

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金 招募说明书

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）于2012年5月21日获中国证监会证监许可【2012】679号文批准募集。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，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。本基金面临的风险主要有市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、本基金特定风险和其他风险。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。

本基金为保本混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金；本基金可以配置二级市场股票，其预期风险和预期收益高于投资范围不含二级市场股票的混合型基金。本基金初始募集净值1元，在市场波动因素影响下，本基金面值可能低于初始面值。投资者投资于本保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，投资者投资本基金仍然存在本金损失的风险。

在一个保本周期内，对于投资人认购并持有到期的基金份额，存在着仅能收回投资净额（本基金募集期内投资者的净认购金额及认购利息，在过渡期内进行过渡期申购的投资者申购的基金份额在折算日所代表的资产净值以及由本基金上一个保本周期结束后默认转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额在折算日所代表的资产净值）的可能性；对于投资人在日常申购的基金份额，存在着仅能部分收回本金的可能性。对于基金份额持有人未持有到期的基金份额，在赎回时不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、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。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

目 录

重要提示	2
目 录.....	4
第一节 绪 言.....	5
第二节 释 义.....	6
第三节 基金管理人.....	12
第四节 基金托管人.....	20
第五节 相关服务及担保机构.....	24
第六节 基金的募集.....	26
第七节 基金合同的生效.....	29
第八节 基金份额的申购与赎回.....	30
第九节 保本.....	39
第十节 担保.....	41
第十一节 基金的投资.....	48
第十二节 基金的财产.....	62
第十三节 基金资产的估值.....	63
第十四节 基金的收益与分配.....	67
第十五节 基金的费用与税收.....	69
第十六节 基金的会计与审计.....	71
第十七节 基金的信息披露.....	71
第十八节 保本周期到期.....	77
第十九节 风险揭示.....	82
第二十节 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	85
第二十一节 基金合同的内容摘要.....	87
第二十二节 基金托管协议的内容摘要.....	87
第二十三节 对基金份额持有人的服务.....	87
第二十四节 招募说明书的存放和查阅方式.....	90
第二十五节 备查文件.....	90
附件一：基金合同的内容摘要.....	92
附件二：基金托管协议的内容摘要.....	109
附件三：《保证合同》	121
附件四：《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金保函》	135

第一节 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他相关法律法规的规定以及《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。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。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

第二节 释义

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：指长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指长盛基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 4、担保人：指为本基金保本周期的保本提供保证担保、风险买断或者中国证监会认可的其他保本保障机制并依基金合同约定确定的机构。本基金第一个保本周期的担保人为安徽省信用担保集团有限公司，为本基金第一个保本周期的保本提供连带责任保证
- 5、基金合同：指《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 7、招募说明书或本招募说明书：指《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 8、基金份额发售公告：指《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 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 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 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 2011 年 6 月 9 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》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 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

- 14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 16、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
- 17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 18、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
- 19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
- 20、基金份额持有人大会：指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议
- 21、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
- 22、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
- 23、保本义务人：指与基金管理人签订风险买断合同，为本基金的某保本周期（第一个保本周期除外）承担保本偿付责任的机构
- 24、保本保障机制：指依据相关法律法规的规定，基金管理人通过与担保人签订保证合同或与保本义务人签订风险买断合同，由担保人为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证或者由保本义务人为本基金承担保本偿付责任，或者通过中国证监会认可的其他方式，以保证符合条件的基金份额持有人在保本周期到期时可以获得保本金额。第一个保本周期由安徽省信用担保集团有限公司作为担保人，为基金第一个保本周期的保本提供不可撤销的连带责任保证。本基金第一个保本周期后各保本周期涉及的保本保障事宜，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的保证合同或风险买断合同决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告

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

26、销售机构：指长盛基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金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

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

28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为长盛基金管理有限公司或接受长盛基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

30、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基金的基金份额变动及结余情况的账户

31、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

32、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

33、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

34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

37、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

38、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

39、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

40、保本周期：指本基金的保本期限。本基金的保本周期每三年为一个周

期。本基金第一个保本周期自基金合同生效之日起至3年后对应日止；本基金第一个保本周期后的各保本周期为自本基金公告的保本周期起始之日起至三年后对应日止的期间。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一保本周期的起始时间。基金合同中若无特别所指，保本周期即为当期保本周期

41、过渡期：指基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定的当期保本周期到期日至下一保本周期开始之前的不超过15个工作日的一段期间，基金管理人可进一步确定在该期间内投资人进行过渡期申购的期限

42、过渡期申购：指依据基金管理人在保本周期到期前公告的到期处理规则，投资人在过渡期的限定期限内申请购买本基金基金份额的行为，投资人进行过渡期申购的，按其申购的基金份额在折算日所代表的资产净值确认下一保本周期的投资净额并适用下一保本周期的保本条款

43、基金合同生效日：指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日

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

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

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

50、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银

行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

51、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%

52、元：指人民币元

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

54、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

55、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

56、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

57、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

58、投资净额：指本基金募集期内投资者的净认购金额及认购利息，在过渡期内进行过渡期申购的投资者申购的基金份额在折算日所代表的资产净值以及由本基金上一个保本周期结束后默认转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额在折算日所代表的资产净值。投资净额为本基金的保本投资金额。在当期保本周期内赎回或转换转出的基金份额，不纳入当期保本周期的投资净额的计算

59、折算日 指本基金第一个保本周期后各保本周期开始日的前一工作日，即过渡期最后一个工作日。基金合同中若无特别所指，折算日即为当期保本周期开始日的前一工作日

60、基金份额折算：在折算日，基金份额持有人所持有的基金份额(包括投资者进行过渡期申购的基金份额和上一个保本周期结束后默认选择转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额)在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整

61、可赎回金额：指根据保本周期到期日基金份额数及基金份额净值计算的赎回金额

62、《保证合同》：若基金合同无特别所指，指安徽省信用担保集团有限公司与基金管理人为本基金第一个保本周期的保本保证所签署的《保证合同》

63、保函：指担保人向本基金基金份额持有人出具的保证法律文件

64、持有当期保本周期到期：指在本基金募集期认购本基金、过渡期申购本基金及从上一个保本周期转入当期保本周期的持有人在当期保本周期内一直持有前述基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额）的行为

65、保本周期到期日：基金合同中若无特别所指即为当期保本周期届满日（自当期保本周期开始之日起至3年后对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。基金份额持有人在当期保本周期到期前公告的到期赎回限定期内将在当期保本周期内持续持有的基金份额进行赎回或转换为基金管理人管理的其他基金的，则对该基金份额持有人所赎回或转换转出的基金份额而言，赎回日或转换日为当期保本周期到期日

66、到期赎回限定期 指基金管理人在保本周期到期日前指定的一个期限。在此期限内，基金份额持有人将在当期保本周期内持续持有的基金份额进行赎回或转换为基金管理人管理的其他基金的，则对该基金份额持有人所赎回或者转换转出的基金份额而言，赎回日或转换日为当期保本周期到期日，基金份额持有人无需支付赎回费用或基金间转换费用（基金间转换费用包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差），并可按其赎回或转换的基金份额与赎回或转换日基金份额净值的乘积加上其赎回或转换的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其赎回或转换的基金份额的投资净额的差额享有保本利益

67、保本基金存续条件：指本基金保本周期届满时（后），担保人同意继续担保或基金管理人和基金托管人认可的其他机构同意为本基金提供未对基金合同保本条款作出不利改变的担保，同时本基金满足法律法规和基金合同规定的保本基金存续要求

68、保本周期到期后基金的存续形式：指保本周期届满时，在符合保本基金存续条件的前提下，本基金继续存续；否则，本基金变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”

69、转入下一个保本周期：指在本基金符合保本基金存续条件的情况下，

上一保本周期的基金份额持有人继续持有本基金基金份额的行为

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

71、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

第三节 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。截至目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司占注册资本的41%;新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团有限责任公司(现名称为安徽省投资集团控股有限公司)占注册资本的13%。截至2012年6月8日,基金管理人共管理两只封闭式基金、十八只开放式基金和五只社保基金委托资产,同时管理多只专户理财产品。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

凤良志先生,董事长,博士,高级经济师。曾任安徽省政府办公厅二办副主任,安徽省国际信托投资公司副总经理,安徽省证券管理办公室主任,香港黄山有限公司董事长、总经理,安徽国元控股(集团)有限责任公司董事长、

党委书记，安徽国元信托投资有限责任公司董事长。现任国元证券股份有限公司董事长。

钱正先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽省人大常委办公厅副处长、处长，安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记，安徽省国有资产管理局分党组书记。现任安徽省信用担保集团有限公司总经理。

杜长棣先生，董事，学士。曾任安徽省第一轻工业厅研究室副主任，安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长，安徽省巢湖市市委常委、常务副市长，安徽省发改委副主任。现任安徽省投资集团有限责任公司（现名称为安徽省投资集团控股有限公司）党委书记、董事长。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任，安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理，安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理，香港黄山有限公司总经理助理。现任国元证券股份有限公司董事、总裁。

陈淑珊女士，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括 ING 霸菱证券公司、花旗银行、摩根士丹利。现任星展银行有限公司私人银行业务部董事总经理兼主管。

张在荣先生，董事，学士。曾任职多个金融机构，包括法国东方汇理银行、美洲银行、渣打银行、星展银行有限公司。现任星展银行（中国）有限公司执行董事兼行政总裁。

周兵先生，董事、总经理，硕士，经济师。曾任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理（期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人）、北京朝阳门大街证券营业部总经理。2004年10月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理。

李伟强先生，独立董事，美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士，美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁，花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁。现任香港国际资本管理有限公司董事长。

张仁良先生，独立董事，金融学讲座教授。曾任香港消费者委员会有关银

行界调查的项目协调人、太平洋经济合作理事会（PECC）属下公司管制研究小组主席、上海交通大学管理学院兼职教授、上海复旦大学顾问教授、香港城市大学讲座教授。现任香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署辖下的《伙伴倡自强》小区协作计划主席、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席以及香港特区政府策略发展委员会委员。2007 年被委任为太平绅士。2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、校学术委员会委员、政治经济学博士点学科带头人、产业经济学和工商管理硕士点学科带头人，武汉大学商学院博士生导师，中国科技大学兼职教授，安徽省政府特邀咨询员，全国马经史学会常务理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会副会长。

陈华平先生，独立董事，博士毕业，教授，博士生导师。曾任中国科技大学信息管理与决策研究室主任、管理学院副院长。现任中国科学技术大学计算机学院执行院长、管理学院商务智能实验室主任。

2、监事会成员

陈锦光先生，监事会主席，学士，特许金融分析师。曾任职于美国银行直投伙伴公司私募股权投资部门，历任野村证券高科技产业研究分析师、野村证券上海办事处及证券研究部门负责人、星展资产管理有限公司研究总监以及投资亚洲和中国国内市场的投资经理人。现任星展资产管理有限公司股票投资团队总监。

沈和付先生，监事，法学学士。曾任安徽省国际经济技术合作公司经理助理、安徽省信托投资公司法律部副主任。现任国元证券股份有限公司合规总监。

叶斌先生，监事，学士，高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任，安徽省信托投资公司部门经理、副总经理。现任安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省信用担保集团有限公司副总经理。

钱进先生，监事，硕士研究生。曾任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事长、安徽省医药集团股份公司总经理，安徽省投资集团有限责任公司资本运营部经理、总经理助理、总经济师。现任安徽省投资集团有限责任公司（现名称为安徽省投资集团控股有限公司）党委委员、副总经理。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计，太极计算机公

司子公司北京润物信息技术有限公司主管会计,历任长盛基金管理有限公司业务运营部总监、财务会计部总监。现任长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

