产参与股票发行申购，基金所申报的金额不超过该基金的总资产，基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；
- 5、因基金规模、市场变化、有关法律法规或交易规则调整等原因导致投资组合超出上述规定的要求，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准；
- 6、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。

### **（九）禁止行为**

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、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

### **（十）建仓期及投资组合比例调整**

本基金的建仓期最长不超过 6 个月。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。

### **（十一）业绩评价基准**

本基金复合业绩比较基准为：

上证 A 股指数×70%+中信标普国债指数×30%。

将来如有更合适的指数推出，可考虑变更为更合适的比较基准。

## **（十二）风险收益特征**

本基金为股票型基金，属于预期收益和预期风险较高的基金品种。

## **（十三）基金管理人代表基金行使股东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股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金资产的安全与增值；

4、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。

## **（十四）基金的融资**

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。



## 十、基金的投资组合报告

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

基金托管人上海浦东发展银行根据本基金合同规定，于2010年11月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止至2010年9月30日(摘自2010年第三季度报告)，本报告中所列财务数据未经审计。

### (一) 本期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 6,464,142,065.40 | 81.88        |
|    | 其中：股票             | 6,464,142,065.40 | 81.88        |
| 2  | 固定收益投资            | 853,410,000.00   | 10.81        |
|    | 其中：债券             | 853,410,000.00   | 10.81        |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 3  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 4  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                | —            |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计      | 546,826,506.24   | 6.93         |
| 6  | 其他资产              | 30,570,167.57    | 0.39         |
| 7  | 合计                | 7,894,948,739.21 | 100.00       |

### (二) 股票投资组合

#### 1、按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | —                | —            |
| B  | 采掘业      | 446,879,933.97   | 5.69         |
| C  | 制造业      | 3,264,141,309.77 | 41.59        |
| C0 | 食品、饮料    | 912,104,443.26   | 11.62        |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | —                | —            |
| C2 | 木材、家具    | —                | —            |

|     |                |                  |       |
|-----|----------------|------------------|-------|
| C3  | 造纸、印刷          | —                | —     |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 111,232,878.53   | 1.42  |
| C5  | 电子             | —                | —     |
| C6  | 金属、非金属         | 617,242,426.55   | 7.87  |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 1,327,228,263.67 | 16.91 |
| C8  | 医药、生物制品        | 296,333,297.76   | 3.78  |
| C99 | 其他制造业          | —                | —     |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 117,426,145.44   | 1.50  |
| E   | 建筑业            | 106,488,000.00   | 1.36  |
| F   | 交通运输、仓储业       | 354,338,188.58   | 4.52  |
| G   | 信息技术业          | 187,572,855.68   | 2.39  |
| H   | 批发和零售贸易        | 278,883,982.75   | 3.55  |
| I   | 金融、保险业         | 675,667,512.66   | 8.61  |
| J   | 房地产业           | 565,677,468.20   | 7.21  |
| K   | 社会服务业          | 232,844,541.30   | 2.97  |
| L   | 传播与文化产业        | 234,222,127.05   | 2.98  |
| M   | 综合类            | —                | —     |
|     | 合计             | 6,464,142,065.40 | 82.37 |

## 2、基金投资前十名股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 000063 | 中兴通讯 | 7,349,770  | 181,171,830.50 | 2.31         |
| 2  | 000869 | 张裕 A | 1,508,703  | 181,029,272.97 | 2.31         |
| 3  | 000423 | 东阿阿胶 | 3,638,399  | 179,300,302.72 | 2.28         |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 12,433,809 | 176,311,411.62 | 2.25         |
| 5  | 000568 | 泸州老窖 | 4,699,721  | 170,552,875.09 | 2.17         |
| 6  | 002024 | 苏宁电  | 10,489,643 | 167,519,598.71 | 2.13         |

|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
|    |        | 器    |            |                |      |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 990,000    | 167,042,700.00 | 2.13 |
| 8  | 000002 | 万科A  | 19,149,939 | 160,859,487.60 | 2.05 |
| 9  | 600761 | 安徽合力 | 9,499,843  | 151,332,498.99 | 1.93 |
| 10 | 600875 | 东方电气 | 4,359,898  | 135,854,421.68 | 1.73 |

