

# 长城久恒平衡型证券投资基金 招募说明书（更新）

2014年第2号

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一四年十二月

长城久恒平衡型证券投资基金经中国证监会2003年8月25日证监基金字[2003]97号文件“关于同意长城久恒平衡型证券投资基金设立的批复”批准发起设立。基金合同于2003年10月31日正式生效。

## 重要提示

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

（二）投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书；

（三）基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

（四）本招募说明书所载内容截止日为2014年10月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年9月30日（财务数据未经审计）。

（五）本招募说明书与基金托管人相关更新部分已经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核。

## 目录

一、绪言.....	3
二、释义.....	3
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	14
五、相关服务机构.....	17
六、基金的募集与基金合同的生效.....	37
七、基金的申购与赎回.....	38
八、基金的投资管理.....	43
九、基金的业绩.....	49
十、基金的财产.....	49
十一、基金资产估值.....	50
十二、基金的收益分配.....	55
十三、基金的费用与税收.....	55
十四、基金的会计与审计.....	60
十五、基金的信息披露.....	61
十六、风险揭示.....	66
十七、基金的终止与清算.....	67
十八、基金合同的内容摘要.....	69
十九、基金托管协议的内容摘要.....	78
二十、对基金份额持有人的服务.....	83
二十一、其他应披露的事项.....	84
二十二、招募说明书的存放及查阅方式.....	85
二十三、备查文件.....	85

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售管理办法》”）等有关法律法规及《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了长城久恒平衡型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

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

## 二、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指长城久恒平衡型证券投资基金
基金合同或本基金合同：	指《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》及对该基金合同的任何修订和补充，根据最新法律法规，原基金契约均改称为基金合同
招募说明书：	指《长城久恒平衡型证券投资基金招募说明书》
托管协议：	指《长城久恒平衡型证券投资基金托管协议》
发行公告或本发行公告：	指《长城久恒平衡型证券投资基金发行公告》
《基金法》	指2003年10月28日经中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并公布，自2004年6月1日起施行，并经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订的《中华

	《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
《证券法》	指1998年12月29日经中华人民共和国第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订
《信息披露办法》	指2004年6月8日由中国证监会发布并于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
《运作管理办法》	指2014年7月7日由中国证监会发布并于2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《销售管理办法》	指2013年3月15日由中国证监会发布并于同年6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
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
基金管理人：	指长城基金管理有限公司
基金托管人：	指中国建设银行股份有限公司
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括持有人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记人：	指办理基金注册与登记过户业务的机构。本基金的基金注册登记人为长城基金管理有限公司
基金销售机构：	指基金管理人的直销机构及代销机构
直销机构：	指长城基金管理有限公司
代销机构：	指接受长城基金管理有限公司委托代为办理本基金销

	售业务的机构
个人投资者：	指年满18周岁的合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军官证、士兵证、文职证、警官证等有效身份证件的中国公民
机构投资者：	指在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续、依法可投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织以及中国证监会批准的合格境外机构投资者
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》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
基金募集期：	指自招募说明书公告之日起到基金认购截止日的时间段，最长不超过3个月
基金合同生效日：	指本基金达到法定成立条件后，基金管理人宣布基金成立的日期
存续期：	指基金合同生效后的不定期之期限
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所及其他相关证券交易场所的正常交易日
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回或其他业务申请的日期
T日：	指申购、赎回或其他交易的申请日
T+n日：	指T日起（不包括T日）第n个工作日
认购：	指投资者在本基金募集期内购买本基金份额的行为
申购：	指投资者在本基金存续期间提出申请购买本基金份额的行为
赎回：	指基金份额持有人按基金合同规定的条件，要求基金管理人购回本基金份额的行为
基金账户：	指基金注册登记人为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其

## 变动情况的账户

基金交易账户：	指基金销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖基金份额、基金份额变动及资金结余情况的账户
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他合法收入
基金资产总值：	是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收申购款以及其它资产的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸、互联网网站以及其他媒体