3、管理层成员

凤良志先生,董事长,博士,高级经济师。同上。

周兵先生,董事、总经理,硕士,经济师。同上。

朱剑彪先生,金融学博士。曾任广东商学院投资金融系教师、党支部书记,广州证券有限公司宏观与策略研究员、投资银行部项目经理、基金部经理,金鹰基金管理有限公司筹备组成员、董事会秘书、研究总监、投研副总监兼研究总监和督察长。2007年4月起加入长盛基金管理有限公司,历任社保业务管理部总监、固定收益部总监、总经理助理、副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司常务副总经理、社保组合组合经理。

杨思乐先生,英国籍,拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位。从1992年9月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司(新加坡)。2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生,大学,会计师。曾任美菱股份有限公司财会部经理,安徽省信托投资公司财会部副经理,国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理。2004年10月起加入长盛基金管理有限公司,现任长盛基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

蔡宾先生,1978年11月出生。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(美国特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理,投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理等职务。现任固定收益部总监,自2011年5月24日起任长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,自2011年12月6日起兼任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。

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

5、投资决策委员会成员

朱剑彪先生，金融学博士，常务副总经理，同上。

王宁先生，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理。

侯继雄先生，清华大学博士。历任国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部总监，同盛证券投资基金基金经理。

吴达先生，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，美国特许金融分析师CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司，历任星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。

蔡宾先生，中央财经大学硕士，美国特许金融分析师CFA。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理、投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理等职务。现任固定收益部总监，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。

刘斌先生，清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部执行总监，长盛量化红利策略股票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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金份额累计净值确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、有关法律法规、中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

（四）基金管理人承诺

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

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺

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

（2）不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

(4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

(五) 基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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

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

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

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

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

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

2、完备严密的内部控制体系

公司建立了“三层控制二道监督”(董事会—经营管理层—业务操作层、督察长—监察稽核部)内部控制组织体系。董事会下设的风险控制管理委员会定期或者不定期听取督察长关于风险控制方面的报告。督察长负责监督检查公司内部风险控制情况，组织指导公司监察稽核工作，对基金运作、内部管理、制度执行及遵规守法进行监察稽核；公司风险控制委员会定期对基金资产运作的风险进行评估，对存在的风险隐患或发现的风险问题进行研究；监察稽核部负责日常的风险监控工作，对公司各部门业务流程的风险控制工作进行监察稽核，并通过全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度，从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面及时和全面揭示风险控制要素，明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法，使得对各风险点的监控真正落到实处。

3、内部控制制度的内容

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

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

(2) 公司基本管理制度包括风险管理制度、稽核监察制度、投资管理制度、基金会计核算制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源管理制度和紧急应变制度等。公司基本管理制度的制定和实施需事先报经公司董事会批准。

(3) 部门业务规章是在公司基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、业务流程和操作守则等的具体说明。部门业务规章由公司相关部门依据公司章程和基本管理制度，并结合部门职责和业务运作的要求拟定，其制定和实施需报经公司总经理办公会批准。

公司的内部控制制度会随着市场的发展和金融创新来进行相关调整。公司各部门对规章制度的调整与更新情况由监察稽核部负责监督。

4、内部控制实施

(1) 建立了详细的内部控制指引，使内部控制制度和各项控制措施能够得以有效实施。

(2) 建立了严格评价程序，以评估控制制度建立后能得到执行。主要由监察稽核部定期或不定期地检查各个部门的工作流程，以纠正不符合公司规章制度的情况，对制度中存在的合理情况，监察稽核部有权提请相关部门修改，同时报告总经理和公司督察长，以保证多重检查复核。

(3) 建立了报告制度。报告制度能将内部控制制度中的实质性不足或控制失效及时向公司高级管理层和监管部门进行报告。公司的督察长定期向中国证监会和公司董事长出具监察稽核报告，指出近期存在的问题，提出改进的方法和时间。监察稽核部总监负责公司的日常监察稽核工作，定期向督察长出具检查报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

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

第四节 基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及 31 个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 120 余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2012 年 3 月末, 中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合 (LOF)、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数 (LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资

基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普 500 等权重指数(QDII)、长信标普 100 等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等 147 只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到

每个工作环节,在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

最近一年内,中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

第五节 相关服务及担保机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20层

邮政编码:100088

电话:(010)82019799、82019795

传真:(010)82255981、82255982

联系人:张莹、张晓丽

2、销售机构

(1) 中国银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

联系人：吴雪妮

电话：010 - 66594851

传真：010 - 66594946

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(2) 其他销售机构（详见本基金基金份额发售公告）

(二) 登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：戴君棉

(三) 担保人

名称：安徽省信用担保集团有限公司

注册地址：合肥市长江西路200号

法定代表人：钱正

联系人：袁野

联系电话：0551-5227521

(四) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：汪棣、张鸿

第六节 基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2012年5月21日证监许可[2012]679号文批准募集。

（一）基金类别与存续期间

- 1、基金类别：保本混合型证券投资基金
- 2、基金存续期间：不定期

（二）募集概况

1、募集方式：通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的增加销售机构的相关公告。销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

2、募集期限：本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

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

4、基金募集规模：本基金的募集份额总额应不少于2亿份，基金募集金额应不少于2亿元人民币。本基金在募集期内最终确认的有效认购金额拟不超

过 50 亿元人民币(不包括募集期利息),规模控制的具体方案详见基金份额发售公告。基金合同生效后,基金规模不受上述募集规模上限的限制。

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

5、基金的面值、认购价格及认购费用

本基金每份基金份额初始面值为人民币 1.00 元,按初始面值发售,每份基金份额认购价格为人民币 1.00 元。

本基金的认购费率不超过 0.8%,随认购金额的增加而递减,如下表所示:

认购金额(M,含认购费)	认购费率
M < 50 万	0.8%
50 万 M < 200 万	0.5%
200 万 M < 500 万	0.2%
M ≥ 500 万	1,000 元/笔

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用,不从基金财产中列支。

6、认购期利息的处理方式

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

7、认购份额的计算

本基金认购采用金额认购的方式。认购份额计算结果保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

认购费用适用比例费率时,认购份数的计算方法如下:

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{认购资金利息}) / \text{基金份额发售面值}$$

认购费用为固定金额时,认购份数的计算方法如下:

$$\text{认购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

认购份数 = (净认购金额 + 认购资金利息) / 基金份额发售面值

认购份额的计算按照四舍五入方法,保留至小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归入基金财产所有。

例:某投资人投资 100,000 元认购本基金,对应费率为 0.8%,假设该笔认购产生利息 50 元,则其可得到的认购份额为:

净认购金额=100,000 / (1 + 0.8%) = 99,206.35 元

认购费用=100,000-99,206.35 = 793.65 元

认购份额=(99,206.35+50) / 1.00 = 99,256.35 份

8、认购时间与程序

(1) 认购场所

本基金可通过本公司的直销机构和中国银行等销售代理机构认购本基金。详细认购场所见基金份额发售公告。

(2) 时间安排

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

(3) 基本认购程序

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

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

3) 本基金采取金额申报方式,认购期最低认购金额为 1,000 元人民币,投资者认购本基金,须按销售机构规定全额缴纳认购款项。

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

5) 销售网点受理申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售网点确实收到了认购申请。T 日的认购申请是否有效应以登记机构的确认登记为准。投资人应在 T+2 日后到所销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

6) 本基金对单个基金份额持有人持有基金份额没有最高和最低比例或数量的限制,但需满足本基金关于募集上限和基金备案条件的相关规定。

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

第七节 基金合同的生效

（一）基金备案的条件

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

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

（二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

法律法规另有规定时，从其规定。

第八节 基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在基金份额发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、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）申购与赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接收的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（三）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、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；
- 4、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按后进先出的原则，即对该基金份额持有人的基金份额进行处理时，申购确认日期在前的基金份额后赎回，申购确认日期在后的基金份额先赎回，以确定所适用的赎回费率；若基金保本周期到期后变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，则基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，即对该基金份额持有人的基金份额进行处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率。

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

（四）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

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

（五）申购与赎回的数额限定

1、申购金额的限制

基金直销机构及销售机构每个账户单笔申购的最低金额为 1,000 元(含申

购费)；基金投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

2、投资者赎回份额不设限制。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

(六) 申购和赎回的数额与价格

1、申购份额的处理方式

(1) 申购份额的处理方式：本基金采用外扣法计算申购费用，申购的有效份额以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 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申请当日基金份额净值的金额，赎回净额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 位，由产生的收益或损失由基金财产承担。

2、申购份额的计算

申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

(注：在适用固定金额计算申购费率时，净申购金额 = 申购金额 - 申购费用)

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{基金赎回费率}$$

赎回净额=赎回金额 - 赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值(未扣除相应的费用),赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、基金份额净值的计算公式

基金份额净值的计算公式为:

基金份额净值 = 基金资产净值总额/发行在外的基金份额总数

基金份额净值的计算,精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

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

(七) 基金的申购费与赎回费及其用途

1、申购费用

本基金申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低。若投资者在一天之内有多笔申购,则按每次申购金额对应费率分别收取申购费。申购费用由基金申购人承担,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用,不列入基金财产。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
M < 50万	1.2%
50万 M < 200万	0.8%
200万 M < 500万	0.4%
M ≥ 500万	1,000元/笔

举例说明如下:

某投资者以40万元申购本基金,申购费率为1.2%,假设申购当日基金份额净值为1.100元,则其可得到的申购份额为:

净申购净额 = $400,000 / (1 + 1.2\%) = 395,256.92$ 元

申购费用 = $400,000 - 395,256.92 = 4,743.08$ 元

申购份额 = $395,256.92 / 1.100 = 359,324.47$ 份

即投资者以40万元申购本基金,如果申购当日基金份额净值为1.100元,

则其可得到的申购份额为 359,324.47 份。

2、赎回费用

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25% 的部分归入基金财产，其余部分用于支付销售、登记等机构的相关手续费。

本基金的赎回费率如下：

持有时间	赎回费率
6 个月以下（不含）	1.8%
6 个月（含） - 2 年（不含）	1.0%
2 年（含） - 3 年（不含），但持有当期保本周期到期且在当期保本周期开放到期赎回的限定期限内选择赎回的，不适用本档费率	0.5%
3 年以上（含），或者持有当期保本周期到期且在当期保本周期开放到期赎回的限定期限内选择赎回的	0

（注：1 年按 365 天计算；6 个月按 183 天计算；基金份额持有人持有时间的计算，以其份额在登记机构的登记日开始计算。）

举例说明：

某基金份额持有人赎回持有不超过 6 个月的 1,000 份基金份额，赎回对应的赎回费率为 1.8%，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则其可得到的赎回净额为：

$$\text{赎回金额} = 1,000 \times 1.100 = 1100 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 1,100 \times 1.8\% = 19.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回净额} = 1,100 - 19.80 = 1,080.20 \text{ 元}$$

即基金份额持有人赎回持有不超过 6 个月的 1,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.100 元，则其可得到的赎回净额为 1,080.20 元。

3、若保本期到期后，本基金不符合保本基金的存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，具体费率以届时公告为准。

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，并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。

4、持有当期保本周期到期的基金份额在开放到期赎回的限定期限内赎回或者转换转出的情况下，基金份额持有人无需支付赎回费或基金间转换费用（基金间转换费用包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差，下同），其他情况下基金份额持有人赎回或转换转出其持有的本基金基金份额时应按基金合同、招募说明书规定的费率确定并支付赎回费和基金间转换费用。

5、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和调低赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应最迟应在调整实施前3日在中国证监会指定的媒体上刊登公告。