### （三）债券投资组合

#### 1、按投资品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | —              | —             |
| 2  | 央行票据      | 853,410,000.00 | 10.87         |
| 3  | 金融债券      | —              | —             |
|    | 其中：政策性金融债 | —              | —             |
| 4  | 企业债券      | —              | —             |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —             |
| 6  | 可转债       | —              | —             |
| 7  | 其他        | —              | —             |
| 8  | 合计        | 853,410,000.00 | 10.87         |

#### 2、基金投资前五名债券明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 数量 (张)    | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|---------|----------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 1001060 | 10央行票据60 | 4,000,000 | 399,560,000.00 | 5.09          |
| 2  | 0801035 | 08央行票据35 | 2,000,000 | 202,400,000.00 | 2.58          |
| 3  | 0801017 | 08央行票据17 | 1,500,000 | 151,380,000.00 | 1.93          |
| 4  | 1001042 | 10央行票据42 | 1,000,000 | 100,070,000.00 | 1.28          |

### （四）权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证。

## （五）资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## （六）报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

2、本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 3、其他资产的构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 964,388.79    |
| 2  | 应收证券清算款 | 17,211,856.04 |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 12,336,732.07 |
| 5  | 应收申购款   | 57,190.67     |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 30,570,167.57 |

### 4、处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2010年三季度及历史各时间段本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较:

| 阶段                     | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 2006年4月30日至2006年12月31日 | 39.18%  | 1.45%     | 63.79%     | 1.15%         | -24.61% | 0.30% |
| 2007年1月1日至2007年12月31日  | 151.23% | 2.12%     | 80.32%     | 1.94%         | 70.91%  | 0.18% |
| 2008年1月1日至2008年12月31日  | -58.68% | 2.47%     | -58.63%    | 2.37%         | -0.05%  | 0.10% |
| 2009年1月1日至2009年12月31日  | 65.99%  | 1.65%     | 60.98%     | 1.56%         | 5.01%   | 0.09% |
| 2010年1月1日至2010年6月30日   | -23.14% | 1.40%     | -22.43%    | 1.20%         | -0.71%  | 0.20% |
| 2010年7月1日至2010年9月30日   | 17.11%  | 1.18%     | 8.71%      | 0.96%         | 8.40%   | 0.22% |

自合同生效之日(2006年4月30日)至2010年9月30日期间,本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比:



注：1、图示日期为2006年4月30日至2010年9月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定：股票类资产占基金资产总净值比例为60-95%，债券类资产占基金资产总净值比例为0-35%，货币市场工具占基金资产总净值比例为5-15%。

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

其构成主要有：

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

### （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。

其构成主要有：

- 1、基金份额持有人申购基金份额所支付的款项；
- 2、运用基金资产所获得收益（亏损）；
- 3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和“长信金利趋势股票型开放式证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“长信金利趋势股票型开放式证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### (四) 基金财产的保管和处分

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

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

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、基金管理人、基金托管人可以按基金合同的规定，收取管理费、托管费及其他费用。

6、除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。



## 十三、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回的基础。

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、股票估值方法

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

（2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价进行估值；

④ 非公开发行有明确锁定期的股票：

如果估值日在证券交易所上市交易的同一种股票的市价低于非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本，应采用在证券交易所上市交易的同一种股票的市价作为估值日该流通受限股票的价值。

如果估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本，应按以下公式确定该流通受限股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$

其中：

FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；

C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

D1 为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值办法

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，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) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(5) 在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。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(7) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值办法

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，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) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

### **(五) 估值程序**

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《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加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### **(六) 基金份额净值的确认和估值错误的处理**

基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。当基金估值出现影响基金份额净值的错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；估值错误偏差达到或超过基金资产净值的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；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人、对外公告并报中国证监会备案。

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。本合同的当事人应将按照以下约定处理：

#### **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、或基金注册登记机构、或代理销售机构、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无法预见、无法避免、无法抗拒，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（“受损方”），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，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

(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、行政法规、《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出现过错的当事人进行追索，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原则处理差错。

### 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;

(5) 估值错误偏差达到或超过基金资产净值的 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; 错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时, 基金管理人应当通报基金托管人、对外公告并报中国证监会备案。

### **(七) 暂停估值的情形**

- 1、与本基金投资有关的证券交易场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无法准确评估基金资产价值时;
- 3、中国证监会认定的其他情形。

### **(八) 特殊情形的处理**

1、基金管理人按估值方法的第 1 (3) 项、第 2 (7) 项和第 3 (4) 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、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十四、基金收益与分配

