

长信金利趋势混合型证券投资基金  
更新的招募说明书  
2019年第【1】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

二〇一九年六月

## 重要提示

长信金利趋势混合型证券投资基金（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。

2015年8月7日起本基金更名为长信金利趋势混合型证券投资基金，本基金业绩比较基准变更为： $\text{上证A股指数} \times 70\% + \text{中证综合债指数} \times 30\%$ ，关于更名及变更业绩比较基准的事宜，我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2019年4月30日，有关财务数据和净值表现截止至2019年3月31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 .....	19
五、相关服务机构 .....	26
六、基金的募集 .....	41
七、基金合同的生效 .....	42
八、基金份额的申购、赎回与转换 .....	43
九、基金的投资 .....	58
十、基金的投资组合报告 .....	69
十一、基金的业绩 .....	74
十二、基金的财产 .....	76
十三、基金资产的估值 .....	78
十四、基金收益与分配 .....	84
十五、基金费用与税收 .....	86
十六、基金的会计与审计 .....	89
十七、基金的信息披露 .....	90
十八、风险揭示 .....	96
十九、基金合同的变更、终止和基金财产的清算 .....	100
二十、基金合同的内容摘要 .....	103
二十一、基金托管协议的内容摘要 .....	122
二十二、基金份额持有人服务 .....	133
二十三、其他应披露事项 .....	136
二十四、招募说明书存放及查阅方式 .....	138
二十五、备查文件 .....	139

## 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》）、《公开募集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》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《长信金利趋势混合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混合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《长信金利趋势混合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》
《流动性风险规定》	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
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混合型证券投资基金
招募说明书	指《长信金利趋势混合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暂行办法》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
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券，因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 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	壹亿陆仟伍佰万元人民币		
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	成善栋		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	魏明东		
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。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】		
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	44.55%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5 万元	31.21%
	武汉钢铁有限公司	2500.5 万元	15.15%
	上海彤胜投资管理中心（有限合伙）	751 万元	4.55%
	上海彤骏投资管理中心（有限合伙）	749 万元	4.54%
	总计	16500 万元	100%

### (二) 主要人员情况

#### 1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历
成善栋	董事长	男	中共党员，硕士，IMBA，曾任职中国人民银行上海市分行静安区办事处办公室科员，中国人民银行上海市分行、工商银行上海市分行办公室科员、科长，上海巴黎国际银行信贷部总经理，工商银行上海市分行办公室副主任、管理信息部总经理、办公室主任、党委委员、副行长，并历任上海市金融学会副秘书长，上海城市金融学会副会长、秘书长。
刘元瑞	非独立董事	男	中共党员，硕士，现任长江证券股份有限公司总裁。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管，长江证券承销保荐



			有限公司总裁助理，长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。
陈谋亮	非独立董事	男	中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海市湖北商会常务副会长，曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁、总裁。
何宇城	非独立董事	男	中共党员，硕士，MBA、EMPACC。现任武汉钢铁有限公司副总经理。曾任宝钢计划财务部助理会计师，宝钢资金管理处费用综合管理，宝钢成本管理处冷轧成本管理主办、主管，宝钢股份成本管理处综合主管，宝钢股份财务部预算室综合主管，宝钢股份财务部副部长，宝钢分公司炼钢厂副厂长，不锈钢分公司副总经理，宝钢股份钢管条钢事业部副总经理兼南通宝钢钢铁有限公司董事长、经营财务部部长。
覃波	非独立董事	男	中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。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、副总经理。
徐志刚	独立董事	男	中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长、党委副书记，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业（集团）有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询（上海）有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。
刘斐	独立董事	女	中共党员，工商管理硕士。现任国和创新教育基金（筹）合伙人。曾任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理、创始合伙人，上海国际集团旗下私募股权投资基金管理公司，浦银安盛基金管理有限公司总经理、董事（浦银安盛创始人），上海东新国际投资管理有限公司总经理、董事（浦发银行与新鸿基合资养老金投资管理公司），浦发银行办公室负责人。
马晨光	独立董事	女	致公党党员，法律硕士。现任上海市协力律师事务所律师，管理合伙人，上海市浦东新区人大代表，中国致公党上海市浦东新区副主委，

			上海市法学会金融法研究会理事，上海国际仲裁中心仲裁员，上海仲裁委员会仲裁员，复旦大学研究生校外导师，华东政法大学校外兼职导师，上海对外经贸大学兼职教授，上海市浦东新区法律服务业协会副会长。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>			

## 2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
吴伟	监事会主席	男	中共党员，研究生学历。现任武汉钢铁有限公司经营财务部总经理。历任武钢计划财务部驻工业港财务科副科长、科长、资金管理处主任科员、预算统计处处长，武汉钢铁有限公司经营财务部部长。
陈水元	监事	男	硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司财务负责人，兼任武汉股权托管交易中心监事长；曾任湖北证券有限公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理、总裁特别助理、执行副总裁、财务负责人、合规负责人、首席风险官。
杨爱民	监事	男	中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。
李毅	监事	女	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监、零售服务部总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>			

## 3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
覃波	总经理	男	简历同上。

周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。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。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
程燕春	副总经理	男	华中科技大学技术经济学士，具有基金从业资格，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，曾任中国建设银行江西省分行南昌城东支行副行长，中国建设银行纪检监察部案件检查处监察员，中国建设银行基金托管部市场处、信息披露负责人，融通基金管理有限公司筹备组成员、总经理助理兼北京分公司总经理、上海分公司总经理、执行监事，金元惠理基金管理有限公司首席市场官，历任长信基金管理有限责任公司总经理销售助理、总经理助理。
安 昀	副总经理	男	经济学硕士，复旦大学数量经济学研究生毕业，具有基金从业资格。曾任职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，2008年11月加入长信基金管理有限责任公司，历任策略研究员、基金经理助理、研究发展部副总监、研究发展部总监和基金经理。2015年5月6日至2016年9月6日在敦和资产管理有限公司股票投资部担任基金经理。2016年9月8日重新加入长信基金管理有限责任公司，曾任总经理助理，现任公司副总经理和投资决策委员会执行委员、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

#### 4、基金经理

本基金历任基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
高远	研究发展部总监、本基金的基金经理	自2018年8月31日起至今	复旦大学经济学博士，具有基金从业资格。2014年加入长信基金管理有限责任公司，曾任研究发展部副总监，现任研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金和长信金利趋

