

# 长盛沪深300指数证券投资基金（LOF） 招募说明书（更新）

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

## 重要提示

1、本基金 2010 年 5 月 14 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]646 号文核准募集。

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

3、本基金标的指数为沪深 300 指数。

(1) 标的指数样本空间: 沪深 300 指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、\*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成:

1) 科创板证券、创业板证券: 上市时间超过一年。

2) 其他证券: 上市时间超过一个季度,除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。

(2) 选样方法: 沪深 300 指数样本是按照以下方法选择经营状况良好、无违法违规事件、财务报告无重大问题、证券价格无明显异常波动或市场操纵的公司:

1) 对样本空间内证券按照过去一年的日均成交金额由高到低排名,剔除排名后 50%的证券;

2) 对样本空间内剩余证券,按照过去一年的日均总市值由高到低排名,选取排名前 300 名的证券作为指数样本。

(3) 指数计算: 指数采用调整市值加权计算,调整市值根据自有流通量和分级靠档两因素决定。

有关标的指数具体编制方案及成份股等指数信息详见中证指数有限公司网站,网址: [www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn)。

4、本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动而波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险,本基金根据股票与债券市场的波动趋势灵活配置股票与债券的投资比例,在系统

研究基础上判断股票市场与债券市场的未来趋势，有可能发生判断失误的风险，以及本基金为指数基金，可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等风险，详见本招募说明书“风险提示”章节的具体内容。

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

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本招募说明书（更新）基金经理信息更新截止日为 2026 年 6 月 8 日，其余所载内容截止日为 2026 年 5 月 21 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2026 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目录

重要提示 .....	2
一、绪言 .....	5
二、释义 .....	6
三、基金管理人 .....	12
四、基金托管人 .....	23
五、相关服务机构 .....	30
六、基金的募集 .....	57
七、基金合同的生效 .....	58
八、基金份额的上市与交易 .....	59
九、基金份额的场外申购、转换与赎回 .....	60
十、基金份额的场内申购与赎回 .....	70
十一、基金的侧袋机制 .....	76
十二、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管 .....	79
十三、基金的投资 .....	81
十四、基金的业绩 .....	96
十五、基金的融资、融券 .....	98
十六、基金的财产 .....	99
十七、基金资产的估值 .....	100
十八、基金的收益与分配 .....	106
十九、基金的费用与税收 .....	108
二十、基金的会计与审计 .....	111
二十一、基金的信息披露 .....	112
二十二、风险揭示 .....	117
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	123
二十四、基金合同的内容摘要 .....	126
二十五、基金托管协议的内容摘要 .....	143
二十六、对基金份额持有人的服务 .....	154
二十七、其它应披露的事项 .....	155
二十八、招募说明书的存放及查阅方式 .....	156
二十九、备查文件 .....	157

## 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集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《流动性风险管理规定》)和其他相关法律法规的规定及《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)等编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资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，下列词语具有如下含义：

- 1.基金或本基金：指长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）
- 2.基金管理人：指长盛基金管理有限公司
- 3.基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4.基金合同：指《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5.托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6.招募说明书及本招募说明书：指《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- 7.基金产品资料概要：指《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新
- 8.基金份额发售公告：指《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）份额发售公告》
- 9.法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10.《基金法》：指 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11.《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12.《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13.《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14.《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10

月 1 日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

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

16.中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17.银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的银行监管机构

18.基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19.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

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

21.合格境外机构投资者：指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

22.投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

23.基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24.基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

25.销售机构：指直销机构和代销机构

26.直销机构：指长盛基金管理有限公司

27.代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

28.基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

29.注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、清算和交收、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

30.注册登记机构：长盛基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

31.注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

32.证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

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

34.基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

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

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

37.基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

38.存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39.工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40.T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

41.T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

42.开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43.交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44.发售：在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为

- 45.认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
- 46.申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 47.赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 48.上市交易：指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为
- 49.场外：通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、基金份额申购和赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
- 50.场内：指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位进行基金份额认购、基金份额申购和赎回，基金份额上市交易的深圳证券交易所会员单位和场所
- 51.基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的（全部或部分）基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为
- 52.转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的基金份额从一个交易账户托管转移到另一交易账户的行为
- 53.系统内转托管：投资者将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
- 54.跨系统转托管：投资者将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为
- 55.定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
- 56.巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

57.元：指人民币元

58.基金收益：基金合同项下基金收益指基金利润，即基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

59.基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

60.基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

61.基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

62.基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

63.基金份额分类：本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：A 类基金份额和 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值

64.A 类基金份额：在投资者申购时收取申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额

65.C 类基金份额：在投资者申购时不收取申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额

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

67.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

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

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

网站) 等媒介

70.不可抗力:指基金合同当事人无法预见、无法避免、无法克服且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的,使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件,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、恐怖袭击、传染病传播、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、公众通讯设备或互联网络故障

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

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

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3 层

法定代表人：胡甲

电话：(010) 86497888

传真：(010) 86497666

联系人：张利宁

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6 号文件批准，于 1999 年 3 月 26 日成立，注册资本为人民币 20600 万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%；新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%；安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。截至 2026 年 5 月 21 日，基金管理人共管理七十七只开放式基金和六只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、董事会成员

胡甲先生，董事长，硕士，高级经济师。曾任安徽省财政厅农业财务处科员、副主任科员、主任科员，安徽省信托投资公司滁州证券营业部总经理，国元证券滁州营业部总经理，铜陵营业部总经理，合肥寿春路第二营业部总经理，合肥寿春路第一营业部总经理，市场营销总部副总经理，营销经纪总部副总经理、总经理，总裁助理兼经纪业务管理总部总经理，总裁助理兼证券信用总部总经理，总裁助理兼总裁办公室主任，董事会秘书，执行委员会委员。现任长盛基金管理有限公司董事长(法定代表人)，兼任长盛基金（香港）有限公司董事。

汤琰女士，董事，硕士。历任中国工商银行深圳分行高级理财经理；华安基金管理有限公司零售业务部副总经理；中金基金管理有限公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理。

沈和付先生，董事，学士。曾任中国安徽国际经济技术合作公司法律部科员、总经办经理助理，安徽省信托投资公司法律顾问室副主任，国元证券有限责任公

司法律事务部主任, 国元证券股份有限公司合规总监、副总裁, 安徽国元投资有限责任公司党委书记、董事长, 国元证券股份有限公司党委副书记、执行委员会主任、总裁。现任国元证券股份有限公司党委书记、董事长, 兼任国元国际控股有限公司董事。

钟德兴先生, 董事, 学士, 注册会计师。曾任职多个金融机构, 包括新加坡安永会计师事务所、新加坡金融管理局、淡马锡控股私人有限公司和新加坡政府投资公司。现任新加坡星展银行有限公司策略规划部主管。

郑思祯女士, 董事, 学士。曾任美银亚洲有限公司副总裁, 星展银行(香港)有限公司银团贷款部董事总经理、星展银行香港分行大中型企业部主管和董事总经理(职级), 星展银行(中国)有限公司企业及机构银行业务部大中型企业部主管、副行长、董事总经理(职级)。现任星展银行(中国)有限公司行长/行政总裁、执行董事, 兼任深圳农村商业银行股份有限公司非执行董事, 星展科技产业(中国)有限公司的董事长。

郑锐先生, 董事, 博士。2010年7月加入安徽省投资集团, 历任综合发展部高级主管、安徽中安资本管理有限公司总经理助理兼综合发展部经理。现任安徽皖投资产管理有限公司董事、总经理, 兼任国元农业保险股份有限公司董事, 安徽安凯汽车股份有限公司董事, 长鑫科技集团股份有限公司董事, 安徽九华山旅游发展股份有限公司董事, 安徽小额再贷款股份有限公司董事, 数字安徽有限责任公司董事。

江娅女士, 董事, 博士。曾任蚌埠市粮贸公司办公室副主任, 蚌埠市政府办公室副主任科员、秘书三室副主任, 共青团蚌埠市委副书记、党组成员, 共青团蚌埠市委书记、党组书记, 蚌埠市蚌山区委副书记、区长, 蚌埠市委常委、宣传部长、政府副市长, 铜陵市委常委、市政府副市长、党组副书记。现任安徽省信用融资担保集团党委委员、副总经理。

张仁良先生, 独立董事, 博士。曾任香港教育大学校长、公共政策讲座教授、香港交通咨询委员会主席、第十三届中国全国政协委员、香港社会创新及创业发展基金专责小组主席、太平洋经济合作香港委员会主席、香港浸会大学工商管理学院院长、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席。2007年被委任为太平绅士, 2009年获香港特区政府颁发铜紫荆星章, 2017年获法国

政府颁发棕榈教育军官荣誉勋章，2019 年获香港特区政府颁发银紫荆星章。现任圣方济各大学校长、招商永隆银行有限公司独立董事兼副董事长。

李清伟先生，独立董事，博士。曾任上海财经大学教授、博士生导师，上海大学法学院执行院长。现任上海大学法学院教授、博士生导师、娱乐法研究中心主任，中国法学会立法学研究会常务理事、中国比较法研究会理事、中国法理学研究会理事、中国行为法学会金融法律行为研究会常务理事、上海市法学会外国法与比较法研究会副会长，上海市法理法史研究会副会长，澳门城市大学兼职教授、博士生导师，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，爱丽家居科技股份有限公司独立董事，浙江永和股份有限公司独立董事，张家港保税科技（集团）股份有限公司独立董事，上海董道律师事务所律师。

毕功兵先生，独立董事，博士研究生。曾任中国科学技术大学管理科学系主任、管理学院院长助理。现任中国科学技术大学教授，博士生导师，中国优选法统筹法与经济数学研究会常务理事，中国运筹学会随机服务与运作管理分会理事、秘书长，安徽国风新材料股份有限公司独立董事，安徽张恒春药业股份有限公司独立董事。

杜愚先生，独立董事，法律硕士。先后任职鞍山冶金设计研究院技术经济工程师、北京融融担保投资有限公司副总经理、国咨资产投资经营有限责任公司总经理、世纪投资有限公司（BVI）执行董事，北京仁杜律师事务所主任。现任北京仁杜律师事务所首席合伙人，兼任对外经济贸易大学国际经贸学院兼职研究生导师，北师大中国民营经济研究中心客座研究员。

## 2、管理层成员

胡甲先生，董事长，硕士，高级经济师。同上。

汤琰女士，总经理，硕士。同上。

蔡宾先生，硕士，特许金融分析师 CFA。曾任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，历任研究员、社保组合助理，投资经理，基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，基金经理，兼任长盛创富资产管理有限公司董事长（法定代表人）、总经理。

吴达先生，博士，特许金融分析师 CFA。曾任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、专户投资组

合经理, 新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员, 华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理。2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司, 历任基金经理, 长盛创富资产管理有限公司总经理、国际业务部总监等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理, 投资经理, 兼任长盛基金(香港)有限公司董事、执行副总经理、长盛基金管理有限公司北京分公司总经理。

张利宁女士, 学士, 注册会计师。曾任职于华北计算技术研究所财务部, 太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司。1999 年 1 月起加入长盛基金管理有限公司, 历任公司研究部业务秘书, 业务运营部基金会计、总监, 财务会计部总监, 监察稽核部副总监、总监等职务。现任长盛基金管理有限公司督察长, 兼任风险管理部总经理、长盛创富资产管理有限公司监事。

刁俊东先生, 硕士, 注册会计师。曾任合肥电缆厂财务核算主管、安徽省国际信托投资公司财务主管, 国际金融报社财务经理, 国元证券有限责任公司财务主管。2004 年 11 月加入长盛基金管理有限公司, 历任财务会计部副总监、总监、总经理助理。现任长盛基金管理有限公司财务负责人兼任董事会秘书、财务会计部总经理、总经理办公室总经理, 兼任长盛创富资产管理有限公司董事、长盛基金(香港)有限公司董事。