### （一）收益的构成

本基金的收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照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、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 2、本基金每年收益分配次数最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 80%；
- 3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 4、基金投资当期出现净亏损，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；
- 7、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 8、每一基金份额享有同等分配权；
- 9、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

本基金收益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。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，在报中国证监会

备案后 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### **（六）收益分配中发生的费用**

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记人可将投资者的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照长信基金管理有限责任公司开放式基金有关业务规定执行。



## 十五、基金费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、与基金运作有关费用列示

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金合同生效后的基金信息披露费用；
- （4）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金资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。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### （1）基金管理费

本基金的管理费按该基金资产净值的 1.5% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### （2）基金托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 2.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（3）上述“1、与基金运作有关费用列示”中（3）—（7）项费用由基金托管

人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，从基金财产中支付。

### 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财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

### 4、费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## **（二）与基金销售有关的费用**

### 1、基金认购费用

基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“六、基金的募集”相应部分。

### 2、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”相应部分。

### 3、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”相应部分。

### 4、转换费用

基金转换费用的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”相应部分。

## **（三）基金税收**

本基金运作过程中的各类纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、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3个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；
- 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、本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，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案。更换会计师事务所应在2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## 十七、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》、《基金合同》及其他有关规定。

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

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

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

本基金公开披露的信息应采用中文文本。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。

### 第一、 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

1、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

基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后，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报刊上；基金管理人在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

2、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。

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。

#### （二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

#### （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

#### （四）基金资产净值、基金份额净值

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

#### （五）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报刊上。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报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，本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本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

#### （六）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 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本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、提前终止《基金合同》；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行

政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 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、中国证监会规定的其他事项。

#### （七）澄清公告

在本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、基金上市交易的证券交易所。

#### （八）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，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （九）中国证监会规定的其他信息。

## 第二、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、基金份额净值、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报刊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报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，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。

### **第三、 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、基金托管人和基金份额发售机构的住所，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，供公众查阅、复制。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。



## 十八、风险揭示

本基金是一只主动投资的股票型基金，主要投资于价值股和成长股，股票选择是基于中国趋势点分析、品质分析和持续增长分析等方面的深入分析论证。本基金已期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。

### （一）投资于长信金利趋势股票型证券投资基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业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

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

##### （5）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

3、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

4、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（即前面所提到的利率风险）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，将获得较少的收益率

#### 5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### 7、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，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。

在开放式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公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 8、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### 9、本基金的特定风险

本基金作为股票型基金，在基金投资中采取主动，通过对宏观经济的趋势点分析、上市公司的品质分析、持续增长模型分析和估值分析形成投资组合构建流程。在具体投资管理中可能会由于股票类资产配置比例较高而承担较多的系统性风险。本基金管理人在必要时将通过对宏观经济与政策的前瞻性判断，力求降低系统性风险。

#### 10、人才流失风险

公司主要业务人员的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响。

#### 11、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、行业竞争、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**

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

## 十九、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、下列涉及到《基金合同》内容变更的事项须召开基金份额持有人大会：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （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；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略；
- （7）变更基金份额持有人大会程序；
- （8）对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- （9）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他事项。

2、除非法律法规和《基金合同》另有规定，对《基金合同》的变更应当召开基金份额持有人大会的，《基金合同》变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会核准或备案。

3、依现行有效的有关法律法规，对《基金合同》的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

4、除依本《基金合同》和依现行有效的有关法律法规，对《基金合同》的变更须基金份额持有人大会决议通过和须报中国证监会核准以外的情形，经基金管理人和基金托管人同意可对《基金合同》进行变更后公布，并报中国证监会备案。

### （二）《基金合同》的终止

1、有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

### （三）基金财产的清算

## 1、基金财产清算组

(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以基金的名义进行必要的民事活动。

## 2、基金财产清算程序

(1) 基金合同终止后，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。

## 3、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。

## 4、基金财产清算剩余资产的分配

基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 5、基金财产清算的公告

基金财产清算报告在《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告；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。

## 6、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。

## 二十、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利与义务

#### (一) 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) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

##### 2、基金份额持有人的义务：

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (7) 法律法规和《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) 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》获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费、基金管理费、其他法定收入 and 法律法规允许或监管部门批准的约定收入；

(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、委托、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。如认为基金销售代理人违反本《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定和调整基金的除托管费率和调高管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

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

(16) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务：

(1) 办理基金备案手续；

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



- (3) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (4) 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；
- (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，不得利用基金资产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》规定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；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

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

(21) 基金托管人因违反《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托管人追偿;