（八）申购和赎回的登记

1、经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资者T日申购基金成功后，登记机构在T+1日为投资者增加权益并办理登记手续，投资者自T+2日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者T日赎回基金成功后，登记机构在T+1日为投资者扣除权益并办理相应的登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施三个工作日前予以公告。

（九）过渡期申购的特别规定

1、基金管理人应在当期保本周期到期前公告处理规则，允许投资者在下一个保本周期开始前的过渡期限定期限内申请购买本基金基金份额，投资者在上述期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。投资者在过渡期限定期限内申购本基金的，按其申购的基金份额在下一个保本周期开始前的折算日所代表的资产净值确认下一保本周期的投资净额并适用下一保本周期的保本条款。

2、基金管理人在当期保本周期到期前，将根据担保人提供的下一个保本周期担保额度确定并公告下一个保本周期的担保规模上限，规模控制的具体方案详见当期保本周期到期前公告的处理规则。

3、投资者在保本周期开始后的开放日申购本基金的，不适用保本条款。

（十）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工作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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。

（十一）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难。
- 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消

除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十二）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，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；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

3、巨额赎回的公告

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

（十三）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为1日或超过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。

（十四）基金转换

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

（十五）基金的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

（十六）基金的转托管

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

（十七）定期定额投资计划

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

（十八）基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

第九节 保本

(一) 保本

本基金对适用保本条款的基金份额持有人投资净额(本基金募集期内投资者的净认购金额及认购利息,在过渡期内进行过渡期申购的投资者申购的基金份额在折算日所代表的资产净值以及由本基金上一个保本周期结束后默认转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额在折算日所代表的资产净值)提供本金保证。

在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期默认选择转入当期保本周期的基金份额持有人持有本基金到当期保本周期到期的,如可赎回金额加上保本周期内的累计分红金额低于其投资净额,则基金管理人或担保人应补足该差额,并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人。本基金第一个保本周期的担保人对此提供不可撤销的连带责任保证。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期内申购的或转换转入的基金份额不适用本条款。

认购保本金额 = 基金持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额。

过渡期申购保本金额 = 基金持有人过渡期申购并持有到期的基金份额的投资净额,即基金份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值。

从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额 = 基金份额持有人将其上一保本周期持有到期的基金份额转入当期保本周期并持有到期的,其基金份额在折算日所代表的资产净值。

对于基金持有人多次认购或申购、赎回的情况,以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

(二) 适用保本条款的情形

1、对于本基金第一个保本周期而言，基金份额持有人在本基金募集期内认购并持有当期保本周期到期的基金份额。

2、对于本基金第一个保本周期后的保本周期而言，基金份额持有人在本基金过渡期限定期限内申购并持有当期保本周期到期的基金份额、基金份额持有人从本基金上一个保本周期默认选择转入当期保本周期并持有当期保本周期到期的基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额）。

3、对持有当期保本周期到期的基金份额，基金份额持有人可以做出如下选择，其投资净额在保本周期到期时都适用保本条款：

（1）在保本周期到期赎回限定期限内赎回基金份额；

（2）在到期赎回限定期内从本基金转换到管理人管理的其他基金；

（3）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有本基金份额转入下一个保本周期；

（4）保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有的本基金份额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额。

（三）不适用保本条款的情形

1、在当期保本周期到期日符合条件的基金份额持有人的可赎回金额加上其在当期保本周期期间的累计分红金额，不低于基金份额持有人的投资净额；

2、基金份额持有人当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额；

3、基金份额持有人在本基金募集期间认购的、基金份额持有人在本基金过渡期限定期限内申购或者基金份额持有人从本基金的上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的、但在当期开放到期赎回的限定期限前赎回或转换转出的基金份额；

4、在保本周期到期日后基金份额发生的任何形式的基金份额净值减少；

5、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；

6、在保本周期内，本基金更换基金管理人，担保人不同意担保的情形；

7、发生不可抗力事件，导致本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务。

第十节 担保

为确保履行保本条款,保障基金份额持有人利益,本基金第一个保本周期由安徽省信用担保集团有限公司作为担保人。由基金管理人代表基金份额持有人与担保人签署《保证合同》。

(一) 担保人基本情况

名称:安徽省信用担保集团有限公司

法定代表人:钱正

注册地址:合肥市长江西路200号

邮政编码:230031

成立日期:2005年11月25日

注册资本:28.66亿元人民币

联系人:袁野

联系电话:0551-5227521

经营范围:为中小企业提供担保,为担保机构提供再担保服务,项目投资,资本运作,资产管理及咨询服务,信用评级,财务顾问,商务信息咨询。

担保人简介:

安徽省信用担保集团有限公司于2005年11月25日成立,是安徽省政府批准设立的国有独资专业担保机构,注册资本28.66亿元。截止到2012年3月31日,安徽省信用担保集团有限公司总资产45.7亿元,净资产35.5亿元,累计实现净利5.94亿元。

截至2012年3月31日,安徽省信用担保集团有限公司对外直接担保在保余额147.22亿元,其中:长盛同鑫保本混合型证券投资基金期末保本份额:1816848957.71份。

(二)《保证合同》

1.《保证合同》

基金管理人为本基金第一个保本周期的保本与担保人签署《保证合同》。《保证合同》的全文详见基金合同的附件。《保证合同》中涉及基金份额持有人利益的主要内容如下:

甲 方:长盛基金管理有限公司

乙 方：安徽省信用担保集团有限公司

(1) 担保额度

担保额度是指乙方同意为甲方向基金份额持有人提供担保的最高金额。

根据甲方的申请和项目实际情况，乙方授予甲方人民币 51 亿元的担保额度。

在担保额度内，在符合本合同约定的条件下，甲方对基金份额持有人所负债务将由乙方为其提供保证担保，乙方的保证责任以本合同为准。

(2) 保证的范围

本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本金额为：认购并持有到期的基金份额的净认购金额及募集期间的利息收入之和，即投资净额。

保证范围为按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额的差额部分。

基金份额持有人在保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的基金份额不在保证范围之内。

乙方承担保证责任的最高限额为人民币 51 亿元。

(3) 保证期间

基金保本周期到期日起六个月。

(4) 保证的方式

在保证期间，乙方在保证范围内承担连带责任保证。

(5) 保证受益人

认购本基金并持有到期的基金份额持有人。

(6) 除外责任

下列任一情形发生时，乙方不承担保证责任：

1) 在保本周期到期日，按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额；

- 2) 基金份额持有人认购,但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出本基金的基金份额;
- 3) 基金份额持有人在本保本周期内申购或转换转入的基金份额;
- 4) 在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形;
- 5) 在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形,且乙方不同意继续承担保证责任;
- 6) 保本周期到期日之后(不包括该日),基金份额发生的任何形式的净值减少;
- 7) 发生不可抗力事件,导致保本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务;
- 8) 未经担保人书面同意修改基金合同条款,可能加重担保人保证责任的,但根据法律法规要求进行修改的除外。

(7) 到期偿付制度安排

1) 到期保本偿付准备及代偿准备

保本偿付准备:

a. 甲方应按照基金合同中的到期赎回制度安排基金资产的变现操作,准备资金应对持有人的赎回;

b. 甲方应在本基金保本周期到期日前 30 个日历日当日预测本基金是否可能发生到期保本偿付,并向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。甲方应自本基金保本周期到期日前 30 个日历日起每周做出预测并应于每周周末之前向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。《保本到期前报送信息》的内容应包括基金资产累计净值、预计到期偿付金额、甲方在保本周期到期日可调度的自有资金总额等数据;

c. 甲方应不迟于保本周期到期日前 6 个月在托管银行开设独立帐户,与乙方共管。从保本周期到期日前 30 个日历日开始,其中任一工作日,保本基金按保证本金要求测算后,若出现不足保证本金的差额,甲方应在次工作日向上述共管账户划转相应金额的风险准备金,以补平上述差额。

代偿准备

a. 在保本周期到期日前 30 个日历日当日,如甲方预测保本周期的到期日甲方可能依据基金合同的约定承担保本责任,且乙方可能依据本合同承担保证

责任的，则甲方应在首份及其后的《保本到期前报送信息》中同时向乙方书面通知经预测的需要乙方代偿的金额，提示乙方准备资金；

b.在保本周期到期日后五个工作日内，甲方不能全额履行保本义务，则甲方应将保本周期到期日的基金资产累计净值、经计算得出的应向基金份额持有人支付的金额、已自行偿付的金额以及需乙方代偿的金额向乙方发出书面《履行保证责任通知书》。《履行保证责任通知书》的格式和内容见附件。

2) 偿付顺序

在保本周期到期日，如根据基金合同甲方需承担保本责任，且根据《保证合同》乙方需要承担保证责任的，则保本差额部分按照下列顺序偿付：

《保证合同》第 6.1.1 (3) (即上文“保本偿付准备”的 c 项) 约定的共管帐户内的风险准备金；

甲方的自有资金；

乙方资金。

乙方在接到甲方书面《履行保证责任通知书》及相关数据资料后五个工作日内将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户，乙方将上述代偿金额足额划入本基金在基金托管人处开立的指定账户中后即视为全部履行了保证责任，代偿款项的分配与支付由甲方负责。

3) 基金份额持有人追偿的权利及其程序、方式

在担保人逾期未能履行保证责任的情况下，基金份额持有人在保证期间内有权委托基金管理人代表基金份额持有人要求乙方按照本合同的约定履行保证责任。但要求担保人承担保证责任的，应在保证期间内提出。

3. 基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意《保证合同》中的约定。

(三) 担保费用及支付方式

担保人为本基金提供保证收取的担保费用不从基金财产中列支。担保费用的费率由基金管理人与担保人协商确定，并以基金管理人的自有资产承担。

担保费从基金管理人收取的本基金管理费中列支，每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付。基金管理人应自每季收到基金管理费之日起 2 个工作日内向乙方支付担保费。基金当期保本周期到期转下一保本周期的过渡期内，即申购限定期，基金管理人支付担保费。

每日担保费=担保费计提日前一日基金资产净值×0.2%×1/当年日历天数

在法律法规允许的前提下,基金管理人依法履行适当程序后,担保费可从基金财产中列支。

(四) 担保的性质和担保范围

本基金保本担保的范围为:

在保本周期到期时,符合条件的基金份额持有人持有当期保本周期到期的基金份额的可赎回金额加上当期保本周期内本基金的累计分红金额,低于投资净额时的差额部分。符合条件的基金份额持有人,对于第一个保本周期而言是指在本基金的募集期间认购本基金的基金份额持有人,对于第一个保本周期后各保本周期而言是指在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人。

担保人为本基金第一个保本周期承担的连带责任保证的金额最高不超过 51 亿元人民币。本基金第一个保本周期后各保本周期的担保人、担保方式及担保额度,由基金管理人在当期保本周期开始前公告。

(五) 影响担保人担保能力情形的处理

保本周期内,担保人出现足以影响其履行《保证合同》项下担保责任能力的情形的,应在该情形发生之日起 3 日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人应在在接到通知之日起 3 个工作日内将上述情况报告中国证监会并提出处理办法,包括但不限于加强对担保人担保能力的持续监督、及时提取风险准备金、当确定担保人已丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况下根据基金合同约定的程序更换担保人等。基金管理人还应在同时通知基金托管人并在接到通知之日起 3 个工作日内在指定媒体上公告上述情形。确定担保人已丧失保证能力的,基金管理人应在 15 个工作日内召集基金份额持有人大会,就如下事项进行表决:

- 1、更换担保人;
- 2、变更基金类别;
- 3、基金合同终止;
- 4、法律法规或中国证监会规定的其他事项。

(六) 担保人的更换

保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过,但因担保人发生合并或分立,由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义