张壬午先生, 硕士。曾任深圳市远望城多媒体电脑公司软件网络部软件开发员, 深圳计量质量检测研究院技术部软件开发员。2000 年 3 月加入长盛基金管理有限公司, 历任信息技术部系统运营主管、信息技术部副总监、总监、行政负责人等职务。现任长盛基金管理有限公司首席信息官, 兼任信息技术部总经理。

### 3、本基金基金经理

陈亘斯先生, 硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师, 国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理, 北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司, 曾任基金经理助理, 现任量化投资部总经理助理。自 2019 年 5 月 30 日起担任长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理, 自 2019 年 5 月 30 日起担任长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金经理, 自 2019 年 10 月 9 日起担任长盛中证 A100 指数证券投资基金基金经理, 自 2019 年 10 月 9 日起担任长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基

金经理，自 2019 年 10 月 9 日起担任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起担任长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起担任长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2024 年 10 月 29 日起担任长盛北证 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金经理，自 2024 年 12 月 24 日起担任长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理，自 2025 年 8 月 12 日起担任长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，自 2025 年 11 月 11 日起担任长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2025 年 11 月 20 日起担任长盛上证科创板芯片指数发起式证券投资基金基金经理，自 2025 年 12 月 22 日起担任长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

石晓冉先生，硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员，中国人保资产管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理，万柏私募基金管理有限公司投资经理。2025 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2026 年 6 月 8 日起担任长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

刘斌先生，2010 年 8 月 4 日—2011 年 12 月 20 日任本基金基金经理；冯雨生先生，2011 年 12 月 20 日—2019 年 10 月 9 日任本基金基金经理。

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

#### 4、投资决策委员会成员

权益投资决策委员会成员：

汤琰女士，总经理，硕士。同上。

蔡宾先生，副总经理，硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

郭堃先生，硕士。曾任阳光资产管理股份有限公司行业研究员、制造业研究

组组长，泓德基金管理有限公司基金经理。2019 年 12 月加入长盛基金管理有限公司，历任研究部总监、公司副总经理等职务，现任公司首席投研专家，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理，长盛制造精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理，长盛优势企业精选混合型证券投资基金基金经理，长盛匠心研究精选混合型证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

张谊然女士，硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础研究员分析员。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司，现任权益投资部总经理，研究部总经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛成长精选混合型证券投资基金基金经理。

梁洁琼女士，硕士，特许金融分析师 CFA。曾任交银施罗德基金管理有限公司产品开发部产品经理，银华基金管理有限公司国际合作与产品开发部高级产品经理。2013 年 5 月加入长盛基金管理有限公司，历任产品开发部高级产品开发经理、副总监、行政负责人，现任量化投资部总经理，产品开发部总经理。

固定收益投资决策委员会成员：

汤琰女士，总经理，硕士。同上。

蔡宾先生，副总经理，硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

王贵君先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师，上投摩根基金管理有限公司债券研究员。2017 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任投资经理助理、投资经理、专户理财部副总监、固定收益部副经理，现任固定收益部总经理，长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛安逸纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

1.依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2. 办理基金备案手续;
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. 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;
5. 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得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;
6. 计算并公告基金净值, 确定基金份额申购、赎回价格;
7. 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;
8. 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
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. 办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;
12. 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、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, 不得向他人泄露;
13. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案, 及时向基金份额持有人分配收益;
14. 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;
15. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
16. 以基金管理人名义, 代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
17. 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;
18. 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, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

19.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

20.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

21.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;

22.执行生效的基金份额持有人大会决议;

23.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

24.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;

25.有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

#### (四) 基金管理人承诺

1、本基金管理人不得从事违反法律法规的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反法律法规行为的发生。

2、本基金管理人建立健全内部控制制度,采取有效措施,禁止将基金财产用于下列投资或活动:

(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) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

3、本基金管理人将加强人员管理,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,不从事以下行为:

(1) 越权或违规经营,违反基金合同或托管协议;

- (2) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;
- (3) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假;
- (4) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- (5) 玩忽职守、滥用职权;
- (6) 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;
- (7) 除按依法进行基金资产管理外, 直接或间接进行股票投资;
- (8) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、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) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

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

(4) 不以任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则:

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

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

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

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

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

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

## 2、完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”(董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部、风险管理部) 内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于公司风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况, 组织指导公司监察稽核、风险管理部工作, 对基金运作、内部管理的制度执行及遵纪守法进行检查监督; 公司风险控制委员会定期对基金资产运作的风险进行评估, 对存在的风险隐患或发现的风险问题进行研究; 监察稽核部通过日常的监督检查工作, 督促公司各部门持续完善且严格执行内控制度, 风险管理部通过全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度, 从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面及时和全面揭示各基金风险控制要素, 明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法, 全面加强对各基金投资合规风险监控。

## 3、内部控制制度的内容

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

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

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和危机处理制度等。公司基本管理制度在报经公司董事会批准后实施。

(3) 公司及部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上, 对公司及各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、业务流程和操作守则等的具体说明。公司及部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度, 并结合部门职责

和业务运作的要求拟定，其制定和实施需报经公司总经理办公会批准。

公司的内部控制制度根据法律法规变化和公司业务发展实际适时修订完善。公司各部门对规章制度的调整由监察稽核部负责检查与督促。

#### 4、内部控制制度评价与报告

公司建立了严格的内控制度评价程序和报告制度，以保证公司内部控制制度的合理性与有效性。部门负责人是本部门内部控制与风险管理的第一责任人，须定期检查本部门的风险控制情况和风险控制措施是否有效，对相应的内部控制制度的合理性、有效性做出评价，并根据检查、评价结果及时调整内控制度或修正行为。公司监察稽核部在各部门自我监督基础之上实施再监督，通过对各项制度执行情况定期、不定期的稽核，对各项制度的合理性与有效性进行检查评价，发现制度不合理的、不适用的，要求相关部门进行修改，同时报告公司总经理和督察长；发现制度未能有效执行、控制失效的，要求相关部门立即整改，并出具监察报告，及时向公司管理层和督察长报告。督察长就公司内控制度建设与执行情况定期向监管机构及公司董事会进行报告。

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987 年 3 月 31 日

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

注册资本：252.20 亿元

法定代表人：缪建民

行长：王小青（拟任）

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：4006195555

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张姗

#### 2、发展概况

招商银行于 1987 年在深圳创建，是中国境内第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，成立 38 年来逐步发展成为沪港两地上市，拥有商业银行、金融租赁、基金管理、人寿保险、境外投行、消费金融、理财子公司等金融牌照的银行集团。成立以来，招商银行始终坚持服务立行、创新驱动、科技兴行、人才强行，以自身转型发展助力社会经济高质量发展，全力服务居民和企业客户财富增长、资产安全、资金融通。截至 2026 年 3 月 31 日，本集团总资产 134,848.82 亿元人民币，高级法下资本充足率 17.76%，权重法下资本充足率 14.60%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队 10 个职能团队，现有员工 261 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行之一，拥有证券投资基金托管资格、

基本养老保险基金托管机构资格、受托投资管理托管业务托管资格、保险资金托管业务资格、企业年金基金托管业务资格、合格境外机构投资者托管 (QFII) 资格、合格境内机构投资者托管 (QDII) 资格、私募基金业务外包服务资格、存托凭证试点存托业务等业务资格。

招商银行资产托管结合自身在托管行业深耕 24 年的专业能力和创新精神,推出“招商银行托管+”服务品牌,以“践行价值银行战略,致力于成为专业更精、科技更强、服务更佳的客户首选全球托管银行”品牌愿景为指引,以“值得信赖的专家、贴心服务的管家、让价值持续增加、客户的体验更佳”的“4+目标”,以创新的“服务产品化”为方法论,全方位助力资管机构实现可持续的高质量发展。招商银行资产托管围绕资管全场景,打造了“如风运营”“大观投研”“见微数据”三个服务子品牌,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6S”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,推出国内首个托管大数据平台,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,近年来获得业内各类奖项荣誉。2016 年 5 月“托管通”荣获《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获得该奖项的托管银行;7 月荣获中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”、《21 世纪经济报道》“2016 最佳资产托管银行”。2017 年 5 月荣获《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”;6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”;“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”。2018 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖;同月,托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖;3 月荣获《中国基金报》“最佳基金托管银

行”奖；5月荣获国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣获2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12月荣获2019东方财富风云榜“2019年度最佳托管银行”奖。2020年1月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2019年度优秀资产托管机构”奖项；6月荣获《财资》“中国境内最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；10月荣获《中国基金报》第二届中国公募基金英华奖“2019年度最佳基金托管银行”奖。2021年1月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2020年度优秀资产托管机构”奖项；同月荣获2020东方财富风云榜“2020年度最受欢迎托管银行”奖项；2021年10月，《证券时报》“2021年度杰出资产托管银行天玑奖”；2021年12月，荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖“2020年度最佳基金托管银行”；2022年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2021年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构”奖项；9月荣获《财资》“中国最佳托管银行”“最佳公募基金托管银行”“最佳理财托管银行”三项大奖；12月荣获《证券时报》“2022年度杰出资产托管银行天玑奖”；2023年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2022年度优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司“2022年度优秀托管机构”、全国银行间同业拆借中心“2022年度银行间本币市场托管业务市场创新奖”三项大奖；2023年4月，荣获《中国基金报》第二届中国基金业创新英华奖“托管创新奖”；2023年9月，荣获《中国基金报》中国基金业英华奖“公募基金25年基金托管示范银行（全国性股份行）”；2023年12月，荣获《东方财富风云榜》“2023年度托管银行风云奖”。2024年1月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2023年度优秀资产托管机构”、“2023年度估值业务杰出机构”、“2023年度债市领军机构”、“2023年度中债绿债指数优秀承销机构”四项大奖；2024年2月，荣获泰康养老保险股份有限公司“2023年度最佳年金托管合作伙伴”奖。2024年4月，荣获中国基金报“中国基金业英华奖-ETF20周年特别评选“优秀ETF托管人”奖。2024年6月，荣获上海清算所“2023年度优秀托管机构”奖。2024年8月，在《21世纪经济报道》主办的2024

资产管理年会暨十七届 21 世纪【金贝】资产管理竞争力研究案例发布盛典上，“招商银行托管+”荣获“2024 卓越影响力品牌”奖项；2024 年 9 月，在 2024 财联社中国金融业“拓扑奖”评选中，荣获银行业务类奖项“2024 年资产托管银行‘拓扑奖’”；2024 年 12 月，荣获《中国证券报》“ETF 金牛生态圈卓越托管机构（银行）奖”；2024 年 12 月，荣获《2024 东方财富风云际会》“年度托管银行风云奖”。2025 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2024 年度优秀资产托管机构”奖项、上海清算所“2024 年度优秀托管机构”奖项；2025 年 2 月，荣获全国银行同业拆借中心“2024 年度市场创新业务机构”奖项；2025 年 3 月，荣获《中国基金报》2025 年指数生态圈英华典型案例“指数产品托管机构”奖项；2025 年 6 月，荣获《亚洲银行家》“中国最佳托管银行”“中国最佳股份制托管银行”奖项。2025 年 8 月，在《21 世纪经济报道》主办的 2025 资产管理年会暨十八届 21 世纪【金贝】资产管理竞争力案例发布盛典上，“招商银行托管+”荣获“2025 卓越影响力品牌”奖项。2025 年 12 月，荣获《2025 东方财富风云际会》“年度托管银行风云奖”。2026 年 1 月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2025 年度优秀资产托管机构”奖项。