(22) 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;

(23) 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活期存款利息在募集期结束后 30 天内退还基金认购人;

(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

(26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

(27) 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) 自本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资产;

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入;

(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,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) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户;

(5) 以基金托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立资金结算账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金的债券及资金的清算；

(7) 提议召开基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 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) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产；

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

(3) 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；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

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

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、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) 按有关规定，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

- (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) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照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中国银监会，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) 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的利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 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

### (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) 提前终止《基金合同》；
  - (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；
  - (6) 变更基金类别；
  - (7) 变更基金投资目标、范围或策略；
  - (8) 变更基金份额持有人大会程序；

(9) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；

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

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 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；

(5) 除按照法律法规和《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集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起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%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。

5、如在上述第4条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，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，并至少提前三十日报中国证监会备案。

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天，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。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、方式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；
- （4）代理投票授权委托书送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

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书委派代表出席，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。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书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利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利登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。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》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）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，拒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利登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

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

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

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。

（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、决定提前终止《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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基

基金份额持有人大会审议表决的提案。

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。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内统计全部有效表决，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所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，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，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，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。

（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。

##### 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不派代表监督计票的，不影响计票的过程及计票结果的有效性。

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金收益分配原则

1、基金收益分配比例按有关规定制定；

2、本基金每年收益分配次数最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 80%；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红

利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

4、基金投资当期出现净亏损，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，但若基金合同生效不满3个月不进行收益分配；

7、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

8、每一基金份额享有同等分配权；

9、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （二）收益分配执行方式

基金收益分配方案中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、分配方式等内容。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在报中国证监会备案后5个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金合同生效后的基金信息披露费用；

4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用；

7、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财产中扣除。

#### （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

本基金的管理费按该基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 2.5% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、上述一、基金费用的种类中 3—7 项费用由基金托管人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，从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

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

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资方向

本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化各个中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，谋求基金资产的长期稳定增值。

本基金投资的资产类别包括股票、债券和货币市场工具。其中，股票类资产包括上市公司流通股股票和其他具有股权性质的证券；债券类资产包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短期融资券、可转换债券等。

本基金投资于三类资产的比例范围为：股票类资产投资比例为 60-95%，债券类资产投资比例为 0-35%，货币市场工具投资比例为 5—15%。

## （二）投资限制

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 3、本基金财产参与股票发行申购，基金所申报的金额不超过该基金的总资产，基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；
- 5、因基金规模、市场变化、有关法律法规或交易规则调整等原因导致投资组合超出上述规定的要求，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准，法律法规或监管部门对上述期限另有规定的，从其规定。
- 6、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）基金资产净值和基金份额净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金份额净值是指开放日闭市之后基金资产净值除以当日本基金总份额。

本基金份额净值的计算以人民币元为单位，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

### （二）基金资产净值和基金份额净值的公告

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份

额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## 七、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、下列涉及到基金合同内容变更的事项须召开基金份额持有人大会：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （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；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略；
- （7）变更基金份额持有人大会程序；
- （8）对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- （9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他事项。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改对基金合同当事人权利义务关系未产生重大影响的，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

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

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

基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行清算。

### （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以基金的名义进行必要的民事活动。

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止后，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。

#### （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

基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，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

基金财产清算报告在《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组公告；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。

#### （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。

### 八、争议解决方式

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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

### 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

## 二十一、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

名称：长信基金管理有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号浦项商务广场 16 楼

邮政编码：200002

法定代表人：田丹

批准成立日期：2003 年 4 月 28 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2003]63 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1 亿元人民币

经营期限：永久存续

经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）

#### (二) 基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

邮政编码：200120

法定代表人：金运

成立日期：1992 年 10 月 19 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监基金字[2003]105 号

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：39.15 亿元人民币

经营期限：永久存续

经营范围：吸收公众存款发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发放金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；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；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；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；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；信托投资公司资金信托托管业务；保险公司投资连接产品托管业务；经中国人民银行批准的其他业务。

## 二、基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

1、基金托管人根据《基金法》、基金合同及其他有关规定，对本基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理费和基金托管费的计提和支付、基金收益分配等事项的合法、合规性进行监督和核查。其中对基金的投资比例监督和核查自基金合同生效之日起六个月后开始。

2、基金托管人发现上述事项基金管理人的行为违反《基金法》、《基金合同》及其他有关规定时，应及时以书面形式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并以书面形式给基金托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