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

- 1、名称：长城基金管理有限公司
- 2、注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 3、办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 4、法定代表人：杨光裕
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2001年12月27日
- 7、电话：0755-23982338
- 8、传真：0755-23982328
- 9、联系人：袁江天
- 10、客户服务电话：400-8868-666
- 11、注册资本：壹亿伍仟万元人民币
- 12、股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%

北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

13、管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健股票型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金等二十四只基金。

## （二）主要人员情况

### 1、董事、监事及高管人员介绍

#### （1）董事

杨光裕先生，董事长，硕士。曾任江西省审计厅办公室主任，长城证券有限责任公司副总裁。

熊科金先生，董事、总经理，硕士。曾任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。

何伟先生，董事，硕士。现任长城证券有限责任公司总裁、党委副书记。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。

范小新先生，董事，博士，高级经济师。现任长城证券有限责任公司副总经理、董事会秘书、党委委员、纪委书记。曾任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。



杨玉成先生，董事，硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，东方金融控股（香港）有限公司董事长，上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师，君安证券有限公司证券投资部总经理助理，上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，东方证券股份有限公司财务总监、副总经理，申能集团财务有限公司董事、总经理。

姬宏俊先生，董事，硕士。现任中原信托有限公司副总裁。曾任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。

金树良先生，董事，硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

王连洲先生，独立董事，现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行总行印制管理局工作，1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。

谢志华先生，独立董事，博士。现任北京工商大学副校长。曾任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院（现北京工商大学）副院长、北京工商大学校长助理。

刘杉先生，独立董事，博士。现任中华工商时报社副总编辑，兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报社财经新闻部主任，中国人民银行深圳分行金融早报社总编辑，中华工商时报社总编辑助理。

鄢维民先生，独立董事，学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任，深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长，深圳市证券管理办公室公司审查处处长，招银证券公司副总经理。

## （2）监事

吴礼信先生，监事会主席，会计师、中国注册会计师（非执业）。现任长城证券有限责任公司财务总监。曾任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券有限责任公司，任财务部总经理。

曾广炜先生，监事，高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制

部总经理。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司，2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。

张令先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理。

黄魁粉女士，监事，硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002年7月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

袁江天先生，监事，博士。现任长城基金管理有限公司董事会秘书兼综合管理部总经理。曾任职于广西国际信托投资公司投资管理部、国海（广西）证券有限责任公司投资银行部、证券营业部、总裁办、北方国际信托投资股份有限公司博士后工作站。

王燕女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作，2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

### （3）高级管理人员

杨光裕先生，董事长，简历同上。

熊科金先生，董事、总经理，简历同上。

彭洪波先生，副总经理、运行保障部总经理，硕士。曾就职于长城证券有限责任公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理。

桑煜先生，副总经理、市场开发部总经理，学士。曾任职于中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理、综合管理部总经理、公司总经理助理。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理，硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券有限责任公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司工作，历任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理、“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理。

车君女士，督察长、监察稽核部总经理，硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。

## 2、本基金基金经理简历

吴文庆，上海交通大学生物医学工程连读博士。具有5年证券从业经历。2010年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城品牌优选股票型证券投资基金”基金经理助理，现任“长城双动力股票型证券投资基金”、“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理。

“长城久恒平衡型证券投资基金”历任基金经理如下：2003年11月1日—2005年3月26日，杨军任基金经理；2005年3月27日—2006年2月25日，韩刚任基金经理；2006年2月26日至2007年4月11日，杨毅平任基金经理；2007年4月12日至2007年11月12日，阮涛任基金经理；2007年11月13日至2010年2月23日，李硕任基金经理；2010年2月24日至2011年12月9日，阮涛任基金经理；2011年10月19日至2014年3月11日，王文祥任基金经理。

## 3、本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。

杨建华先生，投资决策委员会执行委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理。

钟光正先生，投资决策委员会委员，公司固定收益部副总经理、基金经理。

徐九龙先生，投资决策委员会委员，基金经理。

## 4、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者聘请经中国证监会认定的中介机构办理与基金份额的发售、申购、赎回和登记有关的事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金资产分别管理、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、编制中期和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金资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、保存基金资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、法规和中国证监会规定的其他职责。