## （二）主要人员情况

缪建民先生，招商银行董事长、非执行董事，2020 年 9 月起担任招商银行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险(集团)公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险(香港)有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王小青先生，招商银行党委书记，复旦大学政治经济学博士。曾任中国人保资产管理有限公司总裁助理、副总裁兼财务负责人，招商基金管理有限公司总经理、董事长，招商银行行长助理兼深圳分行行长、招商银行副行长，招商局金融控股有限公司总经理。曾兼任招商信诺人寿保险有限公司董事长、招商信诺资产管理有限公司董事长。

王颖女士，招商银行副行长，南京大学政治经济学专业硕士，经济师。王颖女士 1997 年 1 月加入招商银行，历任招商银行北京分行行长助理、副行长，天津分行行长，深圳分行行长，招商银行行长助理。2023 年 11 月起任招商银行副行长。

孙乐女士，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，2001 年 8 月加入招商银行至今，历任招商银行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长；2021 年 10 月起先后任招商银行资产托管部负责人、资产托管部总经理，具有 20 余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2026 年 3 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 1813 只证券投资基金。

### （四）托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，坚持守法经营、规范运作的经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

#### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；总行风险管理部、法律合规部、审计部独立对资产托管业务进行评估监督，并提出内控提升管理建议。

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立风险合规管理相关团队，负责部门内部风险预防和控制，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况，并直接向部门总经理室报告。

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时,遵循内部控制制衡原则,视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

### 3、内部控制原则

(1) 全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位,并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点,体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立,不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

(4) 有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险,且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格有效执行。

(5) 适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要,并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

(6) 防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与我行其他业务场地隔离,办公网和业务网物理分离,部门业务网和全行业务网防火墙策略分离,以达到风险防范的目的。

(7) 重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上,关注重要托管业务重要事项和高风险环节。

(8) 制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置、权责分配及业务流程等方面相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。

### 4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度,建立了三层制度体系,即:基本规定、业务管理办法和业务操作规程。制度结构层次清晰、管理要求明确,满足风险管理全覆盖的要求,保证资产

托管业务科学化、制度化、规范化运作。

(2) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施,采用加密、直连方式传输数据,数据执行异地实时备份,所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

(3) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中获取的客户资料严格保密,除法律法规和其他有关规定、监管机构及审计要求外,不向任何机构、部门或个人泄露。

(4) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统机房、权限管理实行双人双岗双责,电脑机房 24 小时值班并设置门禁,所有电脑设置密码及相应权限。业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护,对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等,保证信息技术系统的安全。

(5) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制,有效地进行人力资源管理。

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定,对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督,对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行,并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定,及时以书面形式通知基金管理人进行整改,整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

#### 1、直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

注册地址: 深圳市福田区福田中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

办公地址: 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3 层

法定代表人: 胡甲

电话: (010) 86497908、(010) 86497962

传真: (010) 86497997、(010) 86497998

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

#### 2、其他销售机构

##### (1) 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人: 缪建民

客户服务电话: 95555

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

##### (2) 华夏银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人: 李民吉

客户服务电话: 95577

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

##### (3) 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: 任德奇

客户服务电话: 95559

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

(4) 平安银行股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

办公地址: 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号平安银行大厦

法定代表人: 谢永林

客户服务电话: 95511-3

公司网址: [bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

(5) 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: 张为忠

客户服务电话: 95528

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

(6) 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址: 上海市浦东新区银城路 167 号

法定代表人: 吕家进

客户服务电话: 95561

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

(7) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 廖林

客户服务电话: 95588

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

(8) 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: 张金良

客户服务电话: 95533

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

(9) 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: 高迎欣

客户服务电话: 95568

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

(10) 中国农业银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 谷澍

客户服务电话: 95599

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

(11) 中国银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 葛海蛟

客户服务电话: 95566

公司网址: [www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(12) 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: 郑国雨

客户服务电话: 95580

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

(13) 中信银行股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址: 北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

法定代表人: 方合英

客户服务电话: 95558

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

(14) 宁波银行股份有限公司

注册地址: 浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址: 浙江省宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人: 陆华裕

客户服务电话: 95574

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

(15) 江苏银行股份有限公司

注册地址: 南京市中华路 26 号

办公地址: 南京市中华路 26 号

法定代表人: 葛仁余

客户服务电话: 95319

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

(16) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

办公地址: 广东省东莞市东城区鸿福东路 2 号

法定代表人: 卢国锋

客服电话: (0769)961122

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

(17) 中信期货有限公司

注册地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

客服电话: 400-990-8826

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

(18) 国泰海通证券股份有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址: 上海市静安区南京西路 768 号

法定代表人: 朱健

客服电话: 95521

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

(19) 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: 北京市朝阳区光华路 10 号

法定代表人: 王常青

客服电话: 400-888-8108

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(20) 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: 深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 37 楼

法定代表人: 张纳沙

客服电话: 95536

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

(21) 招商证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址: 深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

法定代表人: 霍达

客服电话: 95565/400-8888-111

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

(22) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)

办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人: 孙树明

客服电话: 95575 或致电各地营业网点

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

(23) 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: 张佑君

客服电话: 95548

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

(24) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址: 北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人: 王晟

客服电话: 95551/400-8888-888

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

(25) 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

客服电话: 95562

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

(26) 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: 上海市世纪大道 1198 号一座世纪汇广场 29 楼

法定代表人: 李新华

客服电话: 95579/400-8888-999

网址: [www.95579.com](http://www.95579.com)

(27) 湘财证券股份有限公司

注册地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址: 湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人: 高振营

客服电话: 95351

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

(28) 民生证券股份有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区浦明路 8 号

办公地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区浦明路 8 号

法定代表人: 景忠

客服电话: 95376

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

(29) 国元证券股份有限公司

注册地址: 中国安徽省合肥市梅山路 18 号

办公地址: 安徽省合肥市梅山路 18 号安徽国际金融中心 A 座国元证券

法定代表人: 沈和付

客服电话: 95578

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

(30) 渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址: 天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人: 安志勇

客服电话: 956066

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

(31) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人: 周易

客服电话: 95597

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

(32) 山西证券股份有限公司

注册地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

客服电话: 400-666-1618、95573

网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(33) 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

法定代表人: 冯恩新

客服电话: 95548

网址: [sd.citics.com](http://sd.citics.com)

(34) 东兴证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址: 北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人: 魏庆华

客服电话: 400-888-8993

网址: [www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

(35) 信达证券有限公司

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: 祝瑞敏

客服电话: 95321

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

(36) 东方证券股份有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦

办公地址: 上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦, 上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 3-6 层, 12 层, 13 层, 22 层, 25-27 层, 29 层, 32 层, 36 层, 38 层

法定代表人: 金文忠

客服电话: 021-63325888

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

(37) 方正证券股份有限公司

注册地址: 湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼  
3701-3717

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 17 层

法定代表人: 施华

客服电话: 95571

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

(38) 长城证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人: 黄耀华

客服电话: 0755-33680000,400-6666-888

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

(39) 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: 刘秋明

客服电话: 95525

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

(40) 中信证券华南股份有限公司

注册地址: 广州市天河区临江大道 395 号 901 室 (部位: 自编 01 号) 1001 室 (部位: 自编 01 号)

办公地址: 广州市天河区临江大道 395 号 901 室 (部位: 自编 01 号) 1001 室 (部位: 自编 01 号)

法定代表人: 陈可可

客服电话: 95548

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

(41) 东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市生态大街 6666 号

办公地址: 长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

客服电话: 95360

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(42) 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: 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人: 何伟

客服电话: 400-8918-918

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

(43) 平安证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址: 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人: 何之江

客服电话: 95511-8

网址: [stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(44) 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: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人: 章宏韬

客服电话: 95318

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

(45) 国海证券股份有限公司

注册地址: 广西桂林市辅星路 13 号

办公地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 张雅锋

客服电话: 95563

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

(46) 东莞证券股份有限公司

注册地址: 广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址: 广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人: 陈照星

客服电话: 95328

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

(47) 东海证券股份有限公司

注册地址: 江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人: 王文卓

客服电话: 95531/400-8888-588

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

(48) 华西证券股份有限公司

注册地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

办公地址: 四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人: 杨炯洋

客服电话: 95584

网址: [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(49) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

办公地址: 新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦  
20 楼 2005 室

法定代表人: 王献军

客服电话: 95523/400-8895-523

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

(50) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼

办公地址: 济南市高新区经十路 7000 号汉峪金融商务中心五区 3 号楼

法定代表人: 王洪

客服电话: 95538

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

(51) 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 20 楼

法定代表人: 刘学民

客服电话: 95358

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

(52) 德邦证券股份有限公司

注册地址: 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址: 上海市黄浦区中山东二路 600 号外滩金融中心 S2 幢 22 楼

法定代表人: 武晓春

客服电话: 400-888-8128

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

(53) 西部证券股份有限公司

注册地址: 陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址: 陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人: 徐朝晖

客服电话: 95582

网址: [www.west95582.com](http://www.west95582.com)

(54) 华福证券股份有限公司

注册地址: 福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址: 上海市浦东新区滨江大道 5129 号 N1 座

法定代表人: 苏军良

客服电话: 95547

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

(55) 华龙证券股份有限公司

注册地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

办公地址: 兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼

法定代表人: 祁建邦

客服电话: 95368

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

(56) 中国国际金融股份有限公司

注册地址: 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址: 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人: 丁学东

客服电话: 400-910-1166

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

(57) 财通证券股份有限公司

注册地址: 浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

办公地址: 浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

法定代表人: 章启诚

客服电话: 95336

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

(58) 五矿证券有限公司

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

办公地址: 深圳市南山区滨海大道与后海滨路交汇处滨海大道 3165 号五矿金融大厦 (18-25 层)

法定代表人: 黄海洲

客服电话: 400-1840-028

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

(59) 华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A

办公地址: 上海市徐汇区云锦路 277 号西岸数字谷二期 T3

法定代表人: 俞洋

客服电话: 95323/400-1099-918

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

(60) 中国中金财富证券有限公司

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

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

法定代表人: 高涛

客服电话: 95532/400-600-8008

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

(61) 中山证券有限责任公司

注册地址: 深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址: 深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人: 李永湖

客服电话: 95329

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

(62) 红塔证券股份有限公司

注册地址: 昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址: 昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人: 况雨林

客服电话: 0871-3577930

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

(63) 粤开证券股份有限公司

注册地址: 广州经济技术开发区科学大道 60 号开发区控股中心 21、22、23 层

办公地址: 深圳市福田区深南大道 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人: 严亦斌

客服电话: 95564

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

(64) 江海证券有限公司

注册地址: 哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 哈尔滨市松北区创新三路 833 号

法定代表人: 赵洪波

客服电话: 956007

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

(65) 国金证券有限公司

注册地址: 四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址: 四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人: 冉云

客服电话: 95310

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

(66) 华宝证券股份有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

办公地址: 上海市浦东新区浦电路 370 号宝钢大厦华宝证券 5 楼

法定代表人: 刘加海

客服电话: 400-820-9898

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

(67) 国新证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦

法定代表人: 张海文

客服电话: 95390

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

(68) 天风证券股份有限公司

注册地址: 武汉东湖新技术开发区高新大道 446 号天风证券大厦 20 层

办公地址: 湖北省武汉市武昌区中北路 217 号天风大厦 2 号楼 19 楼

法定代表人: 余磊

客服电话: 95391

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

(69) 首创证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安定路 5 号院 13 号楼 A 座 11-21 层

办公地址: 北京市朝阳区安定路 5 号院北投投资大厦 A 座 18 层

法定代表人: 毕劲松

客服电话: 95381

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

(70) 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学院路 77 号黄龙国际中心 E 座

法定代表人: 王珺

客服电话: 95188-8400

公司网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(71) 腾安基金销售 (深圳) 有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区南山街道听海大道 5212 号腾讯数码大厦  
2 栋 (南塔) L1401-L1501