务的除外。更换担保人的,原担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任的担保人承担。在新的担保人接任之前,原担保人应继续承担担保人责任。某一保本周期结束后,基金管理人有权更换下一保本周期的担保人,更换后的担保人为本基金下一保本周期提供的担保不得影响基金份额持有人在基金合同项下享有的保本条款,此项变更无需召开基金份额持有人大会决议通过。

保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过,并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。

保本周期内更换担保人的程序:

1、提名

新任担保人由基金管理人提名。

基金管理人提名的新任担保人必须符合如下条件:(1)具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件;(2)符合基金份额持有人的利益。

2、决议

基金份额持有人大会对被提名的新任担保人形成决议,该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的1/2以上(含1/2)表决通过。

3、备案

基金份额持有人大会选任新任担保人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行。

4、签订《保证合同》

更换担保人经中国证监会核准后,基金管理人与新任担保人签订《保证合同》。

5、公告

基金管理人在中国证监会核准后2日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。

6、交接

原担保人职责终止的,原担保人应妥善保管保本周期内保证业务资料,及时向基金管理人和新任担保人办理保证业务资料的交接手续,基金管理人和新

任担保人应及时接收。

保本周期内更换担保人的,原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前,原担保人应继续承担保证责任。

(七) 担保人免除保证责任的情形

除本部分第(六)款所指的担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任的担保人承担的情况以及本部分第(二)款第1项《保证合同》主要内容的“除外责任”所列明的免责情形外,不得免除担保责任。

保本周期届满时,担保人同意继续为本基金提供担保或基金管理人认可的其他机构继续为本基金的保本提供连带责任保证或者风险买断担保或者中国证监会认可的其他担保方式,同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的,本基金将转入下一保本周期;否则,本基金变更为非保本的混合型基金,基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”,担保人不再为本基金承担担保责任。

(八) 担保责任的履行

基金份额持有人同意授权基金管理人作为其代理人代为行使向担保人索偿的权利并办理相关的手续(包括但不限于向担保人发送履行担保责任的书面通知及代收相关款项等)。如果符合第十四部分第(二)款“适用保本条款的情形”的基金份额在保本周期到期日的可赎回金额加上其在当期保本周期内的累计分红金额之和低于其投资净额的,且基金管理人无法全额履行保本义务或基金管理人不承担保本义务的,基金管理人在保本周期到期日后五个工作日内,向担保人发出书面《履行保证责任通知书》(应当载明需担保人代偿的金额)。担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的五个工作日内,将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户中,由基金管理人将该差额支付给基金份额持有人。若担保人未履行全部或部分保证责任的,基金份额持有人有权直接就差额部分向担保人追偿。担保人将上述代偿金额足额划入本基金在基金托管人处开立的指定账户中后即视为全部履行了保证责任,担保人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责,担保人对此不承担责任。

第十一节 基金的投资

若本基金在当期保本周期内或保本周期到期自动转为下一保本周期，基金的投资适用如下约定：

（一）投资目标

本基金采用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，实现组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金将按照组合保险策略将资产配置于稳健资产与收益资产。本基金投资的稳健资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据、中期票据、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议、银行存款等），以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资的收益资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等。

本基金在保本期内投资债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于 5%；投资股票、权证等收益资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。

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。

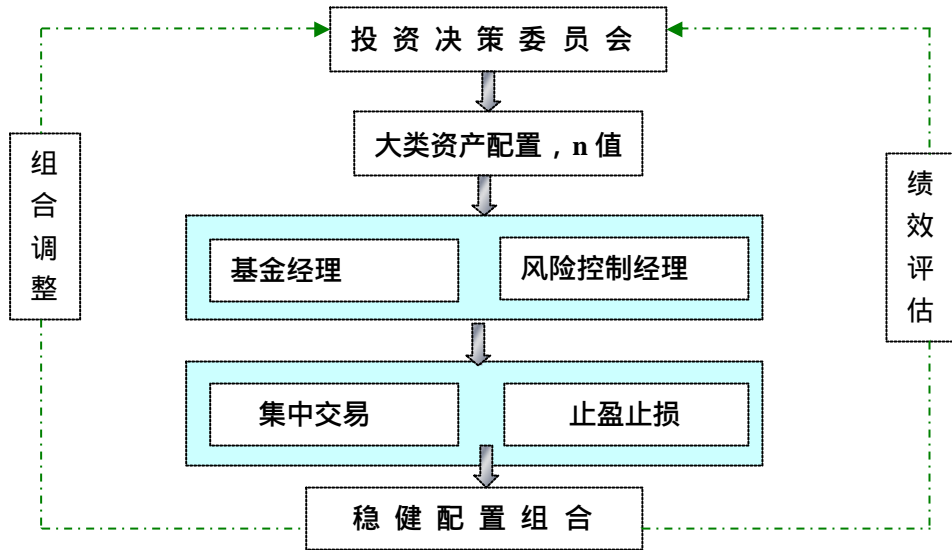
（三）投资理念

在严格有效的风险控制的前提下，追求保本期间稳健收益的最大化。

（四）投资管理流程

我公司具有一套完整、规范的投资流程，贯穿研究、战略性资产配置、战术配置、风险控制、业绩评价等各个环节，通过有力的衔接和反馈机制把各环

节联结为一个整体，保证保本基金运作的可靠性、一致性和风险可控性。我公司保本基金投资流程图如下：



由于保本基金产品高度强调资产配置的科学与投资决策的纪律性，严格运用金融工程手段以有效控制风险，其投资管理在遵循公司成熟的投资流程框架（投决会领导下的基金经理负责制为流程核心）的同时，还具有以下有别于公司旗下其他基金/组合管理流程的鲜明特点：

1、基金经理和风控经理负责制

严格量化的风险控制机制是保证保本基金产品成功运作的关键，因此，本保本基金运作管理在传统基金经理基础上，增设风险控制经理一职，具体负责执行投决会对风险投资额度和大类资产配置比例的决议，协调金融工程小组工作，跟踪组合 VaR 值变化，从风险控制的精确数量化角度对组合提出优化措施。

2、严格的投资纪律

为保证投资纪律性，防止市场波动时基金经理的情绪化投资决策，当组合风险暴露头寸达到警戒比例时，经投决会批准后，投资管理系统将启动止盈止损程序，通过对风险资产进行整体比例减持或具体投资品种进行强制止盈止损，来确保已实现投资收益或减少已可能的投资损失，从制度上避免组合在投资期内大幅急剧波动，实现保本基金稳健投资目标。

（五）投资策略

本基金采用恒定比例组合保险策略（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）和基于期权的组合保险策略（OBPI，Option-Based Portfolio

Insurance)。其中主要通过 CPPI 策略动态调整稳健资产与收益资产的投资比例,以确保在保本期到期时本基金价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。

1、CPPI 投资策略与资产配置

根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动、组合安全垫(即基金净资产超过基金价值底线的数额)的大小动态调整稳健资产与收益资产投资的比例,通过对稳健资产的投资实现保本期到期时保本金额的安全,通过对收益资产的投资寻求保本期间资产的稳定增值。本基金对稳健资产和收益资产的资产配置具体可分为以下四步:

第一步:确定稳健资产的最低配置比例。

根据保本期末投资组合最低目标价值(本基金的最低保本值为保本金额的 100%)和合理的贴现率,设定当期应持有的稳健资产的最低配置数量和比例,即投资组合的安全底线。

$$P_t = PV(P_T) = P_T e^{-r(T-t)}$$

其中: P_t 为当期稳健资产现值, P_T 为保本期末投资组合最低目标价值, r 为贴现率, T 为到期时间, t 为当前时间。

第二步:计算投资组合的安全垫(Cushion),即投资组合净值超过安全底线的数额。

$$C_t = V_t - P_t$$

其中: C_t 为组合安全垫, V_t 为当期投资组合净值。

第三步:确定收益资产的最高配置比例。

根据组合安全垫和收益资产风险特性,决定安全垫的放大倍数——风险乘数,然后根据安全垫和风险乘数计算当期可持有的收益资产的最高配置比例,其余资产投资于稳健资产。

$$E_t = nC_t = n(V_t - P_t)$$

其中: E_t 为当期持有的收益资产上限, n 为放大倍数, $0 < n < 5$ 。

其中放大倍数主要根据当期权益类市场的估值情况、宏观经济运行情况、债券市场收益率水平、基金资产的风险承受能力等因素进行动态调整。

第四步：动态调整稳健资产和收益资产的配置比例。

根据安全垫水平、市场估值情况，并结合市场实际运行态势制定收益资产投资策略，进行投资组合管理，实现基金资产在保本基础上的增值。

2、OBPI 投资策略与资产配置

OBPI 策略主要根据期权的收益特性进行构建，其主要投资思路为在投资期初同时购买风险资产(如：股票)和相应的看跌期权，当股票价格下跌时，可执行看跌期权，以规避股票价格的下跌，当股票价格上涨时，则放弃使用看跌期权，以享受正股价格上行的收益。从投资效果分析，OBPI 的投资目标为一方面可以享受市场上涨时的收益，另一方面又可以锁定市场下跌时的损失。从这个角度出发，OBPI 策略的核心思想为构建一个投资组合，使其下行风险可控，上行可享受投资收益。

而根据期权平价公式，OBPI 策略可由股票和看跌期权的投资组合衍生出另一种投资策略，即通过买入无风险资产和看涨期权以锁定下行风险，具体的决策过程可以通过以下公式推演得到：

$$Call + Xe^{-rt} = Put + S$$

其中：Call 为看涨期权， Xe^{-rt} 为无风险资产，X 为期权的执行价格，S 为股票，Put 为看跌期权。

从上式看出，本基金可以通过不同类型的组合配置实现两类 OBPI 投资策略，一是构建债券组合和看涨期权的组合，即可转换公司债券投资；二是在投资看跌权证时，可在买入该权证的同时，买入权证对应的股票类资产。通过以上两种不同的资产组合来实现下行风险可控，上行可享受投资收益的投资目标。

3、股票投资策略

本基金在构造股票组合时，采取自上而下的方法，定量分析与定性分析相结合，通过组合管理有效规避个股的非系统性风险，通过行业精选确定拟投资的优势行业及相应比例，通过个股选择，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。

股票选择标准：

1) 建立以行业基本面、上市公司基本面、行业二级市场相对投资价值、

分析师建议等因素为基础的多因素行业综合评估模型,对各行业的超额收益潜力进行打分和排序,初步确定当期拟进行投资的优势行业;

2) 建立成长企业甄别模型,选出优势行业中具有可持续成长性的上市公司;

3) 建立成长企业相对定价模型,对潜力公司进行相对价值评估,根据相对价值排序确定股票投资组合的初选方案;

4) 对初选股票组合中上市公司的财务结构、市场表现进行细致分析,结合上市公司调研等手段确定最终的股票组合。

本基金将谨慎参与新股申购。在进行新股申购时,基金管理人将结合数量化模型,使用现金流贴现模型等方法评估股票的内在价值,充分借鉴合作券商等外部资源的研究成果,对于拟发行上市新股(或增发新股)的价值进行深入发掘,评估申购收益率,并通过对申购资金的积极管理,制定相应的申购和择时卖出策略以获取较好投资收益。

4、债券投资策略

在债券投资方面,通过投资于剩余期限与避险周期基本匹配的债券,规避利率、收益率曲线、再投资等各种风险,控制企业债信用风险,并注重利用市场时机、无风险套利、利率预测以及低估值等策略,获取债券投资收益。

(1) 利率策略

利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。通过全面研究国民经济运行状况,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,可以制定出组合的目标久期,预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。