			势混合型证券投资基金的基金经理。
常松	基金经理	自 2016 年 7 月 15 日起至 2018 年 9 月 8 日	曾任本基金的基金经理。
宋小龙	副总经理、基金经理	自 2013 年 2 月 5 日起至 2016 年 7 月 23 日	曾任本基金的基金经理。
胡志宝	投资总监、基金经理	自 2012 年 10 月 27 日起至 2013 年 11 月 13 日	曾任本基金的基金经理。
付勇	基金经理	自 2010 年 6 月 28 日起至 2012 年 11 月 15 日	曾任本基金的基金经理。
许万国	基金经理	自 2008 年 6 月 2 日起至 2011 年 4 月 23 日	曾任本基金的基金经理。
陆文俊	基金经理	自 2006 年 7 月 6 日起至 2008 年 6 月 12 日	曾任本基金的基金经理。
梁晓军	基金经理	自 2006 年 4 月 30 日起至 2006 年 9 月 22 日	曾任本基金的基金经理。
<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
覃波	总经理、投资决策委员会主任委员
安昀	副总经理、投资决策委员会执行委员、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金和长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
杨帆	国际业务部总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
李家春	公司总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
高远	研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理
易利红	股票交易部总监
张文珺	固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理

陆莹	现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理
叶松	权益投资部总监、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
左金保	量化投资部兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理
张飒岚	固收专户投资部总监兼投资经理
涂世涛	量化专户投资部副总监兼投资经理
秦娟	混合债券部总监、长信利保债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理
李欣	债券交易部副总监
陈言午	专户投资部副总监兼投资经理
卢靖	战略与产品研发部总监
宋海岸	长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信价值优选混合型证券投资基金和长信先优债券型证券投资基金的基金经理
<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	
<p>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。</p>	
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
公司内部组织结构	量化投资部、权益投资部、研究发展部、固定收益部、股票交易部、债券交易部、基金事务部、营销管理部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、国际业务部、战略与产品研发部、电子商务部、财务管理部、专户投资部、固收专户投资部、量化专户投资部、绝对收益部、养老 FOF 投资部、综合机构部、培训部、混合债券部、现金理财部、集团业务部、量化研究部、固收研究部、北京机构业务部、上海机构业务部



分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉分公司
员工总数	205 人（截至 2019 年 4 月 30 日）

#### （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》规定的其他义务。

#### **（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) 不得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) 交易风险的管理；
- (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

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

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：293.52 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：胡波

联系电话：(021) 61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调



整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## （二）主要人员情况

高国富，男，1956 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，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，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商信贷处科长，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

## （三）基金托管业务经营情况

截止 2019 年 3 月 31 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 4614.20 亿元，比去年末增加 9.52%。托管证券投资基金共一百五十六只，分别为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、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联

安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、华富保本混合型证券投资基金、中海策略精选灵活配置混合基金、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保尊益信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛灵活配置混合型证券投资基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达

瑞弘混合基金、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、民生加银鑫顺债券型基金、万家天添宝货币基金、长安鑫珏主题轮动混合基金、中欧瑾泰灵活配置混合基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安大华惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投

资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证5年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金等。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急方案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

#### （五）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) 《公开募集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

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

## 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，以电话、邮件、书面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，如果基金管理人违规事项未予纠正，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) 基金份额销售机构

<b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼	
法定代表人：成善栋	联系人：陈竹君
电话：021-61009916	传真：021-61009917
客户服务电话：400-700-5566	公司网站：www.cxfund.com.cn
<b>2、场外代销机构</b>	
(1) 中国邮政储蓄银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区金融大街 3 号	
办公地址：北京市西城区金融大街 3 号	
法定代表人：李国华	联系人：孙小雅
电话：010-68858101	传真：010-68858117
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：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座	
法定代表人：周慕冰	联系人：林葛
电话：010-66060069	传真：010-68121816
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：王洪章	联系人：张静
电话：010-67596084	
客户服务电话：95533	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：彭纯	联系人：王菁
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：李建红	联系人：季平伟
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：上海市中山东一路 12 号	
办公地址：上海市中山东一路 12 号	
法定代表人：吉晓辉	联系人：唐苑
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：蒋怡
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：洪崎	联系人：徐野
电话：010-58560666	传真：010-58560666
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：常振明	联系人：方爽
电话：010-65558888	
客户服务电话：95558	网址：bank.ecitic.com
(10) 重庆银行股份有限公司	
注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
法定代表人：马千真	联系人：孔文超
电话：023-63799379	传真：023-63792412
客户服务电话：(023)63836229	网址：www.cqcbank.com
(11) 华夏银行股份有限公司	
注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	

法定代表人：吴建	联系人：刘军祥
电话：010-85238667	传真：010-85238680
客户服务电话：010-95577	网址：www.hxb.com.cn
(12) 汉口银行股份有限公司	
注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号	
法定代表人：陈新民	联系人：李星
电话：027-82656224	传真：027-82656236
客户服务电话：(027) 96558, 4006096558	网址：www.hkbchina.com
(13) 杭州银行股份有限公司	
注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
法定代表人：吴太普	联系人：严峻
电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
客户服务电话：96523, 400-8888-508	网址：www.hzbank.com.cn
(14) 平安银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
法定代表人：孙建一	联系人：张莉
电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
(15) 厦门银行股份有限公司	
注册地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
办公地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
法定代表人：吴世群	联系人：林黎云
电话：0592-5365735	传真：0592-5061952
客户服务电话：400-858-8888	网址：www.xmbankonline.com
(16) 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：陈剑虹
电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
客户服务电话：4008-001-001	网址：www.essence.com.cn
(17) 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：李新华	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
(18) 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：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层		
法定代表人：张智河	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	
(19) 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：姚文平	联系人：王志琦	
电话：021-68761616	传真：021-68767032	
客户服务电话：400-8888-128	网址：www.tebon.com.cn	
(20) 第一创业证券股份有限公司		
注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼		
办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼		
法定代表人：刘学民	联系人：吴军	
电话：0755-23838751	传真：0755-25831754	
客户服务电话：95358	网址：www.firstcapital.com.cn	
(21) 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：沈燕	
电话：021-63325888	传真：021-63326173	
客户服务电话：95503	网址：www.dfzq.com.cn	
(22) 东莞证券有限责任公司		
注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号		
办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼		
法定代表人：张运勇	联系人：乔芳	
电话：0769-22112062	传真：0769-22119423	
客户服务电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn	
(23) 东吴证券股份有限公司		
注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号		
办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号		
法定代表人：范力	联系人：陆晓	
电话：0512-62938521	传真：0512-65588021	
客户服务电话：400 860 1555	网址：www.dwzq.com.cn	