办公地址: 深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 层

法定代表人: 谭广锋

客服电话: 4000-890-555

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

(72) 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 号楼二层

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

客服电话: 400-1818-188

公司网站: <http://www.1234567.com.cn>

(73) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区知春路 76 号 (写字楼) 1 号楼 4 层 1-7-2

办公地址: 北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

## 2 号楼

法定代表人：邹保威

客服电话：

个人业务：95118,4000988511

企业业务：4000888816

公司网址：[kenterui.jd.com](http://kenterui.jd.com)

(74) 东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

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：戴彦

客服电话：95357

公司网站：<http://www.18.cn>

(75) 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 6 层

办公地址：上海市闵行区申滨南路 1226 号诺亚财富中心

法定代表人：王强

客服电话：400-821-5399

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(76) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼

办公地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼

法定代表人：陈祎彬

客服电话：4008219031

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

(77) 北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 17 层

法定代表人：钟斐斐

客服电话：400-0618-518

公司网址: <https://danjuanapp.com>

(78) 博时财富基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

办公地址: 深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 19 层

法定代表人: 王德英

客服电话: 4006105568

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

(79) 上海中欧财富基金销售有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室

办公地址: 上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 层

法定代表人: 郑焰

客服电话: 400-100-2666

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

(80) 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路 18 号同花顺大楼

法定代表人: 凌顺平

客服电话: 4008-773-772

公司网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(81) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址: 上海浦东新区张扬路 500 号华润时代广场 10F、11F、14F

法定代表人: 陶怡

客服电话: 400-700-9665

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

(82) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

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

客服电话: 400-820-5369

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

(83) 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 11 层 A 座 1108

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 401

法定代表人: 王伟刚

客户服务电话: 010-63158805

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

(84) 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

客户服务电话: 400-920-0022

公司网址: [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(85) 嘉实财富管理有限公司

注册地址: 海南省三亚市天涯区三亚湾路国际客运港区国际养生度假中心酒店 B 座(2#楼)27 楼 2714 室

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层

法定代表人: 张峰

客户服务电话: 400-021-8850

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

(86) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址: 上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室

办公地址: 上海市虹口区溧阳路 735 号 2 幢 3 层

法定代表人: 尹彬彬

客户服务电话: 400-118-1188

公司网址: [www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

(87) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园  
2 栋 3401

办公地址: 北京市丰台区丽泽平安幸福中心 B 座 7 层

法定代表人: 张斌

客户服务电话: 4001661188-2

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

(88) 泰信财富基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

办公地址: 北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

法定代表人: 彭浩

客服电话: 4000048821

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

(89) 玄元保险代理有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人: 马永谔

客户服务电话: 400-080-8208

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

(90) 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 1201-1203 室

法定代表人: 肖雯

客户服务电话: 020-89629066

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

(91) 北京度小满基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人: 葛新

客户服务电话: 95055-4

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

(92) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址: 海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

法定代表人: 李科

客户服务电话: 95510

公司网址: <http://fund.sinosig.com>

(93) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

办公地址: 深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路 8 号 HALO 广场一期四层 12-13 室

法定代表人: 薛峰

客服电话: 4006-788-887

公司网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn); [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(94) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

办公地址: 上海市浦东新区世博大道 1515 号世博天地写字楼 T1 栋 17 楼

法定代表人: 贾志伟

客服电话: 400-820-9935

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

(95) 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: 上海市浦东新区滨江大道 1111 弄 1 号中企国际金融中心 A 楼 6 楼

法定代表人: 张跃伟

客服电话: 4008202899

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

(96) 上海大智慧基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人: 申健

客服电话: 021-20292031

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

(97) 奕丰基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 (入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人: TEOWEEHOWE

客服电话: 400-684-0500

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

(98) 大连网金基金销售有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人: 卜勇

客服电话: 4000-899-100

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

(99) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 钱燕飞

客服电话: 95177

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

(100) 上海万得基金销售有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址: 上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人: 王廷富

客服电话: 400-799-1888

公司网址: <http://www.520fund.com.cn>

(101) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

办公地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

法定代表人: 吕柳霞

客服电话: 021-50810673

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

(102) 青岛意才基金销售有限公司

注册地址: 山东省青岛市市南区延安三路 234 号海航万邦中心 18 层

法定代表人: GiambertoGiraldo

客户服务电话: 400-612-3303

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

(103) 上海攀赢基金销售有限公司

注册地址: 上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址: 上海市浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 703 室

法定代表人: 郑新林

客户服务电话: 021-68889082

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

(104) 和耕传承基金销售有限公司

注册地址: 河南自贸试验区郑州片区 (郑东) 东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

办公地址: 河南自贸试验区郑州片区 (郑东) 东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人: 温丽燕

客户服务电话: 400-0555-671

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

(105) 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人: 梁蓉

客户服务电话: 010-66154828

网址: [www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(106) 上海陆享基金销售有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼 01、08 单元

法定代表人: 栗旭

客户服务电话: 4001681235

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

(107) 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 (公司地址): 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: 毛淮平

客户服务电话: 400-817-5666

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

(108) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址: 南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址: 南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人: 吴言林

客服电话: 025-66046166

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

(109) 通华财富 (上海) 基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址: 上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层

法定代表人: 沈丹义

客服电话: 400-101-9301

公司网址: <https://www.tonghuafund.com>

(110) 华瑞保险销售有限公司

注册地址: 上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座  
14 层

办公地址: 上海市向城路 288 号国华金融大厦 8 楼

法定代表人: 杨新章

客户服务电话: 952303

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

(111) 北京济安基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005

办公地址: 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005

法定代表人: 杨健

客户服务电话: 400-673-7010

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

(112) 一路财富 (北京) 基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道 3046 号香江金融大厦

2111

办公地址: 深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道 3046 号香江金融大厦

2111 法定代表人: 吴雪秀

客户服务电话: 400-001-1566

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

(113) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 6 层

法定代表人: 闫振杰

客户服务电话: 400-818-8000

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

(114) 华源证券股份有限公司

注册地址: 青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址: 湖北省武汉市江汉区万松街道青年路 278 号中海中心 32F-34F

法定代表人: 邓晖

客户服务电话: 95305-8

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

(115) 深圳前海微众银行股份有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 (入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 广东省深圳市南山区田厦金牛广场 A 座 36 楼、37 楼

法定代表人: 顾敏

客服电话: 400-999-8800

公司网址: <http://www.webank.com>

(116) 中国人寿保险股份有限公司

注册地址: 中国北京市西城区金融大街 16 号

办公地址: 中国北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人: 王滨

电话: 010-63631752

官网: [www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

(117) 易方达财富管理基金销售 (广州) 有限公司

注册地址: 广州市南沙区横沥镇期航二街 2 号 101 房

办公地址: 广东省广州市天河区珠江东路 30 号广州银行大厦 41 楼

法定代表人: 陈彤

客服电话: 4001608888

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

### 3. 场内代销机构

本基金办理场内认购业务的代销机构为具有基金代销业务资格的深交所会员。具有中国证监会认定的基金代销业务资格且符合风险控制要求的深交所会员单位可以办理本基金的场内申购业务; 具有中国证监会认定的基金代销业务资格的深交所会员单位可以办理本基金的场内赎回业务。

#### (二) 注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

办公地址: 中国北京西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

客户服务热线：4008058058

(三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海市海华永泰律师事务所

注册地址：上海市华阳路 112 号 2 号楼东虹桥法律服务园区 302 室

办公地址：上海市陆家嘴环路 1366 号富士康大厦 12 层

负责人：陈峰

电话：(021) 58773177

传真：(021) 58773268

联系人：张兰

经办律师：梁丽金、张兰

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所 (特殊普通合伙)

住所：上海市黄浦区汉口路 99 号久事商务大厦 11 楼

办公地址：上海市黄浦区汉口路 99 号久事商务大厦 11 楼

执行事务合伙人：朱建弟、杨志国

联系电话：021-23281358

传真：021-23280000

联系人：杨婧

经办注册会计师：吴凌志、杨婧

## 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，并经中国证监会 2010 年 5 月 14 日证监许可[2010]646 号文以及 2010 年 6 月 20 日《关于长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）募集时间安排的确认函》（基金部函[2010]372 号）的核准，募集发售。

### （一）基金运作方式和类型

运作方式：上市契约型开放式

基金类型：股票型基金

### （二）基金的存续期间

不定期

### （三）募集概况

本基金自 2010 年 6 月 28 日起向全社会公开募集，截至 2010 年 7 月 28 日募集工作结束。

经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的有效净认购金额为 898,648,405.80 元人民币，折合基金份额 898,648,405.80 份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 267,463.53 元人民币，折合基金份额 267,463.53 份。本次募集所有资金已于 2010 年 8 月 3 日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管专户。本次募集有效认购户数为 12,976 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 898,915,869.33 份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费等费用，不从基金财产中列支。

## 七、基金合同的生效

《基金合同》生效后,连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时,从其规定。

## 八、基金份额的上市与交易

基金合同生效后,基金管理人可以根据有关规定,申请本基金的基金份额上市交易。基金份额上市后,投资人可通过深圳证券交易所内的会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额。本基金A类基金份额上市交易,本基金C类基金份额暂不参与上市交易。

### (一) 上市交易的地点

深圳证券交易所。

### (二) 上市交易的时间

本基金拟在基金合同生效后3个月内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人最迟在上市前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

本基金上市交易日期:2010年9月6日

### (三) 上市交易的规则

本基金的上市交易按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

### (四) 上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定办理。

### (五) 上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### (六) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会有关规定和深圳证券交易所的相关业务规则执行。

(七) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,基金合同相应予以修改,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 九、基金份额的场外申购、转换与赎回

本基金A类基金份额可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回，C类基金份额仅可通过场外方式办理申购与赎回。

本章内容仅适用于本基金的场外申购和赎回业务。

### (一) 场外申购与赎回业务办理的场所

投资人可在以下场所办理基金申购与赎回等业务：

- 1、本基金管理人的直销网点。
- 2、不通过深圳证券交易所交易系统办理申购、赎回及相关业务的场外代销机构的代销网点。

具体销售机构由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明或基金管理人网站公示。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、转换与赎回的场所，并予以公告或公示。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### (二) 场外申购与赎回的开放日及办理时间

本基金A类份额申购开始日：2010年9月6日

本基金A类份额赎回开始日：2010年9月6日

本基金C类份额申购开始时间：2024年6月18日

本基金C类份额赎回开始时间：2024年6月18日

申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为证券交易所的交易时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券市场或证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对开放日及开放时间进行调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》在指定媒体上公告。

### (三) 场外申购与赎回的原则

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，即按照投资人申（认）购的先后次序进行顺序赎回；

4、“全额缴款”原则，投资人申购基金时，必须全额交付申购款项，只有在投资人全额交付申购款项后，申购申请方为有效；

5、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

6、本基金暂不采用摆动定价机制。

基金管理人可依法调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （四）场外申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式：书面申请或销售机构公布的其他方式。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金管理人在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申请的确认以基金管理人的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在基金管理人和销售机构规定的时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将把投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，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，赎回的处理办法请参见本基金招募说明书的有关条款处理。

#### （五）场外申购和赎回基金份额的注册登记

投资人申购申请成功后, 注册登记机构在T+1日为投资人办理增加权益的登记手续, 投资人自T+2日起可赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金份额成功后, 注册登记机构在T+1日为投资人办理扣除权益的登记手续。

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人的合法权益, 并于开始实施前依照《信息披露办法》在指定媒体上公告。