利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略,例如:子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

(2) 类属策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况,货币市场及资本市场资

金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

（3）信用策略

信用策略主要是分析企业债券发行人所处行业发展前景，发行人业务发展状况，企业市场地位，财务状况，管理水平，债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险。根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券的信用风险利差。对企业债券信用级别的研判与投资，主要是发现信用风险利差上的相对投资机会，而不仅是绝对收益率的高低。

（4）选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

5、可转债投资策略

本基金在具体的投资过程中，将综合分析可转换公司债券的股性特征、债性特征、流动性、摊薄率等因素的基础上，采用 Black-Scholes 期权定价模型和二叉树期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，选择其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好，并且其基础股票的基本面优良、具有较好盈利能力或成长前景、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种，以合理价格买入并持有，根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转换公司债券投资组合，获取稳健的投资回报。

此外，本基金将通过分析不同市场环境下可转换公司债券股性和债性的相对价值，通过对标的转债股性与债性的合理定价，力求选择被市场低估的品种，来构建本基金可转换公司债券的投资组合。

6、权证投资策略

本基金将在理论框架的基础上，遵循法律法规的相关规定，运用期权估值模型，根据隐含波动率、剩余期限、正股价格走势，并结合本基金的资产组合状况进行权证投资。

对于法律法规或者监管部门允许投资的其他品种，本基金按照有关规定进行投资。

7、资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述多种因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

（六）业绩比较基准

3 年期银行定期存款税后收益率。

本基金是保本混合型基金产品，保本周期为 3 年。以基金合同成立日所在年度的中国人民银行公布的 3 年期银行定期存款基准利率的税后收益率为计算基准。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告。

（七）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

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

（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证

券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

基于本基金的产品属性，通过兼顾组合投资和分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(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%，本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) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 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；

(8) 本基金在保本期内投资债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，投资股票、权证等收益资产占基金资产的比例不高于 40%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资比例限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(九) 投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

(十) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

若本基金保本周期到期后变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，则基金的投资适用如下约定：

(一) 投资目标

本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票，追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。

(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的各类股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、中期票据、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议、银行存款等）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

投资组合比例为：权益类资产（即股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为 40%-95%；其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产比例为 0%-40%，其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比

例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%。

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

(三) 投资策略

本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略,重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司,同时考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险,通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。

1、资产配置

对宏观经济的经济周期进行预测,在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断,确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中,本基金管理人采用经济周期资产配置模型,通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析,对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测,然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

2、行业配置

不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值与投资时机,据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业,把握行业景气轮换带来的投资机会。

具体操作中,首先考察各行业历史收入和利润增长表现,对未来行业收入增长率和行业平均利润增长率进行预测;然后对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序,挑选出未来一段时间内最具增长前景的行业。具体评估将从宏观经济环境、行业景气度分析和预测、行业财务状况和行业竞争力综合表现四个方面入手,采用定性分析结合定量分析的方法对行业的未来的增长前景进行综合评价。

最后,在完成对行业增长预测和行业综合评价基础上,通过市场及各个行业的相对和绝对估值水平 PE、PB 等数据的横向、纵向分析,进行估值比较,并跟踪各行业的资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力,动态把握行业板块轮换蕴涵的投资机会。

3、股票选择

(1) 中小盘股票的定义

基金管理人自成立及期后每六个月月末将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到 A 股总流通市值 2/3 的这部分股票称为中小盘股票。在前后两次调整排序期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其流通市值（对未上市新股而言为本基金管理人预计的流通市值）可满足以上标准，也称为中小盘股票。

一般情况下，上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。当权威的证券数据服务机构能够提供可供投资者在公开股票市场上买卖的自由流通股本数据时，本基金管理人可采取自由流通股本乘以收盘价计算流通市值。

基金因所持有股票价格的相对变化而导致中小盘股票投资比例低于基金合同规定的范围，本基金管理人将根据市场情况，本着投资者利益最大化的原则，适时予以调整，最长不超过 3 个月。如果今后市场中出现更科学合理的中小盘股票界定及流通市值计算方式，本基金将予以相应调整，并提前公告变更后具体的计算方法。

(2) 股票投资策略

本基金综合运用长盛股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，中小盘股票中的优势股票优先入选。具体分以下两个层次进行股票挑选：

1) 品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理上符合基本要求的上市公司，构建备选股票池，主要筛选指标包括：估值比较（PE、PB、PEG、PS、PCF 等）、盈利能力（ROE、ROA、毛利率、EBITDA 利润率等）、盈利质量（企业自由现金流量 FCF、主营收入现金含量等）、成长能力（主营业务收入增长率、销售收入增长率、EPS、NAV、净利润等）、运营能力（资产周转率等）、负债水平（资产负债率等）。

2) 价值评估

本基金在前述优势行业选择体系的基础上,根据下述标准挑选出其中具有投资潜力的上市公司构建核心股票池:

公司治理结构良好,管理规范,信息透明,无违规行为;

公司主营业务鲜明,盈利能力强,收入和利润稳定增长;

公司具有优良的成长性,不断增长或改善的优质公司;

公司财务状况良好,具备规模优势和较好的抗风险能力;

公司在产品、技术方面具有核心竞争优势,处于行业龙头。

对上述核心股票池中的重点上市公司进行内在价值评估和成长性研究,在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可持续的投资标的。

4、债券投资策略

在本基金的债券投资过程中,本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势,采取积极主动的投资管理,以中长期利率趋势分析为基础,结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。通过确定债券组合久期、确定债券组合期限结构配置和挑选个券等三个步骤构建债券组合,尽可能地控制风险,提高基金投资收益。

5、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。

6、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(五) 业绩比较基准

该混合型基金的整体业绩比较基准采用:

$60\% \times \text{中证 500 指数} + 40\% \times \text{中证全债指数}$

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则

本基金管理人将视情况调整本基金的业绩评价基准,并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

(六) 风险收益特征

该基金是一只混合型基金,属于基金中的中高风险品种,风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

(七) 投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

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

2、基金投资组合比例限制

基于本基金的产品属性,通过兼顾组合投资和分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。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) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;
- (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) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 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；

(8) 本基金投资组合比例为：权益类资产（即股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为 40%-95%；债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产比例为 0%-40%。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自本基金变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述

约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(八) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

第十二节 基金的财产

(一) 基金资产总值

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

(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

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四) 基金财产的保管和处分

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

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

第十三节 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交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

（三）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（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，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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如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；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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。

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；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、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）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、权证估值：

（1）配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

（2）认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值。

5、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

6、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

7、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。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、

程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

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

(四) 估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.001元,小数点后第4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。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将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。

(五) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 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。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 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；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

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

(六) 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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和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的基金资产净值和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。

第十四节 基金的收益与分配

(一) 基金利润的构成

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

(二) 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至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数。

(三) 基金收益分配原则

1、 基金收益分配方式：

(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

(2) 本基金变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”后：基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，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；

2、 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额；

3、 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

4、 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、 每一基金份额享有同等分配权；

6、 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(四) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

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。

(六) 基金收益分配中发生的费用

1、 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；

2、 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承

担。如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，则前述银行转账等手续费用由相应销售机构（基金管理人或代销机构）承担；

3、若基金转型为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。

第十五节 基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用、证券账户等的开户费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（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 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本基金当期保本周期到期转下一保本周期的过渡期内，即申购限定期，不收取基金管理费和基金托管费。

4、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法同上。

上述“一、基金费用的种类中第 3 - 7 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十六节 基金的会计与审计

（一）基金会计政策

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

（二）基金的年度审计

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

第十七节 基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

（二）信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，

并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

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

(三)本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

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

(四)本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

(五)公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

(1)基金招募说明书、《基金合同》、托管协议

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

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

提供书面说明。

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

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

(2) 基金份额发售公告

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

(3) 《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒体上登载《基金合同》生效公告。

(4) 基金资产净值、基金份额净值

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

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

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

(5) 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《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，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(6) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定媒体上。

《基金合同》生效不足 2 个月的,基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

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

(7) 临时报告

本基金发生重大事件,有关信息披露义务人应当在 2 个工作日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

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

- 1)、基金份额持有人大会的召开;
- 2)、终止《基金合同》;
- 3)、转换基金运作方式;
- 4)、更换基金管理人、基金托管人;
- 5)、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6)、基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7)、基金募集期延长;
- 8)、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9)、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- 10)、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
- 11)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 12)、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13)、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到

严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

- 14)、重大关联交易事项；
- 15)、基金收益分配事项；
- 16)、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17)、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18)、基金改聘会计师事务所；
- 19)、变更基金销售机构；
- 20)、更换基金登记机构；
- 21)、本基金开始办理申购、赎回；
- 22)、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23)、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24)、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25)、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26)、中国证监会规定的其他事项。

(8) 澄清公告

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

(9) 基金份额持有人大会决议

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

(10) 保本相关信息

1)、《保证合同》作为本基金的基金合同、招募说明书的附件，并随基金合同、招募说明书一同公告。

2)、在保本周期到期时更换担保人或保本周期内更换担保人，基金管理人除根据基金合同履行必要程序外，还须按照法律法规和基金合同规定及时公告。

3)、为向基金份额持有人明确担保人承担的保证义务，担保人依据《保证合同》向本基金的基金份额持有人出具保函。

4)、保本周期届满时，基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金是否继续存续、持有人到期选择及转入下一个保本周期前的过渡期申购或者本基金变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”等相关事宜进行公告。

5)、在保本周期到期前，基金管理人还将进行提示性公告。

(11) 中国证监会规定的其他信息。

(六) 信息披露事务管理

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

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

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

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

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，相关档案的保存期限不低于监管机构规定的最低期限。

(七) 信息披露文件的存放与查阅

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

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人应保证上述文本的内容与公告的内容完全一致。

第十八节 保本周期到期

（一）保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一个保本周期，下一保本周期的起始日一般为上一保本周期到期日后，下一保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准；

如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”。同时，变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金投资及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人协商一致后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后公告，并在更新的招募说明书中予以说明。

如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将根据基金合同的规定终止。

（二）保本周期到期的处理规则

1、在本基金保本周期到期日前的到期赎回限定期内，基金份额持有人可以做出如下选择，其持有当期保本周期到期的基金份额都适用保本条款：

（1）在到期赎回限定期内赎回其持有当期保本周期到期的基金份额；

（2）在到期赎回限定期内将其持有当期保本周期到期的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金。

2、本基金保本周期到期日后，基金份额持有人未选择赎回或转换转出的，按以下两种情形处理，且其持有当期保本周期到期的基金份额都适用保本条款：

（1）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人持有的基金份额将根据届时基金管理人的公告自动转入下一个保本周期；

（2）保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人所持有的本基金基金份额默认转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额。

3、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人（对于第一个保本周期

期而言) 在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人(对于第一个保本周期后的各保本周期而言), 在到期赎回限定期内选择赎回或者转换转出的, 均无需支付赎回费用、基金间转换费用(基金间转换费用包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差, 下同)。

在当期保本周期开始后申购的或转换转入的基金份额, 不适用到期赎回限定期的条款。基金份额持有人就其在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额选择赎回时, 需支付赎回费用; 选择基金间转换时, 按规定支付基金转换费用, 其赎回费或基金间转换费用按照招募说明书或相关公告规定的费率确定, 其持有时间以该份额在登记机构的登记日开始计算。

在折算日登记在册的基金份额(包括投资者进行过渡期申购的基金份额和上一保本周期结束后默认选择转入下一保本周期的持有人所持有的基金份额)转入下一保本周期时, 无需支付费用。