#### **（四）基金管理人承诺**

- 1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国基金法》行为的发生；
- 3、基金管理人承诺严格遵守《基金合同》，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金合同》行为的发生；
- 4、基金管理人承诺不从事其他证券法规规定禁止从事的行为。

#### **（五）、基金经理承诺**

- 1、依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- 2、不得利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何第三者谋取不当利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### **（六）基金管理人的内部控制制度**

健全、完善的内部风险控制制度是规范公司行为，有效防范经营风险，实现公司持续、稳健发展的主要保证，也是公司经营管理水平的重要标志。为此，公司建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度。

##### **1、风险控制的目标**

公司风险控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理实体。具体目标是：

- （1）确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行；
- （2）建立符合现代企业制度要求的法人治理结构，形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制；
- （3）不断提高基金管理的效率和效益，在有效控制风险的前提下，努力实现基金份额持有人利益最大化；
- （4）努力将各种风险控制在规定的范围内，保障公司发展战略和经营目标的全面实施，

维护公司股东的合法权益；

（5）建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

## 2、建立风险控制制度的原则

公司按照合法、合规、稳健的要求，制定明确的经营方针，建立合理的经营机制。在建立风险控制制度时应严格遵循以下原则：

（1）全面性原则：风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节；

（2）审慎性原则：内部风险控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（3）独立性原则：公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行部门；风险控制与审计委员会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查；

（4）有效性原则：风险控制制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行风险控制制度不能存在任何例外，公司任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力；

（5）适时性原则：内部风险控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善；

（6）防火墙原则：公司基金投资、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序。

## 3、风险控制的主要内容

（1）确立加强内部风险控制的指导思想，确定风险控制的目标和原则；

（2）建立层次分明、权责明确的风险控制体系；

（3）建立公司风险控制程序；

（4）对公司内部风险进行全面、系统的评估，制定风险控制计划；

（5）确定公司风险控制的路径和措施；

（6）保障风险控制制度的持续性和有效性，制定可行的风险控制制度的评价和检查机制。

## 4、风险控制体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构，并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系：

（1）一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险控制与审计委员会，负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。对公司内部控制制度的有效性进行评价，对公司经营管理和基金业务运作的合法合规性进行监督检查，协助董事会建立并有效维持公司内部控制系统，对公司经营中的风险进行研究、分析和评估，并提出风险防范措施和建议，保证公司的规范健康发展。风险控制与审计委员会的基本职能为：

①协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。

②审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。

③检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况，并出具评估意见或改正方案；

④定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报；

⑤检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见；

⑥评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险，检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性，并提出改进意见；

⑦检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序，与外部审计机构进行交流；

⑧对公司内部控制和风险管理工作进行考核；

⑨董事会安排的其他事项。

公司设督察长。督察长作为风险控制与审计委员会的执行机构，对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制与审计委员会的授权进行工作。

## （2）二级风险防范

二级风险防范是指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。

投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产的投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。

其在风险控制中主要职责为：

①研究并确立公司的基金投资理念和投资方向；

②决定基金资产在现金、债券和股票中的分配比例；

③审核基金经理提出的投资组合方案，对其运作过程中的风险进行评估和控制；

④批准基金经理拟订的投资原则，对基金经理做出投资授权；

⑤对超出投资决策委员会执行委员及基金经理权限的投资项目作出决定。

监察稽核部在总经理的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、

各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。其在风险控制中主要职责是：

①根据各项风险的产生环节，和相关的业务部门一起，共同制定对风险的事前防范和事后审查方案；

②就各部门内部风险控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告及建议职能；

③调查公司内部的违规案件，协助监管机构处理相关事宜；

④对基金运作和公司内部管理进行日常监督与稽核，并向总经理汇报。

### （3）三级风险防范

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：

①一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；

②相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各部门和岗位分别在自己的授权范围内承担各自的职责，将风险控制在最小范围内。

## 5、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部风险控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010) 67595096