(24) 光大证券股份有限公司	
注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
法定代表人：周健男	联系人：龚俊涛
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
(25) 广州证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
法定代表人：胡伏云	联系人：梁微
电话：020-88836999	传真：020-88836654
客户服务电话：95396	网址：www.gzs.com.cn
(26) 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 至 10 层	
法定代表人：黄金琳	联系人：张腾
电话：0591-87383623	传真：0591-87383610
客户服务电话：95547	网址：www.hfzq.com.cn
(27) 广发证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
法定代表人：孙树明	联系人：马梦洁
电话：020-87555888 转各营业网点	传真：020-87557985
客户服务电话：95575 或致电各地营业部	网址：www.gf.com.cn
(28) 国都证券股份有限公司	
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 层 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 层 10 层	
法定代表人：王少华	联系人：李弢
电话：010-84183389	传真：010-84183311-3389
客户服务电话：400-818-8118	网址：www.guodu.com
(29) 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：四川省成都市东城根上街 95 号	
法定代表人：冉云	联系人：杜晶、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
客户服务电话：95310	网址：www.gjzq.com.cn
(30) 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：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702	
法定代表人：雷建辉	联系人：沈刚
电话：0510-82831662	传真：0510-82830162
客户服务电话：95570	网址：www.glsc.com.cn
(31) 国盛证券有限责任公司	
注册地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）	
办公地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）	
法定代表人：马跃进	联系人：俞驰
电话：0791-86283080	传真：0791-86288690
客户服务电话：4008-222-111	网址：www.gsstock.com
(32) 国泰君安证券股份有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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：杨德红	联系人：芮敏祺
电话：95521	传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666	网址：www.gtja.com
(33) 国信证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
法定代表人：何如	联系人：李颖
电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
客户服务电话：95536	网址：www.guosen.com.cn
(34) 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
(35) 华安证券股份有限公司	
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号	
办公地址：合肥市蜀山区南二环 959 号 B1 座华安证券	
法定代表人：李工	联系人：汪燕
电话：0551-5161666	传真：0551-5161600
客户服务电话：96518、400-80-96518	网址：www.hazq.com
(36) 华宝证券有限责任公司	
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层	
法定代表人：陈林	联系人：刘闻川

电话：021-68777222	传真：021-68777822
客户服务电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
(37) 华龙证券股份有限公司	
注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼	
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼	
法定代表人：陈牧原	联系人：范坤
电话：0931-4890208	传真：0931-4890628
客户服务电话：95368、4006898888	网址：www.hlzq.com
(38) 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：郭琳
电话：025-83290979	传真：025-84579763
客户服务电话：95597	网址：www.htsc.com.cn
(39) 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：高悦铭
电话：0451-82336863	传真：0451-82287211
客户服务电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn
(40) 中航证券有限公司	
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼	
办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼	
法定代表人：王宜四	联系人：戴蕾
电话：0791-86768681	传真：0791-86770178
客户服务电话：400-8866-567	网址：www.avicsec.com
(41) 平安证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）	
法定代表人：何之江	联系人：王阳
电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511-8	网址：www.stock.pingan.com
(42) 中泰证券股份有限公司	
注册地址：济南市市中区经七路 86 号	
办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
法定代表人：李玮	联系人：秦雨晴
电话：021-20315197	传真：021-20315125
客户服务电话：95538	网址：www.zts.com.cn

(43) 上海证券有限责任公司	
注册地址: 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼	
办公地址: 上海市西藏中路 336 号	
法定代表人: 李俊杰	联系人: 许曼华
电话: 021-53686888	传真: 021-53686100-7008、 021-53686200-7008
客户服务电话: 4008918918	网址: www.shzq.com
(44) 申万宏源证券有限公司	
注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	
办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层	
法定代表人: 李梅	联系人: 黄莹
电话: 021-33389888	传真: 021-33388224
客户服务电话: 95523 或 4008895523	网址: www.swhysc.com
(45) 天风证券股份有限公司	
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: 中国湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 48 层	
法定代表人: 余磊	联系人: 程晓英
电话: 18064091773	传真: 027-87618863
客服电话: 95391 或 400-800-5000	网址: www.tfzq.com
(46) 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: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层	
法定代表人: 林义相	联系人: 谭磊
电话: 010-66045182	传真: 010-66045518
客户服务电话: 010-66045678	网址: www.txsec.com
(47) 西藏东方财富证券股份有限公司	
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: 汪尚斌
电话: 021-36533017	传真: 021-36533017
客户服务电话: 400-8811-177	网址: www.xzsec.com
(48) 湘财证券有限责任公司	
注册地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
办公地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
法定代表人: 林俊波	联系人: 钟康莺
电话: 021-68634518	传真: 021-68865680
客户服务电话: 400-888-1551	网址: www.xcsc.com



(49) 国融证券股份有限公司	
注册地址: 内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼	
办公地址: 北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层	
法定代表人: 张智河	联系人: 叶密林
电话: 010-83991719	传真: 010-66412537
客户服务电话: 95385	网址: www.grzq.com
(50) 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: 上海市浦东新区长柳路36号	
法定代表人: 杨华辉	联系人: 乔琳雪
电话: 021-38565547	
客户服务电话: 95562	网址: www.xyzq.com.cn
(51) 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: 黄婵君
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
(52) 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
(53) 中国银河证券股份有限公司	
注册地址: 北京市西城区金融大街35号2-6层	
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: 陈共炎	联系人: 辛国政
电话: 010-83574507	传真: 010-83574807
客户服务电话: 4008-888-888 或 95551	网址: www.chinastock.com.cn
(54) 中信建投证券股份有限公司	
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: 王常青	联系人: 张颢
电话: 010-85130588	传真: 010-65182261
客户服务电话: 400-8888-108	网址: www.csc108.com
(55) 中信证券股份有限公司	
注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座	