3、基金托管人发现基金管理人存在重大违法违规行为，有权立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### （二）基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

1、根据《基金法》、《基金合同》及其它有关规定，基金管理人对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分红收益划入基金注册登记清算账户、对基金资产实行分账管理、有无擅自自动用基金资产的行为等事项进行监督和核查。

2、基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《基金合同》及其他有关规定时，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给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在

规定期限内及时改正。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，基金管理人有权报告证监会。

3、基金管理人发现基金托管人有重大违法违规行为，有权立即报告中国证监会，同时，通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### （三）基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方有权报告中国证监会。

## 三、基金财产保管

### （一）基金资产保管的原则

- 1、基金托管人应安全保管本基金的全部资产。
- 2、本基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的资产。本基金资产与基金托管人的其它资产或其它业务以及其它基金的资产实行严格的分账管理。
- 3、基金托管人未经基金管理人下达指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。
- 4、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人，由基金管理人负责催收，因基金应收资产未及时到账给基金造成的损失，基金管理人负责向有关当事人追偿。

### （二）基金成立时募集资金的验证

- 1、基金设立募集结束，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金基金资产的全部资金划入基金银行存款账户中，并确保划入的资金与验资金额相一致。

### （三）基金银行存款账户的开立和管理

- 1、经基金管理人与基金托管人协商一致后，由基金托管人负责开立基金的银行

存款账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。基金的银行存款账户印鉴由基金托管人保管和使用。

2、基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行基金业务以外的活动。

3、基金银行存款账户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他相关规定。

#### （四）基金证券账户的开立和管理

1、本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司以本基金和基金托管人联名的名义开立证券账户，该账户用于本基金证券投资的交割和存管。基金托管人负责办理证券账户的开立事宜，并对证券账户业务发生情况根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司发送数据进行如实记录。

2、基金证券账户的开立和使用，限于满足开展该基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让本基金的任何证券账户，亦不得使用本基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

1、基金合同生效后，由基金管理人负责为基金向中国证监会和中国人民银行申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据主管机关、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代基金进行银行间市场债券的结算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人负责向中国人民银行进行报备。

2、基金管理人和基金托管人按规定同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，正本由托管人保管，管理人保存副本。

#### （六）其它账户的开立和管理

1、因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据基金合同或有关法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、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。

(七) 清算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人应根据中国证券登记结算有限责任公司的有关规定，负责办理本基金资金清算的相关工作，基金管理人应予积极协助。

2、清算备付金账户按规定开立、管理和使用。

(八) 证券账户卡保管

证券账户卡由基金托管人保管原件。

(九) 基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可以存入中国证券登记结算有限责任公司及其他有权保管机构的代保管库中。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。保管费用按中国证监会及有权机关的规定执行。

(十) 与基金资产有关的重大合同的保管

基金管理人代表基金签署与基金投资有关的各类合同并及时通知基金托管人。与基金资产有关的重大合同的原件，除本协议另有规定外，由基金托管人负责保管。由于合同产生的问题，由合同签署方负责处理。

## 四、基金资产估值、基金资产净值计算和复核

(一) 基金资产估值

1、估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

2、股票估值方法

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

(2) 未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券

交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、债券估值办法：

(1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，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) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(5) 在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。

(6)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

(7)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(8)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

#### 4、权证估值办法

(1)基金持有的权证,从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)首次发行未上市的权证,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)因持有股票而享有的配股权,以及停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(5)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

5、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### 6、估值程序

本基金的日常估值由基金管理人进行。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以书面形式报送基金托管人,基金托管人按照本基金基金合同规定的估值方法、时间与程序进行复核;基金托管人复核无误后签章返回给

基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

## 7、特殊情形的处理

(1) 基金管理人按基金资产估值的第 2 (3) 项、第 3 (7) 项和第 4 (4) 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、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### (二) 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### 1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的余额。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的该基金份额总份额计算得到的每基金份额的资产净值。

每开放日计算基金资产净值及单位净值，并按规定公告。

#### 2、复核程序

基金管理人每开放日对基金资产进行估值后，将资产净值结果发送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的方法、时间、程序进行复核；经基金托管人复核无误后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

#### 3、基金份额净值的确认及错误的处理方式

基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位。国家另有规定的，从其规定。当基金份额净值小数点后四位以内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值出现错误时，基金管理人应当予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

(2) 估值错误偏差达到或超过基金资产净值的 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；

(3) 错误偏差达到基金份额净值 0.5% 时，基金管理人应当立即公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；