中国建设银行拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

2014 年上半年，本集团实现利润总额 1,695.16 亿元，较上年同期增长 9.23%；净利润 1,309.70 亿元，较上年同期增长 9.17%。营业收入 2,870.97 亿元，较上年同期增长 14.20%；其中，利息净收入增长 12.59%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入增长 8.39%，在营业收入中的占比达 20.96%。成本收入比 24.17%，同比下降 0.45 个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为 13.89%和 11.21%，同业领先。

截至 2014 年 6 月末，本集团资产总额 163,997.90 亿元，较上年末增长 6.75%，其中，客户贷款和垫款总额 91,906.01 亿元，增长 6.99%；负债总额 152,527.78 亿元，较上年末增长 6.75%，其中，客户存款总额 129,569.56 亿元，增长 6.00%。

截至 2014 年 6 月末，中国建设银行公司机构客户 326.89 万户，较上年末增加 20.35 万户，增长 6.64%；个人客户近 3 亿户，较上年末增加 921 万户，增长 3.17%；网上银行客户 1.67 亿户，较上年末增长 9.23%，手机银行客户数 1.31 亿户，增长 12.56%。

截至 2014 年 6 月末，中国建设银行境内营业机构总量 14,707 个，服务覆盖面进一步扩大；自助设备 72,128 台，较上年末增加 3,115 台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 86.55%，较上年末提高 1.15 个百分点。

2014 年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的 40 余个重要奖项。在英国《银行家》杂志 2014 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额位列全球第 2，较上年上升 3 位；在美国《福布斯》杂志 2014 年全球上市公司 2000 强排名中位列第 2；在美国《财富》杂志世界 500 强排名第 38 位，较上年上升 12 位。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 240 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。



## 2、主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末，中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

### （二）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、直销机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

法定代表人：杨光裕

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

## 2、代销机构

### （1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66275654

客户服务电话：95533

网站：www.ccb.com

### （2）中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

联系人：王隽

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

### （3）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号

法定代表人：蒋超良

电话：010-85108223

传真：010-85109219

联系人：逢慧

客户服务电话：95599

网站：www.abchina.com

（4）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号中国银行总行办公大楼

法定代表人：田国立

联系人：宋亚平

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网站：www.cmbchina.com

（6）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（7）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

电话：021-62677777

传真：021-62569070

联系人：陈晓瑾

客户服务电话：95561

网站：www.cib.com.cn

（8）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：010-68098778

传真：010-68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

网站：www.cebbank.com

（9）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

联系人：姜驰

电话：010-85237356

传真：010-85238680

网址：www.hxb.com.cn

（10）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫竹冰

联系人：谢小华

电话：010-66223587

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站：www.bankofbeijing.com.cn

（11） 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

联系人：丰靖

电话：010-65550827

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

网站：<http://bank.ecitic.com/>

（12） 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

电话：010-58351666

传真：010-83914283

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

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

（13） 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：徐伟

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

客户服务电话：95528

（14） 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：芮蕊

电话：0755-25879756

传真：0755-25879196

网址：<http://bank.pingan.com/>

客户服务电话：95511-3

（15）深圳农村商业银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区3038号合作金融大厦

办公地址：深圳市罗湖区3038号合作金融大厦

法定代表人：李伟

联系人：宋永成

联系电话：0755-25188266

客服电话：4001961200

公司网站：[www.961200.net](http://www.961200.net)

（16）东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路2号

办公地址：东莞市南城路2号

法定代表人：何沛良

联系人：何茂才

电话：0769-23394102

传真：0769-22320896

客服电话：0769-961122

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

（17）包商银行股份有限公司

注册（办公）地址：内蒙古包头市钢铁大街6号

法定代表人：李镇西

联系人：张晶、刘芳

联系电话：（0472）5109729

传真：（0472）5176541

客服电话：内蒙古地区：0472-96016；北京地区：010-96016；宁波地区：0574-967210；

深圳地区：0755-967210；成都地区：028-65558555

公司网站：www.bsb.com.cn

（18）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

客户服务电话：4008888108

网站：www.csc108.com

（19）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：021-53594566

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

（20）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

办公地址：上海市延平路135号

法定代表人：万建华

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400



客户服务电话：4008888666

网站：www.gtja.com

（21）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：汪建熙

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网站：www.sywg.com

（22）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-38565785

联系人：谢高得

客户服务热线：95562

网站：www.xyzq.com.cn

（23）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：www.cgws.com

（24）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568047

客户服务电话：4008-888-8888

网站：www.chinastock.com.cn

（25）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82960223

传真：0755-82943237

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

（26）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

客户服务电话：4008816168

网站：www.pingan.com

（27）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：王宜四

联系人：戴蕾

电话：0791-86868681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网站：www.avicsec.com