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦	
法定代表人：王东明	联系人：侯艳红
电话：010-60838888	传真：010-60833739
客户服务电话：95558	网址：www.citics.com
(56) 中信证券（山东）有限责任公司	
注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001	
办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层	
法定代表人：姜晓林	联系人：焦刚
电话：0531-89606166	传真：0532-85022605
客户服务电话：95548	网址：http://sd.citics.com/
(57) 中山证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层	
办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 6013 号江苏大厦 B 座 15 楼	
法定代表人：吴永良	联系人：罗艺琳
电话：0755-83734659	传真：0755-82960582
客户服务电话：95329	网址：www.zszq.com.cn
(58) 信达证券股份有限公司	
注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	
法定代表人：张志刚	联系人：鹿馨方
电话：010-63081000	传真：010-63080978
客服热线：95321	网址：www.cindasc.com
(59) 西南证券股份有限公司	
注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号	
办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦	
法定代表人：廖庆轩	联系人：周青
电话：023-63786633	传真：023-67616310
客服热线：95355、4008096096	网址：www.swsc.com.cn
(60) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	
注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室	
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼	
法定代表人：祖国明	联系人：韩爱彬
电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
(61) 上海长量基金销售有限公司	
注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	
办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层	
法定代表人：张跃伟	联系人：马良婷
电话：021-20691832	传真：021-20691861

客户服务电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com
(62) 诺亚正行基金销售有限公司	
注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室	
办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼	
法定代表人：汪静波	联系人：李娟
电话：021-38602377	传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
(63) 上海好买基金销售有限公司	
注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室	
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室	
法定代表人：杨文斌	联系人：徐超逸
电话：021-20613988	传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com
(64) 和讯信息科技有限公司	
注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室	
办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
法定代表人：王莉	联系人：陈慧慧
电话：010-85657353	传真：010-65884788
客户服务电话：400-920-0022	网址：www.licaike.hexun.com
(65) 上海天天基金销售有限公司	
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦	
法定代表人：其实	联系人：朱钰
电话：021-54509998	传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188	网址：fund.eastmoney.com
(66) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司	
注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809	
办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809	
法定代表人：沈伟桦	联系人：程刚
电话：010-52855713	传真：010-85894285
客户服务电话：4006099400	网址：www.yixinfund.com
(67) 浙江同花顺基金销售有限公司	
注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室	
办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层	
法定代表人：凌顺平	联系人：吴强
电话：0571-88911818	传真：0571-86800423
客户服务电话：4008-773-772	公司网站：www.5ifund.com
(68) 上海汇付基金销售有限公司	
注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元	

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋	
法定代表人：金佶	联系人：甄宝林
电话：021-34013996-3011	传真：
客户服务电话：021-34013999	网址：www.hotjijin.com
(69) 上海陆金所基金销售有限公司	
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元	
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼	
法定代表人：郭坚	联系人：宁博宇
电话：021-20665952	传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031	网址：www.lufunds.com
(70) 大泰金石基金销售有限公司	
注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室	
办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼	
法定代表人：袁顾明	联系人：朱真卿
电话：021-22267943	传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266	网址：www.dtfunds.com
(71) 上海联泰基金销售有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室	
办公地址：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼	
法定代表人：燕斌	联系人：陈东
电话：021-52822063	传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788	网址：www.66zichan.com
(72) 海银基金销售有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室	
办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼	
法定代表人：惠晓川	联系人：毛林
电话：021-80133597	传真：021-80133413
客户服务电话：4008081016	网址：www.fundhaiyin.com
(73) 上海凯石财富基金销售有限公司	
注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室	
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼	
法定代表人：陈继武	联系人：葛佳蕊
电话：021-80365020	传真：021-63332523
客户服务电话：4006433389	网址：www.vstonewealth.com
(74) 上海利得基金销售有限公司	
注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室	
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼	
法定代表人：李兴春	联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533	传真：86-021-50583633
客户服务电话：400-921-7755	网站： <a href="http://a.leadfund.com.cn/">http://a.leadfund.com.cn/</a>
(75) 珠海盈米基金销售有限公司	
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491	
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203	
法定代表人：肖雯	联系人：邱湘湘
电话：020-89629099	传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066	网站： <a href="http://www.yingmi.cn">www.yingmi.cn</a>
(76) 北京汇成基金销售有限公司	
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号	
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层	
法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
电话：010-56282140	传真：010-62680827
客户服务电话：400-619-9059	网站： <a href="http://www.hcjjin.com">www.hcjjin.com</a>
(77) 上海华夏财富投资管理有限公司	
注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室	
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	
法定代表人：李一梅	联系人：仲秋玥
电话：010-88066632	传真：010-88066552
客户服务电话：4008175666	网站： <a href="http://www.amcfortune.com">www.amcfortune.com</a>
(78) 和谐保险销售有限公司	
注册地址：北京市朝阳区东三环中路55号楼20层2302	
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街6号安邦金融中心	
法定代表人：蒋洪	联系人：张楠
电话：010-85256214	
客户服务电话：4008195569	网站： <a href="http://www.hx-sales.com">www.hx-sales.com</a>
(79) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司	
注册地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208	
法定代表人：吴雪秀	联系人：徐越
电话：010-88312877-8032	传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566	网站： <a href="http://www.yilucaifu.com">www.yilucaifu.com</a>
(80) 嘉实财富管理有限公司	
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元	
办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层	
法定代表人：赵学军	联系人：王宫
电话：021-38789658	传真：021-68880023
客户服务电话：400-600-8800	网站： <a href="http://www.jsfund.cn">www.jsfund.cn</a>

(81) 北京蛋卷基金销售有限公司	
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层 222507	
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层 222507	
法定代表人：钟斐斐	联系人：侯芳芳
电话：010-61840688	传真：010-61840699
客户服务电话：400-1599-288	网站：www.danjuanapp.com
(82) 上海基煜基金销售有限公司	
注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发区）	
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室	
法定代表人：王翔	联系人：张巍婧
电话：021-65370077-255	传真：021-55085991
客户服务电话：400-820-5369	网站：www.jiyufund.com.cn
(83) 开源证券股份有限公司	
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层	
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层	
法定代表人：李刚	联系人：袁伟涛
电话：029-88447611	传真：029-88447611
客户服务电话：95325 或 400-860-8866	网站：www.kysec.cn
(84) 华鑫证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元	
办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号	
法定代表人：俞洋	联系人：杨莉娟
电话：021-54967552	传真：021-54967293
客户服务电话：95323	网站：www.cfsc.com.cn
<b>3、场内销售机构</b>	
场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站： <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	