#### (六) 场外申购与赎回的限制

##### 1、申购金额的限制

本基金场外申购最低金额为1元人民币。各代销机构对本基金最低申购金额另有规定的, 以各代销机构的业务规定为准。

##### 2、投资者赎回份额不设限制。

3、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。

4、基金管理人可根据市场情况, 在法律法规允许的情况下, 对上述限制性规定进行调整。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》在指定媒体上公告。

#### (七) 场外申购费用和赎回费用

##### 1、申购费用

本基金A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的基金申购人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金C类基金份额不收取申购费。本基金的A类基金份额的申购费率不高于1.5%, 随申购金额的增加而递减, 适用以下收费费率标准:

申购金额 (M)	A类基金份额的申购费率	A类基金份额的养老金特定客户申购费率
M<100万元	1.20%	0.36%
100万元≤M<500万元	0.80%	0.24%

500万元≤M<1000万元	0.50%	0.15%
M≥1000万元	单笔1000元	单笔1000元

养老金特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

## 2、赎回费用

本基金A类基金份额的场外赎回费率如下：

持有期限 (Y)	赎回费率
Y<7天	1.50%
7天≤Y<1年	0.50%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注：1年=365天

A类基金份额的赎回费用由赎回A类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回A类基金份额时收取。对持续持有期少于7天的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费的25%计入基金财产。上述未纳入基金财产的赎回费用用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金C类基金份额的赎回费率如下：

持有期限 (Y)	赎回费率
Y<7天	1.5%
Y≥7天	0

C类基金份额的赎回费用由赎回C类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回C类基金份额时收取。对C类基金份额持有人收取的赎回费，将全额计入基金财产。

基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式，最新

的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### (八) 场外申购份额与赎回金额的处理方式及计算

##### 1、申购份额与赎回金额的处理方式:

(1) 申购份额、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,以有效申请当日基金份额净值为基准计算,四舍五入保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担;

(2) 赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以有效申请当日基金份额净值并扣除相应的费用,四舍五入保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

##### 2、本基金申购份额的计算:

本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

(1) 本基金 A 类基金份额申购份额的计算如下:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购金额在1000万元以上的适用固定金额的申购费,即净申购金额=申购金额-固定申购费金额。

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T日A类基金份额净值

例:某投资者(非养老金特定客户)投资100,000元申购本基金A类基金份额,假设申购当日的A类基金份额净值为1.0160元,则其可得到的申购份额为:

申购金额	100,000元
A类基金份额净值 (NAV)	1.0160元

净申购金额	$100,000 / (1+1.2\%) = 98,814.23$ 元
申购费用	$100,000 - 98,814.23 = 1185.77$ 元
申购份额	$98,814.23 / 1.016 = 97258.10$ 份

(2) 本基金C类基金份额申购份额的计算如下:

申购份额=申购金额/T日C类基金份额净值

例: 某投资人投资100,000元申购本基金的C类基金份额, 假设申购当日的C类基金份额净值为1.0150元, 则其可得到的申购份额为:

申购份额=100,000/1.0150=98,522.17份

### 3、本基金赎回支付金额的计算:

本基金以赎回总额为基数采用比例费率计算赎回费用。本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,

赎回总额=T日申请份额×T日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例: 某投资人持有本基金 50,000.00 份场外本基金 A 类份额, 持有 0.8 年时决定赎回, 假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1500 元, 则其获得的赎回金额计算如下:

赎回金额=50,000.00×1.1500=57,500.00 元

赎回费用=57,500.00×0.5%=287.50 元

净赎回金额=57,500.00-287.50=57,212.50 元

即投资人赎回本基金50,000.00份场外A类基金份额, 持有0.8年, 假设赎回当日A类基金份额净值为1.1500元, 则其获得的净赎回金额为57,212.50元。

### 4、基金份额净值的计算公式为:

由于基金费用的不同, 本基金 A 类和 C 类两类基金份额分别计算基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算, 均保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此误差产生的损失或收益由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值在当日收市后计算, 并在 T+1 日内公告。遇特殊情况, 履行适当程序后, 可以适当延迟计算或公告。

T 日某类基金份额净值=T 日该类基金资产净值/T 日该类基金份额总数

(九) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时, 基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
4. 接受某笔或某些申购申请会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。
5. 基金资产规模过大, 使基金管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对基金业绩产生负面影响, 从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
6. 接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50% 以上时。
7. 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时, 基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝, 被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

(十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时, 基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市, 导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
4. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价

格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与基金托管人协商确认后, 基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

#### 6. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时, 基金管理人应在指定媒介上刊登公告, 已接受的赎回申请, 基金管理人应足额支付; 如暂时不能足额支付, 应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人, 未支付部分可延期支付, 并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回, 延期支付最长不得超过 20 个工作日, 并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时, 基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### (十一) 巨额赎回的情形及处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回: 当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时, 基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下, 可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请, 应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例, 确定当日受理的赎回份额; 对于未能赎回部分, 投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的, 将自动转入下一个开放日继续赎回, 直到全部赎回为止; 选择取消赎回的, 当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理, 无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额, 以此类推, 直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择, 投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 若本基金发生巨额赎回的, 且存在单个基金份额持有人单日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10% 以上的情形下, 基金管理人可以对该基金份

额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的部分进行自动延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请,应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日,并与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权且以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,基金份额持有人未能赎回部分作延期赎回处理。

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

### 3.巨额赎回的公告

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

#### (十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1.发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人应在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2.如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3.如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4.如发生暂停的时间超过 2 周,暂停期间,基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应按照《信息披露办法》在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

#### (十三) 基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

#### (十四) 定期定额投资计划

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

#### (十五) 基金的冻结和解冻

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,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的,对冻结部分产生的权益一并冻结。

#### (十六) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“十一、基金的侧袋机制”或相关公告。

## 十、基金份额的场内申购与赎回

本基金A类基金份额可通过场内或场外两种方式办理申购与赎回，C类基金份额暂不开通场内申购与赎回。

本章内容仅适用于本基金通过深交所会员单位办理的场内申购和赎回业务。

### (一) 投资人范围

中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）以及合格的境外机构投资者，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。

### (二) 使用账户

投资人通过深交所场内申购、赎回基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项详见本基金份额发售公告）。

### (三) 场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位（具体名单见开放申购赎回公告）。

深交所场内申购赎回业务办理单位的名单（有可能进行调整或变更）可在深交所网站查询。

### (四) 申购与赎回的办理时间

本基金A类份额申购开始日：2010年9月6日

本基金A类份额赎回开始日：2010年9月6日

本基金C类基金份额暂不开通场内申购与赎回。

申购和赎回的开放日为上海、深圳证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日业务办理具体时间为深圳交易所的交易时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，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、赎回开放日及开放时间进行调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》在指定媒体上公告。

#### (五) 场内申购和赎回的原则

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、投资者通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回业务时,需遵守深圳证券交易所的相关业务规则;

4、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

5、本基金暂不采用摆动定价机制。

基金管理人可依法调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》在指定媒体上公告。

#### (六) 场内申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深交所场内申购赎回相关业务规则,在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金,否则所提交的申购申请无效。

投资人在提交赎回申请时,应确保账户内有足够基金份额余额,否则赎回申请无效。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人以交易时间结束前收到申购和赎回有效申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金管理人在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下,T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。基金销售机构对申购或赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购或赎回申请的确认以基金管理人的确认结果为准。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式, 若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人账户。

投资人赎回申请成功后, 基金管理人按有关规定将在T+7日 (包括该日) 内支付赎回款项。

当出现巨额赎回时, 场内赎回申请按照深圳证券交易所相应规则进行处理。

#### (七) 场内申购和赎回的数额限制

1、单笔场内申购的最低金额为1,000元。

2、基金管理人可根据市场情况, 在相关法律法规允许的前提下, 调整上述限制。如调整上述限制的, 基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

3、申购份额、余额的处理方式: 本基金的有效申购份额由申购金额扣除申购费用后除以申购申请当日的基金份额净值确定。基金份额份数保留到整数位, 整数位后小数部分的份额对应的资金返还给投资人。

4、赎回金额的处理方式: 本基金的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元, 赎回金额保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分四舍五入, 由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

5、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。

#### (八) 申购费用和赎回费用

1、本基金A类份额的申购费用由申购A类基金份额的基金申购人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金A类基金份额的申购费率如下表所示:

单笔金额 (M)	收费标准
M<100万元	1.20%
100万元≤M<500万元	0.80%

500万元≤M<1000万元	0.50%
M≥1000万元	单笔1000元

2、基金份额持有人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7天的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费的25%计入基金财产。上述未纳入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金A类基金份额场内赎回费率如下：

持有基金份额期限 (Y)	收费标准
Y<7天	1.50%
Y≥7天	0.50%

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### (九) 场内申购份额和赎回金额的计算方式

##### 1、A类基金份额申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购金额在1000万元以上的适用固定金额的申购费，即净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额。

申购手续费 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T日A类基金份额净值

场内申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例：某投资人通过场内投资10,000元申购本基金A类基金份额，对应的申购费率为1.2%，假设申购当日A类基金份额净值为1.0250元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 = 10,000 / (1 + 1.2%) = 9,881.42元

申购手续费 = 10,000 - 9,881.42 = 118.58元

申购份额 = 9,881.42 / 1.0250 = 9,640.41份

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得A类基金份额为9,640份，整数位后小数部分的A类基金份额申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 9,640 * 1.0250 = 9,881 \text{元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,881 - 118.58 = 0.42 \text{元}$$

即：投资人投资10,000元从场内申购本基金A类基金份额，假设申购当日A类基金份额净值为1.0250元，则其可得到基金份额9,640份，退款0.42元。

## 2、基金赎回金额的计算

$$\text{赎回总金额} = \text{T日赎回份额} * \text{T日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} * \text{赎回费率}$$

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

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人从深交所场内赎回本基金10,000份A类基金份额，且持有期为2个月，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日A类基金份额净值为1.1480元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 * 1.1480 = 11,480 \text{元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 * 0.5\% = 57.40 \text{元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480 - 57.40 = 11,422.60 \text{元}$$

即：投资人从深交所场内赎回本基金10,000份A类基金份额，假设赎回当日A类基金份额净值为1.1480元，则可得到的净赎回金额为11,422.60元。

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，基金份额净值可以适当延迟计算或公告。

## 4、基金份额净值的计算公式

$$\text{基金份额净值} = \text{计算日该类基金资产净值} / \text{计算日该类基金份额总数}$$

### (十) 场内申购与赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### (十一) 办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中

国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

(十二) 有关拒绝或暂停基金场内申购和赎回业务的情形及处理方式参见本招募说明书第九章中关于“拒绝或暂停基金申购、赎回业务”的相关内容以及深交所有关规定，并据此执行。

(十三) 实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“十一、基金的侧袋机制”或相关公告。

## 十一、基金的侧袋机制

### (一)侧袋机制的实施条件

为有效隔离并化解风险,确保投资者得到公平对待,当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则,基金管理人依照法律法规及基金合同的约定,经与基金托管人协商一致,并咨询符合《证券法》规定的会计师事务所意见后,可以启用侧袋机制。

### (二)侧袋机制的特定资产范围

本基金的特定资产由基金管理人充分审慎严格评估后确定。特定资产包括:

- 1、无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产;
- 2、按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产;
- 3、其他资产价值存在重大不确定性的资产。

### (三)侧袋机制的实施程序

基金管理人认为可以启用侧袋机制的,应符合法律法规及《基金合同》约定,并按如下程序具体实施:

- 1、基金管理人对本基金是否符合侧袋机制的实施条件进行评估,制作合规性评估报告,并经内部程序决策通过。
- 2、基金管理人经与基金托管人协商一致,并咨询符合《证券法》规定的会计师事务所意见后,决定启用侧袋机制。
- 3、启用侧袋机制当日,基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础,确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。启用侧袋机制后,基金管理人应聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。
- 4、基金管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案,并于启用侧袋机制后 5 个工作日内提交相关材料。
- 5、基金管理人应在启用侧袋机制的次日发布临时公告,在实施侧袋机制期间处置特定资产或发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。基金管理人应及时向基金销售机构提示侧袋机制启用的相关事宜。

6、在实施侧袋机制期间，基金管理人应当与基金销售机构共同及时向侧袋实施期间申购或赎回基金的相关投资者传递信息，做好相应的风险揭示。

7、当侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### (四)侧袋机制的运作安排

##### 1、特定资产处置清算

特定资产的处置清算由基金管理人审慎决定。特定资产恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

##### 2、对基金申购赎回的影响

(1)基金管理人应当依法保障主袋账户份额持有人享有基金合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购政策。

(2)启用侧袋机制当日，基金管理人应以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额。当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。基金管理人应依法向投资者进行充分披露。

(3)侧袋机制实施期间，基金管理人不得办理侧袋账户申购赎回。同时，基金管理人按照基金合同和本招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

(4)基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10%认定。

##### 3、信息披露

(1)基金管理人应当暂停披露侧袋账户份额净值，对基金简称进行特殊标识。

(2)在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后按规定发布临时公告。

(3)基金管理人应当在基金定期报告中单独披露报告期内侧袋账户相关信息

及特定资产处置进展情况等可能对投资者利益存在重大影响的其他情况及相关风险提示,披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的,应同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

#### 4、实施侧袋账户期间的基金费用

(1)本基金实施侧袋机制的,主袋账户的管理费和托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

(2)与处置侧袋账户资产相关的费用可从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,且不得收取管理费。

(3)因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由基金管理人承担。

#### (五)主袋账户的投资安排

1、基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整,因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

2、基金的各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

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

#### (六)基金托管人的职责

基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定,加强对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面的复核和监督。

#### (七)相关风险提示

实施侧袋机制期间,侧袋账户份额不办理申购、赎回,基金管理人暂停披露侧袋账户份额净值,侧袋账户份额对应的特定资产不得进行除变现以外的其他投资操作,因此,持有侧袋账户份额的基金份额持有人将面临上述流动性风险。

## 十二、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

### (一) 基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体;司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金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规定办理,受理非交易过户申请的注册登记机构可按规定标准收取过户费用。

### (二) 基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下;场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接申请场内赎回,也可上市交易。登记在证券登记结算系统中的基金份额如需办理场外赎回,应当办理跨系统转托管后方可实施。

3、登记在注册登记系统中的基金份额可直接申请场外赎回。登记在注册登记系统中的基金份额如需办理场内赎回或上市交易,应当办理跨系统转托管后方可实施。

### (三) 系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理场外基金赎回业务的销售机构(网点)时,应依照销售机构(网点)规定办理基金份额系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位 (席位) 时, 应办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### (四) 跨系统转托管

1、跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2、本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

### 十三、基金的投资

#### (一) 投资目标

本基金采取指数化投资, 通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段, 力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%, 且年化跟踪误差小于4%, 以实现对基准指数的有效跟踪。

#### (二) 投资范围

本基金为股票指数型基金, 投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中, 股票资产投资比例不低于基金资产净值的90%, 投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%; 保持不低于基金资产净值5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

#### (三) 投资理念

通过指数化投资于标的指数所代表的股票市场, 分享中国经济中、长期增长成果的同时, 并使之成为中国股票市场投资的有效标尺和配置工具。

#### (四) 标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权, 由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数, 它的样本选自沪深两个证券市场, 覆盖了大部分流通市值, 其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票, 能够反映A股市场总体发展趋势。

标的指数编制方法具体见本招募说明书的规定。

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

开或就上述事项表决未通过的, 本基金合同终止。

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

本基金运作过程中, 标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险, 且指数编制机构暂未做出调整的, 基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则, 综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响, 据此制定成份股替代策略, 及时对标的指数成份股的投资比例进行调整。

#### (五) 投资策略

本基金采用抽样复制指数的投资策略, 综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性, 通过抽样方式构建基金股票投资组合, 并优化确定投资组合中的个股权重, 以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%, 且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时, 或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时, 或因某些特殊情况导致流动性不足时, 或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整, 最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为 3 个月, 本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

##### 1、资产配置策略

本基金首先确定基金资产中股票和现金之间的配置比例, 再进一步以抽样复制基准指数的方法, 确定抽样组合中各行业及个股的配置比例。本基金股票资产不低于基金资产净值的 90%, 在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下, 管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后, 及时将股票配置比例调整至合理水平。

##### 2、股票组合构建

本基金采用抽样复制基准指数的方法, 在综合考虑个股的自由流通市值规模、个股流动性、行业代表性、波动性以及抽样组合与标的指数的相关性等因

素的基础上,采用“分层抽样+优化抽样”的两阶段抽样方法,选择标的指数成份股票或被选成份股票构建基金的抽样股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股配置比例。

#### (1) 股票筛选

本基金在抽样复制指数投资时,首先进行样本成份股初步筛选,通常初步筛选的股票样本为标的指数全部成份股和备选成份股,作为下一步分层抽样的基础。但在特殊情况下,如指数成份股调整、长期停牌或样本个股流动性较差时,则相应调整股票初选股票样本或剔除流动性较差的股票样本。

#### (2) 分层抽样

在初选出的样本股票的基础上,首先按照行业分类方法进行行业类别划分,然后根据每个行业类别在标的指数中的权重、个股在行业类别中的权重、个股收益波动性和所在行业收益相关性进行抽样选取,并优先抽取收益波动与标的指数高度相关的个股。

在分层抽样中,首先控制约束抽样股票组合中的行业权重及收益风险特征代表性与标的指数一致,且控制抽样股票组合中的行业内样本个股与行业整体的收益风险特征高度相关。

#### (3) 优化抽样

对于分层抽样后的股票样本组合,采用进一步优化方法并确定个股的权重,考虑标的指数总体收益和风险的特征情况,通过投资组合优化模型构建基金的股票资产组合,同时保证较小的调整频率和追踪成本。

优化方法是基于样本组合与标的指数的跟踪误差限制,即以跟踪误差最小化为目标函数,并以样本组合内个股集中度,组合资产规模和交易成本为附加约束条件,采用二次规划优化算法和模型,确定抽样组合及组合中个股的权重。

#### (4) 最终组合

对于“分层抽样+优化抽样”的两阶段抽样方法得到的股票组合,将被用来构建本基金的最终股票组合。由于指数成份股的周期性变动,以及成份股的权重的变化,抽样组合将不定期进行有效跟踪,并进行相应的调整样本组合,即再“分层+优化”抽样,以保证样本组合与标的指数的跟踪误差最小化。

为了能够更好的跟踪标的指数, 如果今后由于基准指数成份股结构的变化, 其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪, 本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更, 无需召开基金份额持有人大会, 但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告, 并阐明变更抽样复制方法的原因。

### 3、股票组合调整

#### (1) 组合调整原则

本基金为抽样复制的指数型基金, 基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时, 本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、配股增发因素等变化, 对基金投资组合

进行适时调整, 以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### (2) 组合调整方法

##### ①跟踪调整

##### A、定期性调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案, 在考虑跟踪误差风险的基础上, 对股票投资组合进行相应调整。

本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合, 将每季度末根据上述抽样复制方法调整股票组合及个股配置比例。

##### B、不定期调整

根据指数编制规则, 当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时, 本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例, 并根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。

##### C、基于流动性及法律法规限制的调整

如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素或法律法规规定的投资限制, 使得基金管理人无法顺利购买某成份股, 本基金管理

人将视当时市场情况,综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化,决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循“同行业基础上价格相关性”原则,对于需要进行替代的股票,其替代股票将从标的指数样本或被选成份股中选取,具体将在考虑股票流动性等因素的前提下,在同行业范围内,选取相关性较大的股票进行替代。

D、在其他不影响指数复制的情况下,本基金管理人可以根据市场情况,在跟踪误差最小化的条件下,对基金资产组合进行适当的调整。

#### 4、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

#### 5、权证投资策略

在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则对权证进行投资,即根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。

### (六) 投资决策依据与交易机制

#### 1、投资决策依据

有关法律法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

#### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策,以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整等决策。

#### 3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合,构成了本基金的投资管理程序。

(1) 研究。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台,整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果,开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告,定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会议,对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议,做出基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建。结合研究报告,基金经理主要采取抽样复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金抽样股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下,基金经理可采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。

(4) 交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行,交易部同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估,并撰写相关的绩效评估报告,确认基金组合是否实现了投资预期,投资策略是否成功,并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略,如果需要,亦对投资组合进行相应的调整。

(6) 组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况,结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况,以及基金投资绩效评估结果等,对基金投资组合进行动态监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,根据环境的变化和基金实际投资的需要,有权对上述投资程序做出调整,并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

## (七) 投资限制

### (1) 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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- 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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

### (2) 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；
- 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；
- 3、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- 5、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
- 6、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股

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%, 但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制;

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

8、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;

9、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的, 以变更后的规定为准; 《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的, 履行适当程序后, 基金不受上述限制。

除上述第7、8项外, 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在10个交易日内进行调整, 以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

#### (八) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权, 由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数, 它的样本选自沪深两个证券市场, 覆盖了大部分流通市值, 其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票, 能够反映A股市场总体发展趋势。

本基金认为, 该业绩比较基准目前能够有效地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指

数时，本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准。经与基金托管人协商一致，本基金变更业绩比较基准应报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒体上及时公告。

#### (九) 风险收益特征

本基金是一只股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

#### (十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、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。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

#### (十一) 侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

#### (十二) 基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——招商银行股份有限公司根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）2026年第1季度报告》，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	141,271,625.74	92.93
	其中：股票	141,271,625.74	92.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	348,582.20	0.23
	其中：债券	348,582.20	0.23
	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	10,144,608.02	6.67
8	其他资产	249,181.34	0.16
9	合计	152,013,997.30	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (1) 报告期末指数投资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	1,618,662.00	1.07
B	采矿业	3,685,294.72	2.43
C	制造业	77,924,669.66	51.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,541,899.68	4.98
E	建筑业	3,766,905.78	2.49
F	批发和零售业	682,000.00	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	6,998,107.00	4.62

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,178,561.72	4.74
J	金融业	29,250,530.53	19.32
K	房地产业	437,059.29	0.29
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,273,632.50	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	230.70	0.00
S	综合	-	-
	合计	140,357,553.58	92.69

## (2) 报告期末积极投资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	53,103.03	0.04
C	制造业	827,921.25	0.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,748.64	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,299.24	0.01
N	水利、环境和公共设施 管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	914,072.16	0.60

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明  
细

(1) 报告期末指数投资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	300750	宁德时代	16,760	6,732,492.00	4.45
2	600519	贵州茅台	3,589	5,204,050.00	3.44
3	601318	中国平安	69,490	3,945,642.20	2.61
4	300308	中际旭创	6,600	3,758,106.00	2.48
5	000333	美的集团	38,688	2,953,828.80	1.95
6	300502	新易盛	6,100	2,701,324.00	1.78
7	601166	兴业银行	137,230	2,582,668.60	1.71
8	601899	紫金矿业	78,801	2,578,368.72	1.70
9	300274	阳光电源	12,000	1,809,120.00	1.19
10	600887	伊利股份	64,310	1,694,568.50	1.12

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688795	摩尔线程	640	321,875.20	0.21
2	688783	西安奕材	8,052	161,362.08	0.11
3	001280	中国铀业	699	53,103.03	0.04
4	688781	视涯科技	1,474	48,988.43	0.03
5	688765	禾元生物	718	44,953.98	0.03