（28）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街239号

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼（深圳总部）

法定代表人：张慎修

联系人：杨玲

电话：0755-83025430

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

（29）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼21层—29层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63327888

客户服务热线：95503

网站：www.dfzq.com.cn

（30）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（31）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦

法定代表人：曾小普

联系电话：0791-86281305

联系人：陈明

客户服务电话：4008222111

网站：www.gsstock.com

（32）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

法人代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网站：www.guosen.com.cn

（33）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

联系电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

网站：www.bhzq.com

（34）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303

网站：www.gzs.com.cn

（35）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：www.csc.com.cn

（36）齐鲁证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

（37）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

公司网址：www.essence.com.cn

客服热线：4008001001

（38）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

客服电话：400888788、10108998

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

（39）东海证券有限责任公司

注册地址：常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址：上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

联系人：邵一明

客服电话：0519-8166222、0379-64912266

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

（40）恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：张同亮

客服电话：0471-4961259

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

（41）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-83290845

联系人：肖亦玲

客户服务电话：95597

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

（42）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（43）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2257012

传真：0551-2272100

联系人：祝丽萍

客户服务电话：全国统一热线4008888777，安徽省内热线96888

网址：www.gyzq.com.cn

（44）中国中投证券有限责任公司

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

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008、95532

网址：www.china-invs.cn

（45）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层

地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

客服热线：029-87419999

联系人：崔轶梅

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

（46）长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：4008-888-999或95579

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

（47）日信证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路18号

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈韦杉、朱晓光

联系电话：010-88086830-730、010-88086830-737

传真：010-66412537

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

（48）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号27层

法定代表人：陈林

联系人：袁月

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

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

（49）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

客户服务电话：95548

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



（50）民生证券有限责任公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：余政

电话：010-85127622

传真：010-85127917

联系人：赵明

客户服务电话：4006198888

网址：www.msizq.com

（51）天源证券经纪有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦6楼

法定代表人：林小明

联系人：王斌

联系电话：0755-33331188-8801

客服电话：4006543218

公司网站：www.tyzq.com.cn

（52）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市西城区金融大街8号A座3层

法定代表人：丁之锁

联系人：梁宇

联系电话：010-58568007

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118

公司网站：www.hrsec.com.cn

（53）国海证券股份有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦

电话：0755-83702462

传真：0755-83700205

法定代表人：张雅锋

联系人：张亦潇

客服电话：95563

公司网站：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

（54）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

传真：0571-86065161

客户服务电话：95548

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

（55）民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：赵明

客户服务热线：40088-95618

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

（56）大同证券经纪有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号世贸中心 A 座 13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务热线：400-7121-212

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

（57）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客服电话：400-8888-993

公司网站：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

（58）信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（59）广发证券股份有限公司

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

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

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

（60）西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

公司网站：www.swsc.com.cn

（61）深圳众禄基金销售有限公司

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25层

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

（62）杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周嫵旻

联系电话：0571-28829790

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

（63）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

联系电话：021-38509636

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

（64）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

联系电话：020-87599121

客服电话：400-1818-188

公司网站：www.1234567.com.cn

（65）万银财富股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院盘古大观 A 座 3201

法定代表人：李招弟

联系人：刘媛

联系电话：010-59393923

客服电话：400-808-0069

公司网站：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

（66）北京展恒基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：焦琳

联系电话：010-85189120

客服电话：400-888-6661

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

（67）北京增财基金销售有限公司

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：王昌庆

联系人：孙晋峰

联系电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网站：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