(4) 基金管理人和基金托管人根据有关规定进行账务处理，但计算过程有误导致净值计算错误，从而给基金或基金投资人造成损失的，基金持有者可依据有关法律、法规要求赔偿；

(5) 由于基金份额净值错误等原因导致任何人获得不当得利的，基金管理人有权追偿的权利；

(6) 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。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人委托的登记注册机构负责编制和保管本基金的基金份额持有人名册。基金合同生效日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日、每月最后一个开放日的持有人名册，由基金管理人负责编制。

基金管理人委托的登记注册机构对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

## 六、争议的处理和适用法律

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，任何一方均应将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局性的，对双方均有法律约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

## 七、托管协议的修改和终止

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会备案后生效，须经中国证监会批准的，经其批准后生效。

发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 本基金的基金合同终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其它基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其它基金管理人接管其基金管理



权；

- (4) 发生《基金法》、基金合同或其它法律法规规定的终止事项。

## 二十二、基金份额持有人服务

长信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”，或“基金管理人”，或“公司”）将为基金份额持有人提供一系列的服务，并根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要的服务内容如下：

| 基金份额持有人服务内容 |                    |           |   |
|-------------|--------------------|-----------|---|
| 序号          | 类型                 | 明细        | 内容详述  |
| (一)         | 账户服务               | 对账单服务     | 每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单；<br>每月结束后的 15 个工作日内，基金管理人向本月发生的新开户并进行基金交易的投资者以书面或电子形式寄送交易对账单；<br>每一年度结束后 15 个工作日内，基金管理人向本年度内所有持有本基金基金份额的投资者，或在本年内有交易、基金份额余额为零的投资者以书面或电子形式寄送年度交易对账单。  |
|             |                    | 其他资料      | 基金管理人将按基金份额持有人的需求不定期向其邮寄相关公司介绍和产品介绍的资料。   |
| (二)         | 查询服务               | 网络在线查询    | 客户通过基金账户号码或开户证件号码和查询密码登录基金管理人网站“账户查询”栏目，可享有账户查询、短信/邮件信息定制、资料修改、在线咨询等多项在线服务。   |
|             |                    | 交易信息查询    | 在一笔交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日开始通过销售机构的网点或登录基金管理人网站“账户查询”栏目查询交易情况，包括客户购买总金额、基金购买份额、基金分红份额、历史交易信息等等。  |
|             |                    | 客户账户信息的修改 | 基金份额持有人可以直接登录基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话、电子邮箱等等。也可以亲自到直销网点或致电客户服务专线，由人工坐席提供相关服务。<br>为了维护投资者的利益，投资者重要信息的更改手续办理如下：<br>1、代销客户由代销渠道提交办理（具体提供材料请咨询代销机构）。可以配号方式开立的开放式基金账户资料中的投资者名称、证件类型、证件号码的变更业务，在一个工作日内，对单个开放式基金账户只能修改其中一项关键信息。<br>2、直销客户：非正常变更需要提供本人身份证复印件、公安机关证明原件以及开放式基金账户业务申请表；正常变更只需要提供身份证复印件和开放式基金账户业务申请表，邮寄到公司。 |
| (三)         | 基金投资的服务<br>基金投资的服务 | 网上交易      | 投资者除可通过销售机构和基金管理人的直销网点办理申购、赎回及信息查询外，还可通过基金管理人的网站（www.cxfund.com.cn）享受网上交易服务。具体业务规则详见本公司网站说明。  |
|             |                    | 定期定额投资计划  | 通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。定期定额投资计划的有关规则和开放时间另行公告。  |
|             |                    | 定期不定额投资计划 | 通过定期不定额投资计划，投资者可以通过本公司“长金通”网上直销平台提交交易申请，约定“基金品种”、“每月扣款日”  |