如保本周期到期后, 本基金未能符合保本基金存续条件, 则本基金将按基金合同的约定, 变更为非保本的混合型基金, 基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”。基金份额持有人在保本周期到期时持有的基金份额(包括持有当期保本周期到期的基金份额和在当期保本周期内申购和转换转入的基金份额)在保本周期到期后默认转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额的, 无需再支付转换费用。

(三) 保本周期到期选择的时间约定

本基金保本周期到期前, 基金管理人将提前公告并提示基金份额持有人作出到期选择申请。

在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中, 由基金管理人指定在当期保本周期结束前5个工作日内至当期保本周期到期日(含当期保本周期到期日)的一段期间为到期赎回限定期。基金份额持有人在到期赎回限定期内将在当期保本周期内持续持有的基金份额进行赎回或转换为基金管理人管理的其他基金的, 视为持有到期, 无需支付赎回费用、基金间转换费用, 其赎回日或转换日为当期保本周期到期日。到期赎回采取“未知价”原则, 基金份额持有人可赎回金额或转出金额以基金份额持有人实际赎回日或转换日当日的本基金基金份额净值为基准进行计算。基金份额持有人可按持有当期保本周期到期赎回

日或转换日当日基金份额的可赎回金额加上当期保本周期内的累计分红金额低于保本额的差额（即保本赔付差额）享有保本利益。当期保本周期到期日之后的净值下跌风险应由基金份额持有人自行承担。

（四）保本周期到期的保本条款

1、基金份额持有人对于其在本基金募集期认购本基金并持有第一个保本周期到期的基金份额、在本基金过渡期限定期限内申购并持有当期保本周期到期的基金份额以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期并持有当期保本周期到期的基金份额，无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、默认选择转入下一个保本周期或是继续持有变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，均适用保本条款。

2、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，若在当期保本周期的到期赎回限定期内选择赎回基金份额、转换基金份额或继续持有基金份额，而可赎回金额加上当期保本周期内的累计分红金额低于其投资净额，基金管理人或担保人应补足该金额差额。

3、若本基金保本周期到期后不符合保本基金存续条件，在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，若继续持有基金份额，其持有的基金份额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的基金份额，而可赎回金额加上当期保本周期期间的累计分红金额低于其投资净额，基金管理人或担保人应补足该金额差额。

（五）下一保本周期基金资产的形成

1、过渡期和过渡期申购

在公告的到期处理规则中，基金管理人指定在当期保本周期到期后，即当期保本周期到期日至下一保本周期开始之前不超过 15 个工作日的一段期间的过渡期作为进行申购限定期限。

投资者在申购限定期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在申购限定期限内，投资者转换入本基金基金份额，视同为过渡期申购。投资者进行的过渡期申购，其投资净额适用下一保本周期的保本条款。

(1) 基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

(2) 过渡期申购采取“未知价”原则，即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。

(3) 投资者进行过渡期申购的，其持有相应基金份额至过渡期最后一日（含该日）期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

(4) 过渡期申购费率

本基金过渡期申购费率如下：

过渡期申购金额(含申购费)	费率
M < 50 万	0.8%
50 万 M < 200 万	0.5%
200 万 M < 500 万	0.2%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(5) 过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告。

(6) 过渡期内，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

2、下一保本周期基金资产的形成

(1) 持有到期的基金份额

如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额可赎回金额加上相应基金份额的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

对于投资者认购或者在保本周期内申购、转换入的基金份额，选择或默认选择转入下一保本周期的，转入下一保本周期的转入金额等于选择或默认选择

转入下一保本周期的相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值。

（2）过渡期申购的基金份额

对于投资者过渡期申购的基金份额，转入下一保本周期的转入金额等于相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值。

3、基金份额折算

下一保本周期开始日的前一工作日为折算日。对在折算日登记在册的基金份额持有人所持有的基金份额（过渡期申购的持有人所持有的基金份额和上一个保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额），将以折算日的基金估值为基础，在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.000 元的基金份额，其持有的基金份额数额按折算比例相应调整。具体折算规则由基金管理人通过到期处理规则进行公告。

4、下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日，本基金进入下一保本周期运作。

本基金进入下一保本周期后，仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务，下一保本周期的日常申购按基金合同有关约定执行。投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换入本基金基金份额的，相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。

（六）转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”资产的形成

保本周期届满时，若本基金依据基金合同的规定转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”：

1、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，如果其持有当期保本周期到期的可赎回金额加上当期保本周期期间的累计分红金额高于其投资净额，则按可赎回金额作

为转入变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的转入金额；

如果持有到期的可赎回金额加上保本周期间的累计分红金额低于其投资净额，则按投资净额（扣除已分红款项）为转入金额转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”基金份额。

2、在保本周期间内申购本基金的基金份额持有人，如果继续持有本基金而转为变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，则按可赎回金额作为转入变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的转入金额。

3、变更后的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”申购的具体操作办法由基金管理人提前公告。

（七）保本周期间到期的公告

1、保本周期间届满时，在符合保本基金存续条件下，保本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续、持有人到期选择及转入下一个保本周期间前的过渡期申购等相关事宜进行公告。

2、保本周期间届满时，在不符合保本基金存续条件下，保本基金将变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的更新招募说明书中公告相关规则。

3、基金管理人可以修改相关规则，并将在临时公告或更新的招募说明书中公告。

4、在保本周期间到期前，基金管理人还将进行提示性公告。

（八）保本周期间到期的赔付

发生赔付的具体操作细则由基金管理人依据基金合同和与担保人所签署的合同约定提前公告。

第十九节 风险揭示

证券价格因受各种因素的影响而引起波动，将使本基金资产面临潜在的风

险，主要包括：

（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）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。

（三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

（四）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。

(五) 本基金特定风险

1、投资组合保险方法的风险

本基金采用恒定比例组合保险策略(CPPI),在理论上可以实现为认购并持有到期的基金份额的保本目的,但其中的一个重要假定是投资组合中股票与债券的仓位比例能够根据市场环境的变化作出适时的、连续的调整,而在现实投资过程中可能由于流动性或市场急速下跌等原因影响到CPPI保险方法的保本功能,由此产生的风险为投资组合保险方法的风险。

2、担保风险

本基金在引入了担保人机制下也会因下列情况的发生而导致保本周期到期日不能偿付本金,由此产生担保风险,这些情况包括:在保本周期内本基金更换管理人,而担保人不同意继续承担保证责任;或发生不可抗力事件,导致本基金亏损或担保人无法履行保证义务;或保本周期内担保人因经营风险丧失保证能力从而无法履行保证责任。

3、存在不适用保本条款的情形

1) 在当期保本周期到期日符合条件的基金份额持有人的可赎回金额加上其在当期保本周期期间的累计分红金额,不低于基金份额持有人的投资净额;

2) 基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额;

3) 基金份额持有人在本基金募集期间认购的、基金份额持有人在本基金过渡期限定期限内申购或者基金份额持有人从本基金的上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的、但在到期赎回限定期前赎回或转换转出的基金份额;

4) 在保本周期到期日后基金份额发生的任何形式的基金份额净值减少;

5) 在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形;

6) 在保本周期内,本基金更换基金管理人,担保人不同意担保的情形;

7) 发生不可抗力事件,导致本基金投资亏损或导致基金管理人或担保人无法履行保本义务。

(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。

第二十章 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

3、《基金合同》可能加重担保人保证责任的变更需经担保人书面同意，但根据法律法规要求进行修改的除外。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

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

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
（3）对基金财产进行估值和变现；
（4）制作清算报告；
（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告 ;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后五个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第二十一节 基金合同的内容摘要

基金合同的内容摘要见附件一。

第二十二节 基金托管协议的内容摘要

基金托管协议的内容摘要见附件二。

第二十三节 对基金份额持有人的服务

基金管理人为基金份额持有人提供以下一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化,增加、修改服务项目:

（一）基金份额持有人注册登记服务

基金管理人委托或作为注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统,准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管,基金份额持有人名册的管理,权益分配时红利的登记、派发,基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

（二）红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配,则该基金份额

持有人当期分配所得基金收益将按除息日的基金份额净值自动转为基金份额，且不收取任何费用。

（三）定期投资计划

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

（四）网上交易服务

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

（五）主动通知服务

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

（六）查询服务

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

具体查询内容：

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

短信查询：基金净值情况、账户情况

或可直接致电客户服务热线转人工查询。

（七）资料索取服务

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

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

上索取信息。

同时，公司网站上提供各种资料、业务表单及公告下载。

（八）资讯服务定制

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

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

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

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

（九）投资业务咨询

基金管理人拥有一支训练有素、专业知识全面的投资顾问队伍，为更好地与基金份额持有人进行沟通，公司的专业客户服务代表在工作时间内为客户解答疑问，提供关于基金投资全方位的咨询服务。同时，还提供在线交流及手机短信交流。

（十）投诉建议受理

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

（十一）互动活动

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

（十二）长盛客户服务中心联系方式

长盛基金管理有限公司客户服务热线：（010）62350088

400-888-2666

长盛基金管理有限公司网址：www.csfunds.com.cn

长盛基金管理有限公司客户服务电子信箱：services@csfunds.com.cn

第二十四节 招募说明书的存放和查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的住所或办公地址，投资者可在工作时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

第二十五节 备查文件

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会批准长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《保证合同》
- 4、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金保函》
- 5、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 6、关于募集长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金的法律意见书；
- 7、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 9、担保人的基本资料。

（二）备查文件存放地点

本基金管理人长盛基金管理有限公司办公地点—北京海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层。

（三）投资者查阅方式

可咨询本基金管理人，部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

长盛基金管理有限公司

二 一二年六月八日

附件一：基金合同的内容摘要

第一部分 基金合同当事人及其权利、义务

一、基金管理人

(一) 基金管理人简况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

成立日期：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】6 号

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；及中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

(二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集基金；

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

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

(4) 销售基金份额；

(5) 召集基金份额持有人大会；

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

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

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

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

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

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

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

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

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

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关

基金事务的行为承担责任；

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 按照基金合同约定履行保本义务,严格遵守《基金合同》中有关保本和保本条款的约定。保本周期到期日若发生需要保本赔付的情形,基金管理人应于保本周期到期日后向基金份额持有人履行保本赔付差额的支付义务;基金管理人不能全额履行保本赔付差额支付义务的,基金管理人应于保本周期到期日后书面要求担保人按时履行保本赔付差额的支付义务。如相应款项未按时到账,基金管理人应当履行催付职责,严格遵守本基金《基金合同》中有关保本内容的相关约定；

(28) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金托管人

(一) 基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府

债券 ;从事同业拆借 ;提供信用证服务及担保 ;代理收付款项及代理保险业务 ;提供保险箱服务 ;外汇存款 ;外汇贷款 ;外汇汇款 ;外币兑换 ;国际结算 ;同业外汇拆借 ;外汇票据的承兑和贴现 ;外汇借款 ;外汇担保 ;结汇、售汇 ;发行和代理发行股票以外的外币有价证券 ;买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券 ;自营外汇买卖 ;代营外汇买卖 ;外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款 ;资信调查、咨询、见证业务 ;组织或参加银团贷款 ;国际贵金属买卖 ;海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务 ;在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币 ;经中国人民银行批准的其他业务。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，

确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

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

(5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

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

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

(8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格;

(9)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

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

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

(12)建立并保存基金份额持有人名册;

(13)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

(16)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

三、基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

(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、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 基金管理人及担保人未履行保本义务及保证责任时，直接向基金管理人或担保人追偿；