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	302,852.88	0.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	45,729.32	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	348,582.20	0.23

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	019785	25 国债 13	3,000	302,852.88	0.20
2	127089	晶澳转债	289	36,135.97	0.02
3	127085	韵达转债	80	9,593.35	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述3只债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、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

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

10、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

本基金本报告期末无国债期货投资。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

11、投资组合报告附注

(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

兴业银行：

2025年12月5日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，兴业银行股份有限公司存在外包机构管理不到位、企业划型不准确等违法违规事实，被处罚款720万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律

法规、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外, 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录, 无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 基金的前十名股票, 均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	42,524.76
2	应收证券清算款	60,938.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	145,717.87
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	249,181.34

(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	127089	晶澳转债	36,135.97	0.02
2	127085	韵达转债	9,593.35	0.01

(5) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

(6) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	321,875.20	0.21	限售期锁定
2	688783	西安奕材	161,362.08	0.11	限售期锁定
3	001280	中国铀业	53,103.03	0.04	限售期锁定
4	688781	视涯科技	48,881.33	0.03	限售期锁定
5	688765	禾元生物	44,953.98	0.03	限售期锁定

(7) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十四、基金的业绩

## 长盛沪深300指数(LOF)A

项目	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
2010年8月4日（基金 合同生效日）至2010 年12月31日	5.70%	1.36%	8.79%	1.51%	-3.09%	-0.15%
2011年度	-23.09%	1.21%	-23.73%	1.23%	0.64%	-0.02%
2012年度	8.01%	1.20%	7.44%	1.22%	0.57%	-0.02%
2013年度	-6.22%	1.31%	-7.04%	1.32%	0.82%	-0.01%
2014年度	49.36%	1.16%	48.88%	1.15%	0.48%	0.01%
2015年度	5.47%	2.52%	5.80%	2.36%	-0.33%	0.16%
2016年度	-10.61%	1.42%	-10.58%	1.33%	-0.03%	0.09%
2017年度	19.11%	0.59%	20.70%	0.60%	-1.59%	-0.01%
2018年度	-22.43%	1.21%	-24.07%	1.27%	1.64%	-0.06%
2019年度	38.53%	1.16%	34.21%	1.18%	4.32%	-0.02%
2020年度	43.84%	1.33%	25.94%	1.36%	17.90%	-0.03%
2021年度	3.48%	1.09%	-4.80%	1.11%	8.28%	-0.02%
2022年度	-17.58%	1.20%	-20.54%	1.22%	2.96%	-0.02%
2023年度	-6.76%	0.78%	-10.74%	0.80%	3.98%	-0.02%
2024年度	17.58%	1.27%	14.10%	1.27%	3.48%	0.00%
2025年度	19.36%	0.90%	16.86%	0.91%	2.50%	-0.01%
2026年1月1日至2026 年3月31日	-2.44%	1.00%	-3.66%	0.92%	1.22%	0.08%
2010年8月4日（基金 合同生效日）至2026 年3月31日	132.44%	1.29%	56.85%	1.28%	75.59%	0.01%

## 长盛沪深300指数C

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
2024 年 6 月 18 日 (基金新增本类份 额日) 至 2024 年 12 月 31 日	13.85%	1.51%	10.54%	1.52%	3.31%	-0.01%
2025 年度	19.11%	0.90%	16.86%	0.91%	2.25%	-0.01%
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 31 日	-2.49%	1.00%	-3.66%	0.92%	1.17%	0.08%
2024 年 6 月 18 日 (基金新增本类份 额日) 至 2026 年 3 月 31 日	32.22%	1.13%	24.44%	1.14%	7.78%	-0.01%

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。

## 十五、基金的融资、融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 十六、基金的财产

### (一) 基金资产总值

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

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (三) 基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户,以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户,以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户,以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和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) 基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和销售机构的固有财产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。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。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销,不同基金财产的债权债务,不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务,不得对基金财产强制执行。

## 十七、基金资产的估值

### (一) 估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场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。

### (二) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (三) 估值原则

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

### (四) 估值方法

#### 1、证券交易所上市交易的有价证券的估值

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

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

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

(4) 交易所市场上市交易的可转换债券,按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定

公允价格。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人

承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,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

1.由于基金费用的不同,本基金各类基金份额将分别计算基金份额净值。基金份额净值是按照每个工作日闭市后,各类基金资产净值除以当日各类基金份额的余额数量计算,精确到 0.0001 元,小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值,并按规定公告。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将各类基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。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) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时,视为该类基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

##### 1. 差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力,按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人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, 由差错责任方对直接损失承担赔偿责任; 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, 如果因基金管理人差错造成基金财产损失时, 基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿, 如果因基金托管人差错造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失, 并拒绝进行赔偿时, 由基金管理人负责向差错方追偿; 追偿过程中产生的有关费用, 应列入基金费用, 从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿, 并且依据法律法规、基金合同或其他规定, 基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任, 则基金管理人有权向出现差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直接损失。

(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。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1) 任一类基金份额净值计算出现错误时, 基金管理人应当立即予以纠正, 通报基金托管人, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25% 时, 基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时, 基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

(2) 当发生净值计算错误时, 由基金管理人负责处理, 由此给基金份额持有人和基金造成损失的, 应由基金管理人先行赔付, 基金管理人按差错情形, 有权向其他当事人追偿。当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时, 基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误, 有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误, 基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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

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

商。

(七) 暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2.因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

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

4.当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

5.法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

(九) 特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(十) 实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

## 十八、基金的收益与分配

### (一) 基金利润的构成

基金合同项下基金利润是指基金收益。基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### (二) 基金期末可供分配利润

基金期末可供分配利润指截止收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低者。

### (三) 收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 由于本基金各类基金份额的基金费用的不同，本基金各类基金份额在可供分配利润上有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权；

2. 本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；

3. 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

4. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。场外投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为相应类别的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。场内基金份额收益分配方式只能为现金分红；场内基金份额具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及注册登记机构的相关规定；

5. 基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

6. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

7. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后，可对上述基金收益分配政策进行调整，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### (四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### (五) 收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告；

2.在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

#### (六) 基金收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额。

#### (七) 实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书相关章节的规定。

## 十九、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C 类基金份额的基金销售服务费；
- 4、基金财产拨划支付的银行费用；
- 5、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性

支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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

### （三）与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第九部分基金份额的场外申购、转换与赎回”和“第十部分基金份额的场内申购与赎回”中的相关规定。不同基金间转换的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。基金申购、赎回费和基金转换费由基金投资者承担，不列入基金财产。

### （四）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用以及其他费用。

### （五）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，

但应待侧袋账户资产变现后方可列支, 有关费用可酌情收取或减免, 但不得收取管理费, 详见本招募说明书相关章节的规定。

#### (六) 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低基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### (七) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定, 履行纳税义务。

## 二十、基金的会计与审计

### (一) 基金的会计政策

- 1.基金管理人为本基金的会计责任方;
- 2.本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日;
- 3.本基金的会计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.基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### (二) 基金的审计

- 1.基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2.会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人同意。
- 3.基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人后可以更换。就更换会计师事务所,基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 二十一、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点, 依法披露基金信息, 并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和互联网网站(以下简称“指定网站”)等媒介披露。指定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字; 除特别说明外, 货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括:

### (一) 招募说明书、基金产品资料概要

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额

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

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件, 用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后, 基金产品资料概要的信息发生重大变更的, 基金管理人应当在 3 个工作日内, 更新基金产品资料概要, 并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点; 基金产品资料概要其他信息发生变更的, 基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的, 基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## (二)基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前, 将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上; 基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## (三)基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定, 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。

## (四)基金合同生效公告

基金管理人将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。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## (五)基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1.本基金的基金合同生效后, 在开始办理基金份额申购或者赎回前, 基金管理人将至少每周公告一次各类基金份额净值;

2.在开始办理基金份额申购或者赎回后, 基金管理人将在每个开放日的次日, 通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点以及其他媒介, 披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值;

3.基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日, 在指定网站披

露半年度和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### (六)基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资人能够在销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (七)基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

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

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

3.基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定网站上,将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

4.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、中期报告或者年度报告。

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

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

#### (八)临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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事件时,有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告

书, 并登载在指定报刊和指定网站上:

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
- 2、终止《基金合同》、基金清算;
- 3、转换基金运作方式、基金合并;
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构, 基金改聘会计师事务所;
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项, 基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 7、基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人;
- 8、基金募集期延长或提前结束募集;
- 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十, 基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十;
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁;
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚, 基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易事项, 中国证监会另有规定的情形除外;
- 14、基金收益分配事项;
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 16、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五;
- 17、本基金开始办理申购、赎回;

- 18、本基金在发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### (九)澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### (十)清算报告

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

#### (十一)实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### (十二)中国证监会规定的其他信息

#### (十三)信息披露文件的存放与查阅

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

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 二十二、风险揭示

本基金主要面临的风险有：

### (一) 市场风险

本基金主要投资于证券市场，而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益的不确定性。市场风险主要包括：政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

3、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

4、购买力风险。基金投资的目的是基金资产的保值增值，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，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

### (二) 管理风险

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

### (三) 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，流动性风险管理的目标则是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

### 1、基金申购、赎回安排

参见本招募说明书“九、基金份额的场外申购、转换与赎回”与“十、基金份额的场内申购与赎回”的相关规定。

### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的股票、债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

本基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

### 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

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，基金管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及基金合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，基金管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，经过内部审批程序并与基金托管人协商确认。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，基金管理人将严格依照法律法规及基金合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

### 5、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，

因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

#### （四）信用风险

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

#### （五）本基金特定风险

##### 1. 系统性风险

本基金为股票型基金，投资于沪深300指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临沪深300指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。

##### 2. 上市交易风险

本基金将在认购期结束后在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

##### 3. 指数化投资风险

本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

#### 4. 投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

#### 5. 跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

（1）基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

（2）指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

（3）当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（4）投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（5）在基金进行指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

（6）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

6. 根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

#### 7.跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### 8.指数编制机构停止服务的风险

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

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

#### 9.成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

#### （六）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如基金在交易时所采用的电脑系统可能因突发性事件或不可抗原因出现故障，由此给基金投资带来风险；

2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈等行为产生的违规风险；

4、人才流失风险，公司主要业务人员的离职如基金经理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；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

## 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一)基金合同的变更

1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的,应召开基金份额持有人大会,基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1)转换基金运作方式;

(2)变更基金类别;

(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规或中国证监会另有规定的除外);

(4)变更基金份额持有人大会程序;

(5)更换基金管理人、基金托管人;

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

(9)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率;

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(5)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;

(6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2.关于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,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

## (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
5. 中国证监会规定的其他情况。

## (三) 基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

### 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

- (6)聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9)公布基金财产清算结果;
- (10)对基金剩余财产进行分配。

### 3.清算费用

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

### 4.基金财产按下列顺序清偿:

- (1)支付清算费用;
- (2)交纳所欠税款;
- (3)清偿基金债务;
- (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

### 5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于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;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组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。

## 二十四、基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

#### (一) 基金管理人的权利

本基金管理人为长盛基金管理有限公司。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1. 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

2. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3. 发售基金份额；

4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5. 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

6. 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

7. 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

8. 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

9. 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10. 选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11. 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；

12. 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13. 依法召集基金份额持有人大会；

14.法律法规和基金合同规定的其他权利。

(二) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 1.依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2.办理基金备案手续；
- 3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- 5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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.计算并公告基金净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 9.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；
- 10.按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 12.编制季度、中期和年度基金报告；
- 13.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；
- 14.保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- 15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