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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址	北京市西城区太平桥大街17号	上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
办公地址	北京市西城区太平	上海市浦东南路256号	上海市浦东新区世纪大道



	桥大街 17 号	华夏银行大厦 1405 室	100 号 50 楼
法定代表人	周明	廖海（负责人）	毛鞍宁
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-22282551
传真	010-59378907	021-51150398	021-22280071
联系人	崔巍	廖海、刘佳	蒋燕华（蒋燕华、沈熙苑 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。

## 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。

若出现新的证券交易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

基金合同生效后不超过 3 个月时间内开始办理申购。本基金于 2006 年 5 月 22 日开始办理日常申购业务。

## 3、赎回的开始时间及业务办理时间

基金合同生效后不超过 3 个月时间内开始办理赎回。本基金于 2006 年 7 月 28 日开始办理日常赎回业务。

### （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、自 2014 年 5 月 15 日起，投资者通过场外申购时，投资者首次申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费），追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费）；超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台申购本基金需遵循上述规则；各基金代理销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理申购业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

投资者通过上海证券交易所场内申购时，每笔申购金额最低为人民币 100 元（含申购费），同时每笔申购必须是 100 元的整数倍。

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、自 2014 年 5 月 15 日起，投资者通过场外赎回时，本基金的投资者的最低赎回份额调整为 1 份，即投资者可将其全部或部分基金份额赎回，赎回的最低份额为 1 份；投资者当日持有份额减少导致在销售机构同一交易账户保留的基金份额不足 1 份的，注册登记机构将全部剩余份额自动赎回。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台赎回本基金需遵循上述规则；各基金代理销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理赎回业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

投资者通过场内赎回时，单笔赎回的基金份额为 1 份的整数倍。

3、基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限、单笔/单日申购金额上限、本基金总规模上限。具体规定请参见相关公告。

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



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

5、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。

6、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。

7、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。

8、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%
$100 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	1.0%
$M \geq 500 \text{ 万}$	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，对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费；其他情形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 < 7 天	1.5%
7 天 ≤ 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，其中对持续持有期少

于 7 日的投资者收取的赎回费应全额计入基金财产，其余赎回费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 1.1000 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	1.1000 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

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

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

### (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长于 7 天但未满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 1.1000 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	1.1000 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 1.1000 元，该投资者选择交纳后端申购费用，并在持有期长于 7 天但未满一年时赎回 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	1.2000 元	12,000 元	1.1000 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工作；
- （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；
- （6）接受某笔或者某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；
- （7）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施。

发生上述（1）至（4）、（7）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

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工作；
- （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）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；
- （5）法律法规、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) 本基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20% 以上的赎回申请的情形下，基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动的，基金管理人有权对该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20% 以上的那部分赎回申请进行延期办理；对该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“(1) 全额赎回”或“(2) 部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(4) 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混合基金（前端代码：519995）与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）（非直销渠道）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信利丰债券基金 C 类份额（C 类代码：519989）、长信双利优选混合基金 A 类份额（A 类代码：519991）、长信恒利优势混合基金、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、长信量化先锋混合基金 A 类份额（A 类代码：519983）、长信内需成长混合基金 A 类份额（A 类代码：519979）、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化

中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金 A 类份额（A 类代码：519965）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金、长信利泰混合基金、长信利保债券基金、长信先锐债券基金、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利信混合基金 A 类份额（A 类代码：519949）、长信上证港股通指数型发起式基金、长信先优债券基金、长信中证 500 指数基金、长信乐信混合基金（非直销渠道）、长信低碳环保量化股票基金、长信消费精选股票基金（非直销渠道）、长信价值优选混合基金之间的双向转换业务。长信金利趋势混合基金（后端代码：519994）可转换转入长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998），具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

本公司于 2017 年 6 月 30 日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信上证港股通指数型发起式证券投资基金暂停转换转出和转换转入业务的公告》，自 2017 年 7 月 4 日起，暂停长信上证港股通指数型发起式基金的转换转入和转换转出业务。

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)

## 3) 非货币基金转至货币基金

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

转入确认金额=转出确认金额-赎回费

转入确认份额=转入确认金额÷货币基金份额净值

(货币基金份额净值为 1.00 元, 补差费为零)

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”指因管理体制变革、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、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、并具有良好的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的成果，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。