|     |            |          |   |
|-----|------------|----------|---|
|     |            | 划        | 期”、“基准金额”、“标的指数”、“均线种类”、“级差”等参数，用指定的计算方法计算出投资金额，委托本公司完成交易的一种基金投资方式。   |
|     |            | 红利再投资    | 本基金收益分配时，经投资者选择，基金管理人将为持有人提供红利再投资服务，其分红资金按除息日的基金份额净值自动转成相应的基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时（权益登记日申请设置的分红方式对当次分红无效）选择更改基金分红方式。   |
| (四) | 客户服务中心电话服务 |          | 客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。<br>客户服务中心人工坐席提供每周 5 天的坐席服务，投资者可以通过该专线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。   |
| (五) | 客户投诉受理服务   | 客户投诉处理流程 | 本公司客户投诉受理由客户服务中心统一管理，指定专人负责，设定专门的投诉管理工作流程，并由监察稽核部负责督促投诉的处理情况。   |
|     |            | 客户投诉方式   | 投资者可通过本公司的客户服务专线（400-700-5566）、代销机构、公司网站（www.cxfund.com.cn）、电子邮件（service@cxfund.com.cn）、信件、传真（021-61009800-1000/1001）、各销售机构网点柜台等多种形式对本公司所提供的服务以及公司的政策规定进行投诉。客户投诉都将被定期汇总登记并存档，通过拨打客户服务专线进行的投诉将被电话录音存档，本公司将采取适当措施，及时妥善处理客户投诉，总结相关问题，完善内控制度。 |
| (六) | 增值服务       | 信息定制服务   | 基金份额持有人可以在基金管理人网站或致电客户服务专线定制自己所需要的信息，包括产品净值、交易确认、分红公告、公司新闻、基金信息等方面的内容。基金管理人按照要求，将以手机短信或者电子邮件的方式定期向投资者发送信息，  |
|     |            | 个性化理财服务  | 随着公司的发展，本公司将酌情为基金份额持有人提供个性化理财服务，如配备理财顾问为基金份额持有人提供理财建议以及相关的理财计划等形式。  |
|     |            | 组织投资者交流会 | 本公司将不定期地举行投资者交流会，为基金份额持有人提供基金、投资、理财等方面的讲座，使得本公司基金份额持有人能得到更多的理财信息和其他增值服务。另外，本公司基金经理也将通过多种方式不定期地与基金份额持有人交流，让基金份额持有人了解更多基金运作情况。  |
| (七) | 投资者教育服务    |          | 为了进一步做好投资者服务，让投资者了解证券市场和各类证券投资品种的特点和风险，熟悉证券市场的法律法规，树立正确的投资理念，增强风险防范意识，依法维护自身合法权益，本公司将开展普及证券知识、宣传政策法规、揭示市场风险、引导依法维权等投资者教育活动。   |
| (八) | 公开信息披露服务   | 披露公司信息   | 为方便社会公众了解公司的信息，包括本公司的发展概况、组织结构、公司文化、经营理念、经营管理层、经营情况等公开信息，本公司开通了全国统一的客户服务专线 400-700-5566（免长话费）和公司网站（www.cxfund.com.cn），以方便投资者查询。   |
|     |            | 披露基金信息   | 本公司将按规定在中国证监会指定的信息披露媒体上披露法定的文件、公告信息。<br>本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构及相关基金   |

|     |                            |         |  |
|-----|----------------------------|---------|--|
|     |                            |         | 宣传资料来披露本基金相关信息，包括本基金的概况、投资理念、投资对象、风险收益特征、净值及其变化情况、基金经理介绍等多方面的信息。       |
|     |                            | 其他信息的披露 | 本公司客户服务中心和网站除为投资者提供上述信息咨询外，还提供其他信息咨询，包括托管人的情况、基金知识、市场新闻和行情、产品信息等多方面内容。 |
| (九) | 客<br>服<br>联<br>络<br>方<br>式 | 客户服务专线  | 4007005566（免长话费）、工作时间（8：30-17：00）内可转人工座席。                              |
|     |                            | 传真      | 021-61009800-1000/1001   |
|     |                            | 公司网址    | <a href="http://www.cxfund.com.cn">http://www.cxfund.com.cn</a>        |
|     |                            | 电子信箱    | <a href="mailto:service@cxfund.com.cn">service@cxfund.com.cn</a>       |