16. 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；
17. 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18. 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19. 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；
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，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. 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23. 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；
24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
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、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利

本基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
2. 监督基金管理人对本基金的投资运作；
3. 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
4. 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
5. 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基

金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会;

- 6.依法召集基金份额持有人大会;
- 7.按规定取得基金份额持有人名册资料;
- 8.法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (四) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:

- 1.安全保管基金财产;
- 2.设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
- 3.对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;
- 4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得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;
- 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应予保密,不得向他人泄露;
- 8.对基金财务会计报告、季度、中期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;
- 9.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- 10.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;
- 11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- 12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、各类基金份额申购、赎回价格;
- 13.按照规定监督基金管理人的投资运作;
- 14.按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

17.因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;

18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;

19.参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;

20.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会和银行业监督管理机构, 并通知基金管理人;

21.执行生效的基金份额持有人大会决议;

22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

23.建立并保存基金份额持有人名册;

24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### (五) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金份额持有人的权利为:

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。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (六) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
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其他基金份额持有人合法权益的活动；
5. 执行生效的基金份额持有人大会决议；
6. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
7. 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) 基金份额持有人大会由基金份额持有人及其合法授权代表共同组成。

基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

#### (二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规或中国证监会另有规定的除外）；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 单独或合计持有基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)就同一事项书面要求召开基金份额持

有人大会；

(10)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(11)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、销售服务费率、变更收费方式或调低赎回费率；

(3)在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额类别，增加新的收费方式或者调整基金份额分类规则；

(4)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(5)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(6)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(7)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三)召集人和召集方式

1.除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

4. 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会, 而基金管理人、基金托管人都不召集的, 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会, 但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5. 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的, 基金管理人、基金托管人应当配合, 不得阻碍、干扰。

#### (四) 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. 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会, 召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

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

2. 采用通讯方式开会并进行表决的情况下, 由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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3. 如召集人为基金管理人, 还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书

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

#### (五)基金份额持有人出席会议的方式

##### 1.会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4)会议的召开方式由召集人确定。

##### 2.召开基金份额持有人大会的条件

###### (1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

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

###### (2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1)召集人按本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)召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

4)本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上;

5)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提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符。

#### (六)议事内容与程序

##### 1.议事内容及提案权

(1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% (含 10%) 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日至少 35 日前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核,符合条件的应当在大会召开日 30 日前公告。

(3)大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% (含 10%) 以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 未获基金份额持有人大会审议通过, 就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议, 其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改, 应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的, 其授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人提前 30 日公布提案, 在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督, 则在公证机关监督下形成的决议有效。

## 3. 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。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

#### 1. 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2.基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1)一般决议

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

(2)特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

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

4.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。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

(八)计票

1.现场开会

(1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人;但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席,则大会主持人可自行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,由大会主持人当场

公布计票结果。

(3)如大会主持人对于提交的表决结果有异议,可以对投票数进行重新清点;如大会主持人未进行重新清点,而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2.通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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;如监督人经通知但拒绝到场监督,则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1.基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

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

(十)实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登

记日相关基金份额的二分之一 (含二分之一);

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一 (含二分之一);

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

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上 (含 50%) 选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人;

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上 (含二分之一) 通过;

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

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

(十一) 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的, 从其规定。

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### (一) 基金合同的变更

1. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的, 应召开基金份额持有人大会, 基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式;

(2) 变更基金类别;

(3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略 (法律法规或中国证监会另有规定的除外);

(4) 变更基金份额持有人大会程序;

(5) 更换基金管理人、基金托管人；

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、收费方式或调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 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；

(6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于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，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

## (二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；

2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4. 出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功

召开或就上述事项表决未通过的；

5.中国证监会规定的其他情况。

### (三)基金财产的清算

#### 1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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

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

#### 2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2)对基金财产进行清理和确认；
- (3)对基金财产进行估价和变现；
- (4)制作清算报告；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9)公布基金财产清算结果；
- (10)对基金剩余财产进行分配。

#### 3.清算费用

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

#### 4.基金财产按下列顺序清偿：

- (1)支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款;

(3) 清偿基金债务;

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

#### 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于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; 基金财产清算结果经会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 由基金财产清算组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。

### 四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议, 基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的, 对各方当事人均有约束力, 仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间, 基金合同当事人应恪守各自的职责, 继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务, 维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册, 供投资人在基金管理人和基金托管人办公场所查阅, 但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十五、基金托管协议的内容摘要

### (一) 托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：长盛基金管理有限公司

#### 2、基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（简称：招商银行）

### (二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

#### 1) 本基金将投资于以下金融工具：

本基金为股票指数型基金，投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2) 本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为的指令，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金的投资比例：

股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金以及到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资组合遵循以下投资限制：

- 1) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- 2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- 3) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- 5) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
- 6) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受此限制；
- 7) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- 8) 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；
- 9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准；《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，

基金不受上述限制。

除上述第 7)、8) 项外, 由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整, 以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

本基金建仓时间为 3 个月, 本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。基金托管人应自基金合同生效之日起监督基金投资比例是否符合法律法规、基金合同的规定, 不符合规定的, 基金托管人应书面通知基金管理人及时进行整改, 整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。

侧袋机制实施期间, 本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于主袋账户。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过适当的监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定, 基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性, 并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时, 如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时, 基金托管人有权向中国证监会报告。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单, 并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人, 否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市

场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单,但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的,基金管理人可以对相应损失先行予以承担,然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任改正。

5、本基金投资流通受限证券,应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

1) 本协议所称的流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券,且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的,并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购,不得预付任何形式的保证金,法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券,且锁定期不得超过本基金的剩余期限。

2) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流

动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人, 保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内, 以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责, 确保对相关风险采取积极有效的措施, 在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时, 基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算, 并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险, 基金托管人不承担任何责任。

3) 基金投资流通受限证券前, 基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息, 包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期, 基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整, 并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人, 保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息, 致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的, 基金托管人免于承担责任。

4) 基金托管人依照法律法规, 《基金合同》, 《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定, 应及时通知基金管理人, 并呈报中国证监会, 同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》投资指令不予执行, 并立即通知基金管理人纠正, 基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时, 基金托管人应向中国证监会报告。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

7、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人,对于收到的书面通知基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内,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。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

8、基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于:对基金托管人发出的提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9、若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人及时纠正,由此造成的损失由基金管理人承担。

10、基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

11、基金托管人应当依照法律法规和基金合同约定,对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。

### (三) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面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。在上述规定期限内,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。

3、基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查,包括但不限于:对基金管理人发出的书面提示,基金托管人应在规定时间内答复并改正,或就基金管理人的疑义进行解释或举证;基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

4、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为,应及时报告中国证监会,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。

#### (四) 基金财产的保管

##### (1) 基金财产保管的原则

- 1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2.基金托管人应安全保管基金财产。
- 3.基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立。
- 5.基金托管人根据基金管理人的指令,按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担;不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失,由此产生的责任基金托管人不承担责任。
- 6.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基金托管人,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。
- 7.除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### (2) 基金募集期间及募集资金的验资

1.基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2.基金募集期满或基金停止募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行托管账户,同时在规定时间内,基金管理人应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。

3.若基金募集期限届满,未能达到基金合同生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### (3) 基金银行托管账户的开立和管理

1.基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行托管账户,保管基金的银行存款,并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

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

3.基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

### (4) 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1.基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2.基金证券账户的开立和使用,仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用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和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4.基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的

一级法人清算工作, 基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务, 涉及相关账户的开立、使用的, 若无相关规定, 则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### (5) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后, 基金托管人根据中国人民银行、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账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### (6) 其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户, 可以根据法律法规和基金合同的规定, 由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

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。

#### (7) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库, 或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库, 实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让, 由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### (8) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外, 基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人, 并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处, 因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果, 由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## (五) 基金资产净值计算与复核

### 1. 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金额。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码, 分别计算和公告各类基金份额净值和基金份额累计净值。各类基金份额净值是指该类基金份额的基金资产净值除以该类基金份额总数, 各类基金份额净值的计算, 均精确到 0.0001 元, 小数点后第五位四舍五入, 国家另有规定的, 从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值, 经基金托管人复核, 按规定公告。

### 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后, 将各类基金份额净值结果发送基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人对外公布。

3. 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, 仍无法达成一致意见的, 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。

## (六) 基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管, 基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册, 保存期不少于 15 年。如不能妥善保管, 则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前, 基金管理人应将有关资料送交基金托管人, 不得无故拒绝或延误提供, 并保证其的真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途, 并应遵守保密义务。

## (七) 争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议, 双方当事人应通过协商、调解解决, 协商、调解不能解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会, 仲裁地点为深圳市, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规

则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力,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。

本协议受中国法律管辖。

#### (八) 托管协议的变更与终止

##### 1、托管协议的变更程序

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。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

##### 2、基金托管协议终止出现的情形

- 1.基金合同终止;
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
- 4.发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十六、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人和销售机构提供。基金管理人为基金份额持有人提供以下一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化,增加、修改服务项目:

### (一) 电话服务

长盛基金管理有限公司客户服务电话:(010) 86497888、400-888-2666。

客户服务中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务,客服电话人工服务时间为交易日的 8:30-17:00。

### (二) 在线服务

基金份额持有人可通过基金管理人网站、微信公众号等渠道获得在线服务。在线客服人工服务时间为交易日的 8:30-17:00。

### (三) 资讯服务

基金份额持有人可通过基金管理人网站获取基金和基金管理人各类信息,包括基金法律文件、产品信息、最新动态、热点问题等。

长盛基金管理有限公司网址: [www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)

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

### (四) 对账单服务

基金管理人根据持有人账户情况和定制情况定期或不定期发送对账单,至少每年度以电子邮件形式主动向长盛直销系统份额持有人提供基金保有情况。但由于基金份额持有人在基金管理人系统中资料信息不完整或不准确等原因导致无法送出的除外。

### (五) 投诉建议受理

基金份额持有人可以通过基金管理人客户服务电话、在线客服、电子邮箱、信函传真等渠道或方式对基金管理人和销售机构进行投诉或提出建议。

## 二十七、其它应披露的事项

其在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露日期
1	本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项	
2	最近 3 年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚	
3	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书（更新）	2025-06-16
4	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）（长盛沪深 300 指数(LOF)A 份额）基金产品资料概要更新	2025-06-16
5	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）（长盛沪深 300 指数 C 份额）基金产品资料概要更新	2025-06-16
6	长盛基金管理有限公司关于增加华宝证券为旗下部分开放式基金销售机构并开通基金定投业务及转换业务的公告	2025-07-09
7	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 2 季度报告提示性公告	2025-07-19
8	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2025 年第 2 季度报告	2025-07-19
9	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞农村商业银行股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	2025-07-30
10	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行为销售机构的公告	2025-08-29
11	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	2025-08-30
12	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2025 年中期报告	2025-08-30
13	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 3 季度报告提示性公告	2025-10-25
14	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2025 年第 3 季度报告	2025-10-25
15	长盛基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	2025-12-03
16	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	2026-01-15
17	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	2026-01-22
18	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	2026-01-22
19	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	2026-03-28
20	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	2026-03-28
21	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	2026-04-15
22	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	2026-04-22
23	长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）2026 年第 1 季度报告	2026-04-22

## 二十八、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人和基金托管人的住所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买复印件,但应以正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十九、备查文件

- （一）中国证监会批准长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）设立的文件
- （二）法律意见书
- （三）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （四）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （五）《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- （六）《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- （七）《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）登记结算服务协议》
- （八）中国证监会规定的其它文件

以上第（四）项备查文件存放在基金托管人的办公场所，其他文件存放在基金管理人的办公场所。基金投资者在营业时间内可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长盛基金管理有限公司

2026年6月12日