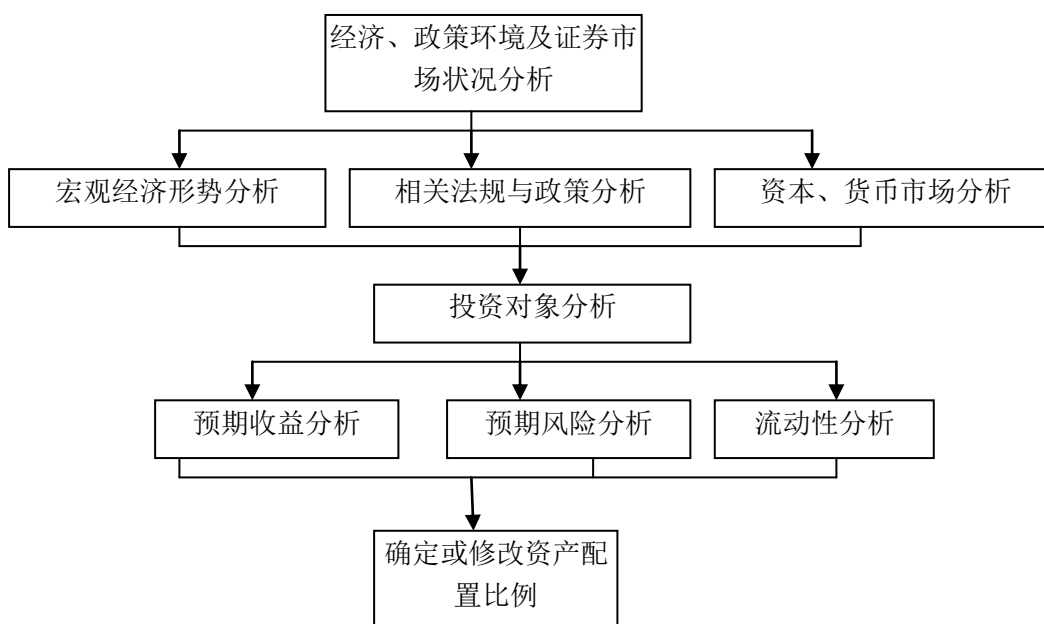
#### 1、资产配置比例

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

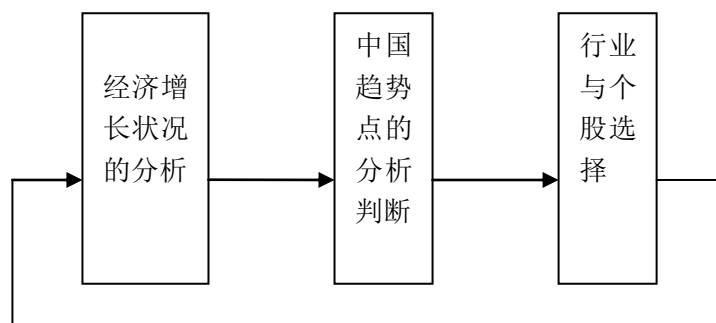
本基金管理人对行业配置权重的确定或调整分三个方面进行：第一方面，分析中国趋势点、宏观经济因素、政策因素对行业发展前景和行业结构调整的影响，包括经济周期、市场需求结构、宏观经济政策和产业政策等方面影响的分析；第二方面，行业分析，分析的重点是行业的成长性、行业盈利能力、行业的二级市场表现，分析的指标包括行业销售增长率、行业利润增长率、行业净资产收益率、行业每股收益、行业指数相对于市场指数的超额收益率、行业市净率等；第三方面，分析研究比较基准的行业权重。在综合系统地考虑上述分析结果基础上，确定股票投资组合中的行业配置权重。

### 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；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；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；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；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；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(PS)、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。

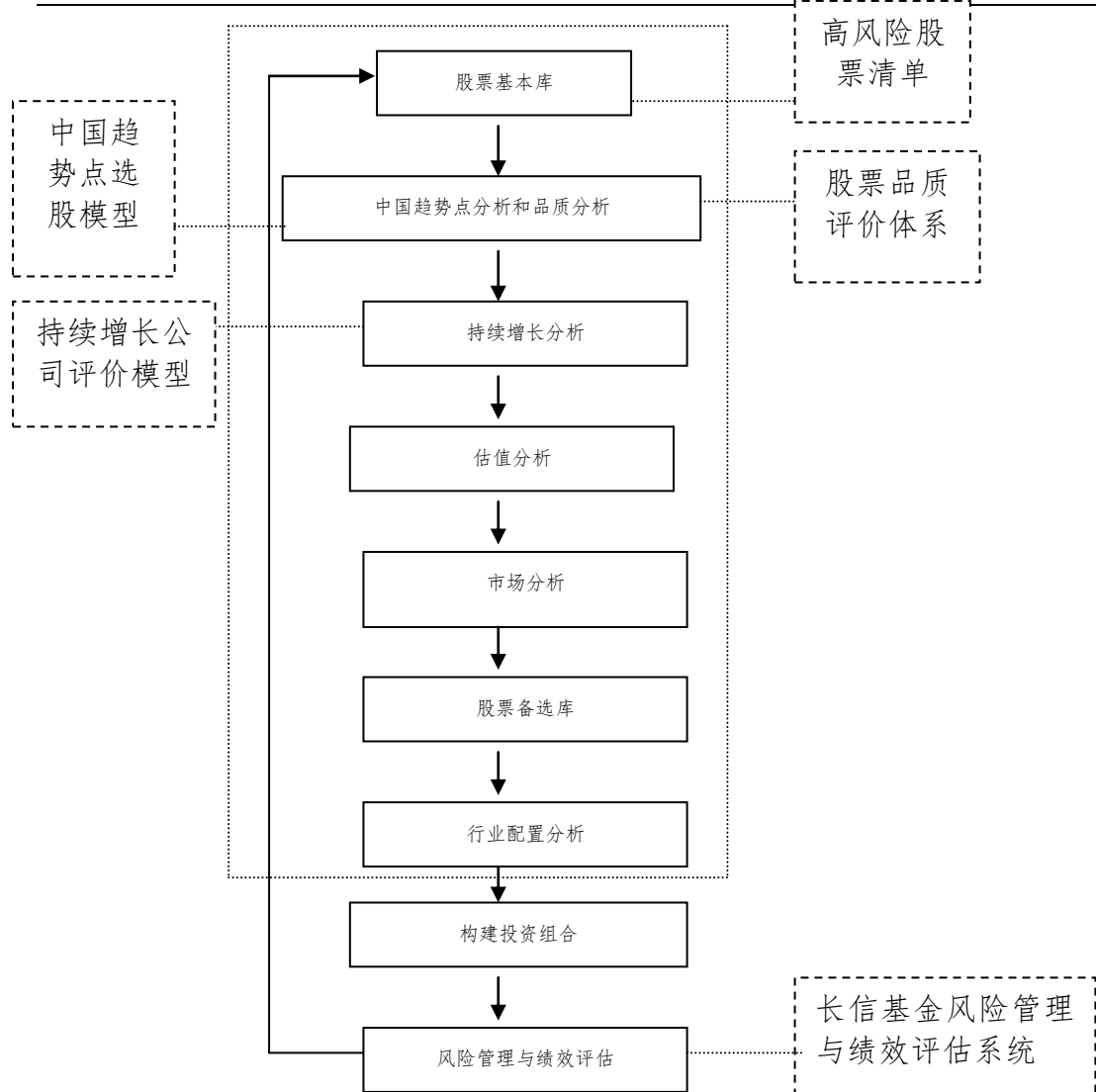
### （5）市场分析

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

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

6、本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

7、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；

8、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，除上述第 4、5 项外，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准；

9、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。除上述第 4、5 项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。

### （十一）业绩评价基准

2015 年 8 月 7 日起本基金业绩比较基准由“上证 A 股指数×70%+中信标普国债指数×30”变更为“上证 A 股指数×70%+中证综合债指数×30%”。关于变更业绩比较基准的事宜，我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

### （十二）风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险

和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### （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基金合同规定，于 2019 年 5 月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 2019 年 3 月 31 日（摘自 2019 年第 1 季度报告），本报告中所列财务数据未经审计。