## 二十三、其他应披露事项

|    | 公告时间      | 公告内容   |
|----|-----------|--|
| 1  | 2010-4-2  | 长信基金管理有限责任公司关于参加东方证券股份有限公司基金网上、电话、手机委托交易费率优惠活动的公告      |
| 2  | 2010-4-7  | 长信基金管理有限责任公司关于调整旗下基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告             |
| 3  | 2010-4-13 | 长信基金管理有限责任公司关于在兴业证券开通基金定期定额投资业务以及部分基金参加费率优惠活动的公告       |
| 4  | 2010-4-13 | 长信基金管理有限责任公司关于开通旗下基金定投业务的公告                            |
| 5  | 2010-4-17 | 长信基金管理有限责任公司关于调整旗下基金转换业务规则的公告                          |
| 6  | 2010-4-21 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告                   |
| 7  | 2010-4-22 | 长信金利趋势股票型证券投资基金 2010 年第一季度报告                           |
| 8  | 2010-4-24 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中信建投证券网上费率优惠及定期定额投资业务费率优惠活动的公告     |
| 9  | 2010-5-6  | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告                |
| 10 | 2010-5-12 | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告                   |
| 11 | 2010-5-27 | 长信基金管理有限责任公司关于增加华安证券为旗下基金代销机构并开通旗下基金定期定额投资业务的公告        |
| 12 | 2010-5-29 | 长信基金管理有限责任公司关于参加中信银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告              |
| 13 | 2010-6-1  | 长信基金管理有限责任公司关于增加天源证券为旗下基金代销机构的公告                       |
| 14 | 2010-6-2  | 长信基金管理有限责任公司关于参加中国农业银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告            |
| 15 | 2010-6-12 | 长信金利趋势股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要                              |
| 16 | 2010-6-12 | 长信金利趋势股票型证券投资基金更新的招募说明书                                |
| 17 | 2010-6-28 | 长信基金管理有限责任公司关于参加交通银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告              |
| 18 | 2010-6-28 | 长信基金管理有限责任公司关于增聘付勇为长信金利趋势证券投资基金基金经理的公告                 |
| 19 | 2010-6-30 | 长信基金管理有限责任公司关于参加上海浦东发展银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告              |
| 20 | 2010-6-30 | 长信基金管理有限责任公司关于参加中国邮政储蓄银行有限责任公司基金网上申购费率优惠活动的公告          |
| 21 | 2010-7-1  | 长信基金管理有限责任公司 2010 年 6 月 30 日旗下基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值公告 |
| 22 | 2010-7-2  | 长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告                   |
| 23 | 2010-7-17 | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告                |

|                                      |            |  |
|--------------------------------------|------------|--|
| 24                                   | 2010-7-20  | 长信金利趋势股票型证券投资基金二〇一〇年第二季度报告                             |
| 25                                   | 2010-7-27  | 长信基金管理有限责任公司关于在天源证券经纪有限公司开通旗下基金定期定额投资业务的公告             |
| 26                                   | 2010-8-24  | 《长信金利趋势股票型证券投资基金 2010 年半年度报告》及摘要                       |
| 27                                   | 2010-8-28  | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加齐鲁证券网上交易系统申购费率优惠及定期定额投资业务费率优惠活动的公告 |
| 28                                   | 2010-8-30  | 长信基金管理有限责任公司关于参加中国农业银行股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告            |
| 29                                   | 2010-8-28  | 长信基金管理有限责任公司关于增加天风证券为旗下基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告            |
| 30                                   | 2010-8-31  | 长信基金管理有限责任公司关于增加华泰证券为旗下基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告            |
| 31                                   | 2010-9-2   | 长信基金管理有限责任公司关于参加国泰君安证券股份有限公司基金网上申购费率优惠活动的公告            |
| 32                                   | 2010-9-3   | 长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票恢复市价估值方法的提示性公告                |
| 33                                   | 2010-9-8   | 长信基金管理有限责任公司关于增加国联证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告    |
| 34                                   | 2010-9-9   | 长信基金管理有限责任公司关于“长金通”网上直销开通定期不定额申购、定期不定额转换的公告            |
| 35                                   | 2010-9-18  | 长信基金管理有限责任公司关于调整中国农业银行金穗借记卡基金网上直销申购优惠费率的公告             |
| 36                                   | 2010-10-20 | 长信基金管理有限责任公司关于在长江证券开通定期定额投资业务的公告                       |
| 37                                   | 2010-10-26 | 长信金利趋势股票型证券投资基金 2010 年第三季度报告                           |
| <b>本信息披露事项截止时间为 2010 年 10 月 30 日</b> |            |  |

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅。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。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

本基金备查文件包括：

- （一）中国证监会批准长信金利趋势股票型证券投资基金募集的文件；
- （二）《长信金利趋势股票型证券投资基金基金合同》；
- （三）《长信金利趋势股票型证券投资基金托管协议》；
- （四）法律意见书；
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （七）基金销售代理人业务资格批件和营业执照；
- （八）《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》；
- （九）中国证监会要求的其他文件。

长信基金管理有限责任公司

2010年12月14日