(10) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义

务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

第二部分 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

一、召开事由

- 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：
 - (1) 终止《基金合同》，但基金合同另有约定的除外；
 - (2) 更换基金管理人、更换基金托管人；
 - (3) 保本周期内更换担保人，但因担保人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义务的除外；
 - (4) 转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
 - (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但在保本周期届满时本基金在不符保本基金存续条件的情况下按照基金合同约定变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”并按基金合同约定的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的管理费率和托管费率计提管理费和托管费的以及根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
 - (6) 变更基金类别，但在保本周期届满时本基金在不符保本基金存续条件的情况下按照基金合同约定变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基

金”的除外；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本周期届满时本基金在不符保本基金存续条件的情况下本基金按照基金合同约定变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”并按基金合同约定的“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”的投资目标、投资范围和投资策略执行以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

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

(12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(4) 某一个保本周期结束后，保持或变更下一个保本周期的保本保障机制；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

(7) 某一保本周期结束后，基金管理人有权更换下一保本周期的担保人，更换后的担保人为本基金下一保本周期提供的担保不得影响基金份额持有人在基金合同项下享有的保本条款，此项变更无需召开基金份额持有人大会决议通过；

(8) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的

以外的其他情形。

二、会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

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

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

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

四、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书

面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)；

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

(5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和

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

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

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

七、计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

八、生效与公告

基金份额持有人大会的决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒体上公告。

如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

九、保本周期内变更担保人所需召开持有人大会

在保本周期内变更担保人,需召开持有人大会,由基金管理人召集,召集方式、通知、开会方式、议事内容与程序、表决、计票及公告程序应符合上述基金份额持有人大会的相关规定。

在保本周期内,基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过变更担保人的事项,基金管理人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案,自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金管理人依据基金份额持有人大会的决议及证监会依法核准意见履行变更基金担保人程序(见基金合同第十三部分),且原担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任的担保人承担。

第三部分 基金合同解除和终止的事由、程序

一、《基金合同》的变更

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

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行,自决议生效之日起在指定媒体公告。

3、《基金合同》可能加重担保人保证责任的变更需经担保人书面同意,但根据法律法规要求进行修改的除外。

二、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:

- 1、基金份额持有人大会决定终止的;
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;

- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

三、基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- (1)《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
 - (2)对基金财产和债权债务进行清理和确认；
 - (3)对基金财产进行估值和变现；
 - (4)制作清算报告；
 - (5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
 - (6)将清算报告报中国证监会备案并公告。
 - (7)对基金财产进行分配；
- 5、基金财产清算的期限为 6 个月。

四、清算费用

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

五、基金财产清算剩余资产的分配

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

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收

回。

六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告 ;基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后五个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第四部分 争议解决方式

本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

《基金合同》受中国法律管辖。

第五部分 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，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

附件二：基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 基金管理人 (或简称“管理人”)

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

成立时间：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】6 号

组织形式：有限责任公司 (中外合资)

注册资本：1.5 亿元人民币

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人 (或简称“托管人”)

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。

（1）本基金在当期保本周期内或保本周期到期自动转为下一保本周期时，投资范围、投资对象适用如下约定：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金将按照组合保险策略将资产配置于稳健资产与收益资产。本基金投

资的稳健资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据、中期票据、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议、银行存款等），以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资的收益资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等。

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。

（2）本基金在过渡期内时，基金的投资范围、投资对象适用如下约定：基金管理人应在过渡期内使可变现的基金资产保持为现金形式。

（3）若本基金保本周期到期后变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，则基金的投资适用如下约定：

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市各类股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、中期票据、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、资产支持证券、债券回购等）、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议、银行存款等）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

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

基金管理人应将拟投资的股票库、中小盘投资股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2、对基金投融资比例进行监督；

A．本基金在当期保本周期内或保本周期到期自动转为下一保本周期时，投资组合比例限制如下：

- （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发行的

证券，不得超过该证券的 10%；

(3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(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%，本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) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 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；

(8) 本基金在保本期内投资债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%；投资股票、权证等收益资产占基金资产的比例不高于 40%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资比例限制。

《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。

B. 若本基金保本周期到期后变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，则投资组合比例限制如下：

(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发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(3) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过

基金资产净值的 40%；

(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) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(7) 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；

(8) 本基金投资组合比例为：权益类资产（即股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为 40%-95%；债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产比例为 0%-40%。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的 80%；

(9) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自本基金变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

3、为对基金禁止从事的关联交易进行监督,基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单;

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库,交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化,及时对交易对手库予以更新和调整,并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督;

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则,对银行间交易对手的资信状况进行评估,控制交易对手的资信风险,确定与各类交易对手所适用的交易结算方式,在具体的交易中,应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失,基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款,基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定,事先确定符合条件的所有存款银行的名单,并及时提供给基金托管人,基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督。

(二)基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、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复核。

(三)基金托管人在上述第(一)(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定,应及时通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管

人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人发现基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

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

(五)基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

三、基金管理人对于基金托管人的业务监督和核查

1、在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、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、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

四、基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(二) 基金合同生效前募集资金的验资和入账

- 1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

(三) 基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
- 3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。
- 4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

(四) 基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料,并对基金托管人给予积极配合和协助。

(五) 基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、基金托管人应当代表本基金,以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本基金证券账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户,亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后,本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的,涉及相关账户的开设、使用的,若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

(六) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户,并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后,由基金托管人负责向中国人民银行报备。

(七) 基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

(八) 与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合

同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

五、基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每估值日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个估值日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，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。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的

净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

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

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

（三）基金份额持有人名册的保管

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

七、争议解决方式

(一)基金管理与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(二)除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、托管协议的修改与终止

(一) 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

(二) 托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

(三) 基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

附件三：《保证合同》

甲 方：长盛基金管理有限公司

公司地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：010-82019988

传真：010-82255988

邮编：100088

乙 方：安徽省信用担保集团有限公司

公司地址：安徽省合肥市长江西路 200 号

法定代表人：钱正

电话：0551-5227521

传真：0551-5292621

邮编：230031

乙方同意为甲方在《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》中承担的保本义务向认购长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金份额并持有到期的基金份额持有人以保证的方式提供担保，甲、乙双方依照国家法律法规的规定，经协商一致，订立本合同。

第一条 释 义

- 1.1 基金或本基金：指长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金；
- 1.2 《基金合同》：指《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及对《基金合同》的任何有效的修订和补充；
- 1.3 基金份额持有人：指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金份额的投资者；
- 1.4 保本周期到期日：指本基金保本周期（如无特别指明，保本周期即为本基金第一个保本周期）届满的最后一日。本基金的保本周期为三年，自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止，

如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日；

- 1.5 持有到期：指基金份额持有人在保本周期内一直持有其所认购的基金份额的行为；
- 1.6 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 1.7 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的数值；
- 1.8 不可抗力：指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征收征用、没收、法律法规变化、恐怖袭击、传染病传播或其他突发事件。

《基金合同》与本合同项下之词语和表述均应具有相同的含义，如有冲突，以《基金合同》为准。

第二条 担保额度

- 2.1 担保额度是指乙方同意为甲方向基金份额持有人提供担保的最高金额。
- 2.2 根据甲方的申请和项目实际情况，乙方授予甲方人民币 51 亿元的担保额度。
- 2.3 在担保额度内，在符合本合同约定的条件下，甲方对基金份额持有人所负债务将由乙方为其提供保证担保，乙方的保证责任以本合同为准。

第三条 保证先决条件

除非本条所规定的保证先决条件已获满足或已被乙方放弃，否则，乙方有权拒绝为甲方提供保证。

- 3.1 甲方作为本基金的管理人, 自主承担基金的投资管理和风险控制义务, 对基金的投资运作负全部责任;
- 3.2 乙方作为本基金保本的担保人, 对基金的运作享有必要的知情权和监控权, 其监控行为以不侵害基金份额持有人的利益, 不影响甲方独立按照法律、法规、基金合同及相关各方签订的法律文件进行自主基金管理运作为限;
- 3.3 乙方在不违反法律法规、监管机构相关政策和保守甲方商业秘密的前提下, 可获得甲方提供的风险监控信息;
- 3.4 《基金合同》项下与保本及保本的保证有关的约定不得违反本合同项下的约定。

第四条 保证内容

4.1 保证的范围

本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本金额为: 认购并持有到期的基金份额的净认购金额及募集期间的利息收入之和, 即投资净额。

保证范围为按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额的差额部分。

基金份额持有人在保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的基金份额不在保证范围之内。

乙方承担保证责任的最高限额为人民币 51 亿元。

4.2 保证期间

基金保本周期到期日起六个月。

4.3 保证的方式

在保证期间, 乙方在保证范围内承担连带责任保证。

4.4 保证受益人

认购本基金并持有到期的基金份额持有人。

4.5 除外责任

下列任一情形发生时, 乙方不承担保证责任:

- (1) 在保本周期到期日, 按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额;
- (2) 基金份额持有人认购, 但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出本基金的基金份额;
- (3) 基金份额持有人在本保本周期内申购或转换转入的基金份额;
- (4) 在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形;
- (5) 在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形, 且乙方不同意继续承担保证责任;
- (6) 保本周期到期日之后(不包括该日), 基金份额发生的任何形式的净值减少;
- (7) 发生不可抗力事件, 导致保本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务;
- (8) 未经担保人书面同意修改《基金合同》条款, 可能加重担保

人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

第五条 担保费的收取

- 5.1 甲方应按本条规定向乙方支付担保费。
- 5.2 担保费收取方式: 担保费从甲方收取的本基金管理费中列支, 按 5.3 款公式每日计算, 逐日累计至每季季末, 按季支付。甲方应自每季收到基金管理费之日起 2 个工作日内向乙方支付担保费。
- 5.3 每日担保费计算公式=担保费计提日前一日基金资产净值×0.2%×1/当年日历天数。

第六条 到期偿付制度安排

6.1 到期保本偿付准备及代偿准备

6.1.1 保本偿付准备:

- (1) 甲方应按照《基金合同》中的到期赎回制度安排基金资产的变现操作, 准备资金应对持有人的赎回;
- (2) 甲方应在本基金保本周期到期日前 30 个日历日当日预测本基金是否可能发生到期保本偿付, 并向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。甲方应自本基金保本周期到期日前 30 个日历日起每周做出预测并应于每周周末之前向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。《保本到期前报送信息》的内容应包括基金资产累计净值、预计到期偿付金额、甲方在保本周期到期日可调度的自有资金总额等数据;
- (3) 甲方应不迟于保本周期到期日前 6 个月在托管银行开设独立帐户, 与乙方共管。从保本周期到期日前 30 个日历日开始, 其中任一工作日, 保本基金按保证本金要求测算后, 若出现不足保证本金的差额, 甲方应在次工作日向上述共管账户划转相应金额的

风险准备金，以补平上述差额。

6.1.2 代偿准备

- (1) 在保本周期到期日前 30 个日历日当日，如甲方预测保本周期的到期日甲方可能依据《基金合同》的约定承担保本责任，且乙方可能依据本合同承担保证责任的，则甲方应在首份及其后的《保本到期前报送信息》中同时向乙方书面通知经预测的需要乙方代偿的金额，提示乙方准备资金；
- (2) 在保本周期到期日后五个工作日内，甲方不能全额履行保本义务，则甲方应将保本周期到期日的基金资产累计净值、经计算得出的应向基金份额持有人支付的金额、已自行偿付的金额以及需乙方代偿的金额向乙方发出书面《履行保证责任通知书》。《履行保证责任通知书》的格式和内容见附件。

6.2 偿付顺序

在保本周期到期日，如根据《基金合同》甲方需承担保本责任，且根据本合同乙方需要承担保证责任的，则保本差额部分按照下列顺序偿付：

- (1) 本合同第 6.1.1 (3) 约定的共管帐户内的风险准备金；
- (2) 甲方的自有资金；
- (3) 乙方资金。

乙方在接到甲方书面《履行保证责任通知书》及相关数据资料后五个工作日内将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户，乙方将上述代偿金额足额划入本基金在基金托管人处开立的指定账户中后即视为全部履行了保证责任，代偿款项的分配与支付由甲方负责。