### （一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,481,147,645.58	81.31
	其中：股票	1,481,147,645.58	81.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	149,232,000.00	8.19
	其中：债券	149,232,000.00	8.19
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	187,011,707.62	10.27
8	其他资产	4,169,174.05	0.23
9	合计	1,821,560,527.25	100.00

注：本基金本报告期没有通过港股通交易机制投资港股。

### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	采矿业	-	-
C	制造业	519,376,669.74	29.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,144,353.49	2.58
E	建筑业	27,225,000.00	1.56
F	批发和零售业	205,219,331.87	11.75
G	交通运输、仓储和邮政业	64,677,374.30	3.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,595,593.34	9.94
J	金融业	150,762,902.18	8.63
K	房地产业	166,305,686.37	9.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	34,733,000.00	1.99
N	水利、环境和公共设施管理业	11,880,000.00	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	82,227,734.29	4.71
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,481,147,645.58	84.81

## 2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期没有通过港股通交易机制投资港股。

### (三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601877	正泰电器	2,700,012	72,360,321.60	4.14
2	601021	春秋航空	1,592,226	64,644,375.60	3.70
3	600466	蓝光发展	8,500,009	62,730,066.42	3.59
4	300383	光环新网	2,863,400	53,688,750.00	3.07
5	601933	永辉超市	6,000,973	51,848,406.72	2.97
6	000661	长春高新	150,000	47,548,500.00	2.72
7	603589	口子窖	800,000	43,512,000.00	2.49

8	300244	迪安诊断	2,000,054	43,161,165.32	2.47
9	300271	华宇软件	2,000,000	42,540,000.00	2.44
10	002146	荣盛发展	3,500,051	39,375,573.75	2.25

#### (四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,984,000.00	5.78
	其中：政策性金融债	100,984,000.00	5.78
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	48,248,000.00	2.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,232,000.00	8.54

#### (五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180209	18 国开 09	700,000	70,189,000.00	4.02
2	170215	17 国开 15	300,000	30,795,000.00	1.76
3	128024	宁行转债	200,000	24,566,000.00	1.41
4	113013	国君转债	200,000	23,682,000.00	1.36

#### (六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### (七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## (八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## (九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## (十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## (十一) 报告附注

### 1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 3、其他资产的构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,475,707.46

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,614,180.65
5	应收申购款	79,285.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,169,174.05

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	24,566,000.00	1.41
2	113013	国君转债	23,682,000.00	1.36

#### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

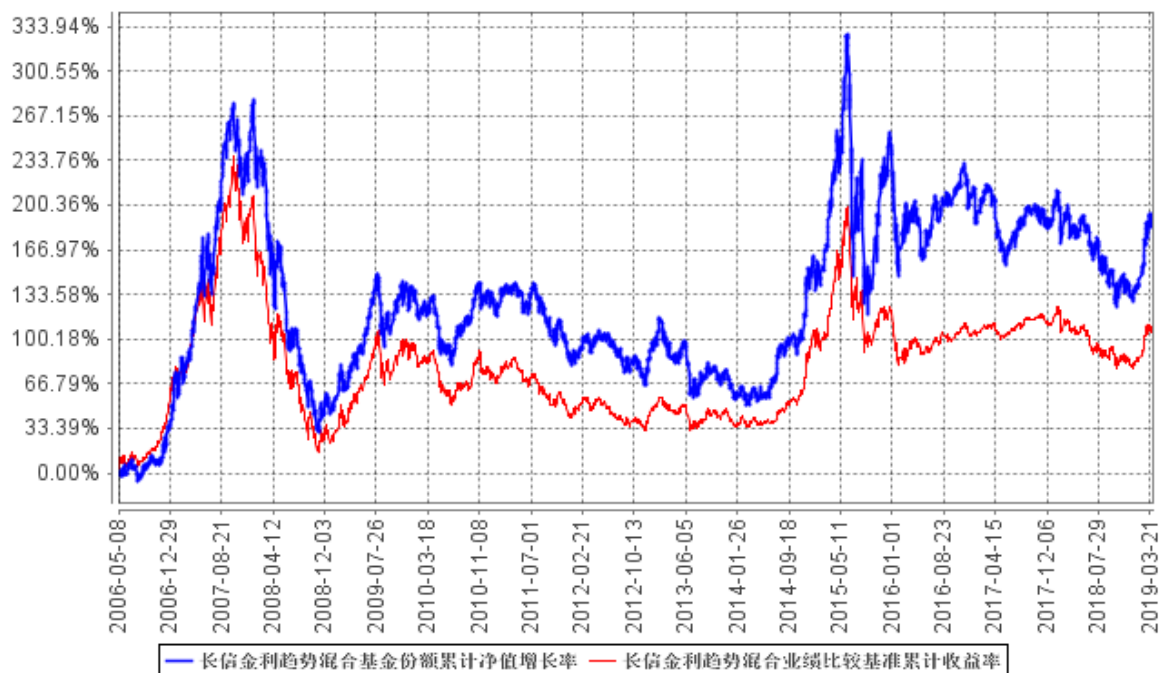
## 十一、基金的业绩

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。

2019年一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	151.23%	2.12%	80.32%	1.94%	70.91%	0.18%
2008年	-58.68%	2.47%	-58.63%	2.37%	-0.05%	0.10%
2009年	65.99%	1.65%	60.98%	1.56%	5.01%	0.09%
2010年	-3.40%	1.32%	-11.88%	1.17%	8.48%	0.15%
2011年	-19.13%	1.13%	-17.09%	0.94%	-2.04%	0.19%
2012年	5.04%	1.13%	3.15%	0.85%	1.89%	0.28%
2013年	-15.42%	1.46%	-5.09%	0.89%	-10.33%	0.57%
2014年	51.05%	1.35%	42.03%	0.86%	9.02%	0.49%
2015年	34.79%	3.04%	10.13%	1.96%	24.66%	1.08%
2016年	-9.30%	1.88%	-7.67%	1.02%	-1.63%	0.86%
2017年	-5.66%	0.95%	4.73%	0.38%	-10.39%	0.57%
2018年	-20.09%	1.30%	-15.65%	0.86%	-4.44%	0.44%
2019年1月1日 -2019年3月31日	26.73%	1.42%	16.85%	1.00%	9.88%	0.42%

自合同生效之日（2006年4月30日）至2019年3月31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2019年3月31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约定。



## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买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“长信金利趋势混合型开放式证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“长信金利趋势混合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

#### 1、证券交易所上市的权益类证券的估值

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

#### 2、处于未上市期间的权益类证券应区分如下情况处理：

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

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

### 3、流通受限股票的估值

发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、交易所市场交易的固定收益品种（指国债、企业债、公司债、可转换债券、中小企业私募债、资产支持证券等，下同）的估值

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后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以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

5、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

6、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

7、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

格估值。

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

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

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

#### **（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从基金管理人承担，基金管理人对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、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协



商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；

4、法律法规、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 8 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，不足以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“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

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账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 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、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；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

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。

基金管理人应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

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

#### (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、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项;

27、中国证监会规定的其他事项。

#### （七）澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、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，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定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混合型基金，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混合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。

本基金拟投资市场、行业及资产具有较好的流动性，与基金合同约定的申购赎回安排相匹配，能够支持不同市场情形下投资者的赎回要求。本基金主要的流动性风险为投资者可能会面临因巨额赎回带来的流动性风险。若是由于投资者大量赎回而导致基金管理人被迫抛售持有投资品种以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，在巨额赎回发生时采取备用的流动性风险管理应对措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

#### 1、基金申购、赎回安排

本基金申购赎回的具体安排可见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节。

#### 2、拟投资市场的流动性风险评估

本基金主要投资于国内具有良好流动性的金融工具。随着我国股票、债券市场交易机制的逐步完善、投资者结构的优化、信息披露相关法律法规的推出，我国的股票和债券市场已经具备较好的流动性。同时，基金管理人在个股个券选择时将精选具有良好流动性的优质标的。因此，本基金拟投资的市场整体具有较高的流动性水平，可以匹配本基金约定的申购赎回安排。

#### 3、巨额赎回下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金经理和风险

管理部会根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以支付所有的赎回款项。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，基金管理人会在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请。具体措施详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节中“(十二) 巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

#### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

(1) 暂停赎回或延缓支付赎回款项：上述具体措施详见招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节中“(十一) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”及“(十二) 巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

(2) 延期办理巨额赎回申请：上述具体措施可见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”章节中“(十二) 巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

#### (3) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

#### (4) 暂停基金估值

暂停估值的情形详见招募说明书“十三、基金资产的估值”章节第(七)条的相关约定，若当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，实施暂停基金估值，基金管理人相应会采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

### 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

本基金作为混合型基金，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、其他法定收入和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》及有关法律的规定监督基金托管人, 如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定, 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》及有关法律的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他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 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、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%，因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- 5、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；
- 6、本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公



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

7、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；

8、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，除上述第 4、5 项外，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。

9、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**

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

邮政编码：200120

法定代表人：成善栋

批准成立日期：2003 年 5 月 9 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：1.65 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：上海市中山东一路 12 号

邮政编码：200120

法定代表人：高国富

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：216.18 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，并对双方均有约束力，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； 每月结束后的 5 个工作日内，根据投资者的对账单定制需求以书面或电子形式寄送交易对账单。
		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登录基金管理人网站“账户登录”栏目，可享有账户查询、短信/邮件信息定制、资料修改等多项在线服务。
		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“账户登录”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。也可以亲自到网点或致电客户服务专线，由人工坐席提供相关服务。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： 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）。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够修改其中一项关键信息。 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、开放式基金账户业务申请表以及开放式基金账户资料变更申请表；正常变更需要提供身份证复印件、开放式基金账户业务申请表、开放式基金账户资料变更申请表以及银行柜台出具的新旧银行卡转换证明原件，邮寄到本公司。
(三)	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	通过定期不定额投资计划，投资者可以通过本公司“长金通”

		<p>额投资计划</p> <p>网上直销平台提交交易申请, 约定“基金品种”、“每月扣款日期”、“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。</p>
		<p>定期不定额转换</p> <p>通过定期不定额转换投资计划, 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”、“每月转换日期”、“基准份额”、“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份额, 委托本公司完成交易的一种基金投资方式。</p>
		<p>红利再投资</p> <p>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。</p>
(四)	客户服务中心电话服务	<p>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。</p> <p>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。</p>
(五)	客户投诉受理服务	<p>客户投诉处理流程</p> <p>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。</p>
		<p>客户投诉方式</p> <p>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(021-61009865)、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。</p>
(六)	增值服务	<p>信息定制服务</p> <p>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、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,</p>
		<p>个性化理财服务</p> <p>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。</p>
		<p>组织投资者交流会</p> <p>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。</p>
(七)	投资者教育服务	<p>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。</p>
(八)	公开信息	<p>披露公司信息</p> <p>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</p>

	披露服务		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。 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)	客户服务联络方式	客户服务专线	4007005566(免长话费)、工作时间(8:30-12:00 13:00-17:00)内可转人工坐席。
		传真	021-61009865
		公司网址	http://www.cxfund.com.cn
		电子信箱	service@cxfund.com.cn

## 二十三、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加华福证券有限责任公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司 网站	2018/11/8
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海利得基金销售有限公司开通转换、定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报、公司网站	2018/12/5
3	长信金利趋势混合型证券投资基金更新的招募说明书（2018 年第【2】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、 公司网站	2018/12/13
4	长信基金管理有限责任公司关于股权变更的公告	上证报、中证报、 公司网站	2018/12/21
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司 网站	2018/12/27
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司基金及基金组合申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司 网站	2018/12/28
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2018 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2019/1/1
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费及转换业务的申购补差费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、公司 网站	2019/1/10
9	长信金利趋势混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中证报、公司网 站	2019/1/19
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在安信证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报、公司网站	2019/1/22
11	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金修改托管协议的公告	中证报、公司网 站	2019/2/12
12	长信金利趋势混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2019/2/12
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网 站	2019/3/1
14	长信基金管理有限责任公司公告	证券时报、公司 网站	2019/3/2
15	长信基金管理有限责任公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报、公司网站	2019/3/25

16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、公司网站	2019/3/28
17	长信金利趋势混合型证券投资基金 2018 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	中证报、公司网站	2019/3/29
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019/4/8
19	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰基金销售有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019/4/15
20	长信金利趋势混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中证报、公司网站	2019/4/22
21	长信基金管理有限责任公司关于增加华鑫证券有限责任公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019/4/26
<b>本信息披露事项截止时间为 2019 年 4 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）《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《长信金利趋势混合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

2019年6月13日