6.3 基金份额持有人追偿的权利及其程序、方式

在担保人逾期未能履行保证责任的情况下，基金份额持有人在保证期间内有权委托基金管理人代表基金份额持有人要求乙方按照本合同的约定履行保证责任。但要求担保人承担保证责任的，应在保证期间内提出。

第七条 乙方的追偿权

乙方承担了保证责任后，即有权要求甲方在乙方代偿之日起三十日内归还乙方为承担保证责任支付的全部款项和自乙方代偿之日起以乙方支付的全部款项为基数按每日万分之四计算应付给乙方的资金占用费。

第八条 甲方的权利与义务

8.1 甲方权利义务

- (1) 甲方有权在遵守《基金合同》和《风险监控协议》条款的前提下自主进行本基金的管理及运作。
- (2) 甲方应按约定向乙方支付担保费。
- (3) 若甲方未能按本合同第七条约定向乙方清偿本合同第七条约定的全部款项，逾期每日须加付未付款项万分之二的违约金。
- (4) 未经乙方书面同意，甲方不得以任何形式对《基金合同》的条款进行修改，加重乙方保证责任，但根据法律法规要求进行的修改除外。

8.2 乙方权利义务

- (1) 乙方有权按约定收取担保费；

- (2) 乙方有义务按照本合同的约定提供和承担保证责任;
- (3) 乙方承担了保证责任后, 有权按本合同第七条的约定, 要求甲方归还乙方为承担保证责任支付的全部款项;
- (4) 受限于本合同 3.2 条, 乙方有权对甲方管理、运作本基金的行为进行监控, 具体内容见乙方与甲方签订的《风险监控协议》。

8.3 双方的通知义务

除本合同另有规定, 在本合同有效期内, 合同任何一方有下列情形之一的, 应自知悉以下情形之日起三日内, 以书面形式通知对方:

- (1) 发生或可能发生合并、分立、重组、兼并、股份制改造等公司形式的重大变更情形;
- (2) 发生或可能发生超过净资产(指最近一次经审计的净资产)10%的重大资产转让、处置、举借新债或其他可能导致同等影响的财务状况变更;
- (3) 信用评级机构对一方的信用评级发生消极变化;
- (4) 变更名称、住所、经营范围、注册资本、法定代表人;
- (5) 发生或可能发生被监管机构吊销营业执照、取消业务资格等导致丧失履行本合同民事权利能力或行为能力的情形;
- (6) 发生或可能发生终止经营、清算、申请解散、被接管或撤销、被法院宣告破产、被责令关闭、被行政管理机关、监管机构处罚等事宜;
- (7) 发生或可能发生的资产被查封、冻结、扣押或被采取其它强制措施等情形;
- (8) 发生致使一方不再符合担任本基金的基金管理人或担保人

的任何情形;

(9) 出现导致其不能履行本合同项下义务的其它情形。

第九条 权利、义务的转让

未经另一方书面同意,本合同任何一方不得将其在本合同项下的权利、义务转让给任何其他第三方。

第十条 违约责任

10.1 本合同期限内,如出现不可抗力因素,致使本合同无法正常履行时,双方对本合同均不承担责任。遭遇不可抗力一方应在其能力范围内积极采取措施以阻止损失进一步扩大,对其未尽合理努力导致损失进一步扩大的,就该损失扩大部分向对方承担赔偿责任。

10.2 甲方没有按约定向乙方支付担保费的,应按逾期支付部分每日万分之二的标准向乙方支付违约金,但违约金总额不超过逾期款项的3%。

10.3 乙方没有按 6.2 条的约定向基金份额持有人进行偿付的,应按未偿付部分 3%的标准向甲方支付违约金。

10.4 甲方没有按约定向乙方偿付代偿款的,应按逾期支付部分每日万分之二的标准向乙方支付违约金,但违约金总额不超过逾期款项的3%。

10.5 若因一方违约给另一方造成损失且违约金不足以弥补全部损失的,则违约一方应支付相应的赔偿金,同时应承担对方为实现债权付出的合理费用。

10.6 违约方就迟延履行支付违约金后,还应当履行债务并继续履行本合同项下义务。

第十一条 义务和责任的连续性

本合同项下双方义务与责任不因任何一方与其它单位签订任何协议、合同、文件的无效等情形而免除；不因任何一方发生变更法人名称、法定代表人、承办人等情形而免除。本合同双方当事人如发生合并、分立等变更情形时，发生变更的一方应确保由变更后的当事人承担或分别承担本合同项下的义务与责任。

第十二条 通知送达

12.1 甲乙双方之间的书面通知，可由专人送达、挂号邮递、特快专递、传真等方式传送。

12.2 下列情形视为通知送达：

- (1) 专人递送的通知，在专人递送之交付日为有效送达；
- (2) 以挂号信发出的通知，在寄出(以邮戳为凭)后的第 4 日为有效送达；
- (3) 以特快专递发出的通知，在寄出(以邮戳为凭)后的第 3 日为有效送达；
- (4) 以传真发出的通知，在传真发出时视为送达。

12.3 双方在本合同中填写的住所地即为其有效的通讯地址。

12.4 双方有权在任何时候更改其通讯地址，但应当在发生变更之日起三个工作日内根据本条规定及时向对方送达变更通知。

第十三条 合同的签署、生效、终止、变更和解除

13.1 双方保证代表其签署本合同的为其法定代表人或其合法的授权代表；

13.2 双方保证签署和履行本合同是其真实意思表示，双方已依照各自的公司章程和相关法律法规的规定经过所有必需的同意、批准和

授权（包括但不限于股东会决议或董事会决议）；

13.3 本合同自甲乙双方法定代表人(或授权代理人)签字并加盖公司公章之日起生效；

13.4 本基金保本周期到期日后，甲乙双方全面履行了本合同及《基金合同》规定的义务的，本合同终止。乙方承诺继续对下一保本周期提供担保的，双方另行签署合同；

13.5 本合同生效后，甲、乙双方任何一方不得擅自变更或提前解除本合同，如本合同需要解除时，应经甲、乙双方协商一致，并达成书面协议。但在依据有关法律法规的规定，一方已不具备继续担任本基金管理人或担保人的资质时，另一方有权书面通知另一方解除本合同。甲方依据本条解除本合同后，有权依据《基金合同》的约定重新聘任担保机构。须报请主管部门批准的，合同的解除在批准后生效。

第十四条 合同的补充、修改和解释

14.1 本合同生效后的任何补充或修改均须由各方协商一致并均应以书面形式作出，并构成本合同的组成部分。须报请监管部门批准的，合同的补充或修改在批准后生效；

14.2 本合同的解释应当按照本合同的目的、所使用的词句、有关条款、交易习惯以及诚实信用原则，确定合同条款的真实意思。

第十五条 争议的解决

在履行本合同过程中发生争议时，甲乙双方应通过协商解决；协商不成的，任何一方可提请中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁地点在北京，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的裁决是终局的，对双方均有约束力。在协商或仲裁期间，本合同不涉及争议部分的条款，仍须履行。

第十六条 不放弃权利

乙方除以书面形式表示放弃本合同项下权利外，对全部或部分权利未行使、延迟行使或对甲方降低条件和程序要求的，不视为乙方对权利的放弃。

第十七条 其他

本合同文本一式七份，甲方执五份，乙方执两份。本合同序言和附件是本合同的一部分，与本合同具有同等法律效力。

(本页为签署页, 无正文)

甲方: 长盛基金管理有限公司

(公章)

法定代表人或授权代表:

(签字): _____

乙方: 安徽省信用担保集团有限公司

(公章)

法定代表人或授权代表:

(签字): _____

签署日期: 年 月 日

签署地点:

附件:

履行保证责任通知书

[?]:

长盛基金管理有限公司发行的长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)保本周期已于 年 月 日到期,保本周期到期日本基金的基金份额净值为:人民币[?]元;基金份额持有人认购并持有到期的基金份额总数为 。至保本周期到期日,基金份额持有人认购并持有到期的每一基金份额在持有期内累计分红款项为:人民币[?]元,保本周期内累计分红款项为:人民币[?]元。

根据《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”),本基金未能实现到期保本。保本周期到期日,本基金认购保本差额以及对应的基金份额持有人认购并持有到期的基金份额分别如下:

认购保本差额为:

基金份额持有人认购并持有到期的基金份额总数为:

本基金保本差额总额为人民币[?]元,本公司已经按照《基金合同》的约定调度自有资金向基金持有人支付人民币[?]元,尚需贵公司代偿人民币[?]元(以下简称“代偿款项”)。请贵公司按照《保证合同》的约定,在收到此通知书之日起五个工作日将代偿款项支付至本基金在基金托管人处开立的以下账户中:

户名:[?]

开户行:[?]

帐号:[?]

贵公司将代偿款项支付至该账户后即为全部履行了保证责任。代偿款项的分配与支付由本公司负责,贵公司对此不承担责任。

本通知书中所有数据及计算以基金托管人复核的数据为依据。

长盛基金管理有限公司

[?]年 [?]月[?]日

附件四：《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金保函》

致：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金份额持有人

本保函是安徽信用担保集团有限公司为认购长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）并持有基金份额到本基金保本周期到期日的基金份额持有人的利益而订立，在符合法律、法规及本保函规定之前提下，认购基金份额并持有到期的基金份额持有人可有效地享有本保函的利益。

在《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）中，基金管理人同基金份额持有人约定了持有到期基金份额投资金额损失风险的保本条款（见《基金合同》第十四部分）。为保障基金份额持有人利益，本担保人愿就基金管理人对该条款的履行提供不可撤销的连带责任保证。

除非本保函另有约定，本保函所使用的词语或简称与其在《基金合同》中的释义部分具有相同含义。

一、保证的范围和最高限额

保证范围：按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额的差额部分。

基金份额持有人在保本期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额不在保证范围之内。

乙方承担保证责任的最高限额为人民币 51 亿元。

保本周期到期日是指本基金保本周期（如无特别指明，保本周期即为本基金第一个保本周期）届满的最后一日。本基金的保本周期为 3 年，自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

二、保证期间

保证期间为基金保本周期到期日起六个月。

三、保证的方式

在保证期间，本担保人在保证范围内承担不可撤销的连带保证责任。

四、保证责任的履行

在保本周期到期日，如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额，且基金管理人未按基金合同的约定向基金份额持有人支付该差额的，本担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》（应当载明保本差额总和）后的五个工作日内主动将差额款项足额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户中。担保人将差额款项足额划入本基金在基金托管人处开立的上述账户中后即全部履行了保证责任，无须对基金份额持有人逐一进行清偿，代偿款的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

担保人逾期未主动履行保证责任的，基金份额持有人在保证期间内有权委托基金管理人代表基金份额持有人要求担保人按照本保函的约定履行保证责任。

五、除外责任

下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：

- 1、在保本周期到期日，按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额；
- 2、基金份额持有人认购、但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出本基金的基金份额；
- 3、基金份额持有人在本保本周期内申购的基金份额；
- 4、在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；

6、在保本周期到期日后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

7、发生不可抗力事件，导致本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务；

8、未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

六、适用法律及争议解决方式

本保函适用中华人民共和国法律。发生争议时，各方应通过协商解决；协商不成的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

七、本保函自基金合同生效之日起生效。

担保人：安徽省信用担保集团有限公司（盖章）

法定代表人或委托代理人（签字）：

年 月 日