（68）和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：吴阿婷

联系电话：0755-82721106

客服电话：400-9200-022

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

（69）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

联系人：金侃

联系电话：021-58870011-6706

客服电话：400-700-9665

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

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。

**（二）基金注册登记人**

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

法定代表人：杨光裕

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍

客户服务电话：400-8868-666

**（三）律师事务所与经办律师**

律师事务所名称：北京市中伦律师事务所

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街甲6号SK大厦36-37层

负责人：张学兵

电话：0755-23993388

传真：0755-86186205

联系人：李雅婷

**（四）会计师事务所和经办注册会计师**

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所（办公地址）：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：李妍明

**六、基金的募集与基金合同的生效****（一）基金的募集**

本基金经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]97号《关于同意长城久恒平衡型证券投资基金设立的批复》核准（核准日期2003年8月25日），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募集，募集期从2003年9月1日起到10月30日止，共募集1,284,133,805.81份基金份额，募集户数为32,675户。

**（二）基金合同的生效**

本基金的基金合同已于2003年10月31日正式生效。

### （三）基金类型

契约型开放式。

### （四）基金的存续期间

不定期。

### （五）销售对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规和其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）。

## 七、基金的申购与赎回

### （一）基金投资者范围

合格的个人投资者和机构投资者（法律、法规和其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）。

### （二）申购与赎回场所

- 1、本基金管理人直销网点及网站；
- 2、受本基金管理人委托、具有销售本基金资格的代销机构的营业网点；
- 3、有网上交易功能的代售机构的网站。

上述直销和代销机构的名称、联系方式等请参见本招募说明书“五、相关服务机构（一）基金份额发售机构”。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并另行公告。

### （三）申购和赎回办理的时间

#### 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。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于2003年12月15日开放申购业务，于2004年1月13日开放赎回业务。

开放日的具体业务办理时间即开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间，具体为上午9：30-11：30和下午1：00-3：00。

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、开放时间及相关业务办理时间进行相应的调整并公告。

#### （四）申购和赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日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、申购费用按单笔申购申请金额对应的费率计算；
- 4、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
- 5、基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### （五）申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的手续，向基金销售机构提出申购或赎回的申请。其中在直销网点，投资者可以通过传真方式提交申购或赎回的申请。投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以收到申购或赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在收到申请后的1个工作日内（T+1日）对该交易的有效性进行确认。投资者可在2个工作日之后（T+2日，包括该日）向基金销售机构查询申购与赎回的成交情况。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。投资者赎回申请成功后，基金管理人应在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过5个工作日（T+5）的时间内，支付赎回款项。

在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照本基金合同的有关条款处理。

#### （六）申购和赎回的数额和价格

1、投资者在代销机构的指定营业网点每次申购最低金额为1,000元（含申购费），在直销网点的首次申购最低金额为10万元（含申购费），追加申购最低金额为1,000元（含申购费）。不设申购金额级差；

2、本基金每次赎回最低份额为100份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回；

3、基金管理人可根据市场情况，调整首次申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须于调整前的3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案；



4、申购份额余额的处理方式：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，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；

5、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；

6、申购份额、赎回金额的计算公式见本招募说明书第十三章基金的费用与税收；

7、基金份额净值计算公式

$$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日收市后的该基金资产净值} / T \text{ 日该基金份额的余额数量}$$

本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。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）申购和赎回的注册登记

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

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

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

### （八）巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（有效赎回申请总数扣除有效申购申请总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

（1）巨额赎回发生时，本公司可选择下面两种方式进行处理：

1) 全额赎回：当本公司认为有能力兑付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当本公司认为兑付投资者的赎回申请可能导致基金份额持有人的利益受损或无法实现时，本公司在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入第二个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回支付金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

（2）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应立即上报中国证监会

备案并在三个工作日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并说明有关处理方法。

(3) 本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### **(九) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式**

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

(1) 本公司认为基金资产规模过大，市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有的基金份额持有人利益产生损害；

(2) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或基金注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；

(3) 由于不可抗力而导致基金无法正常运行；

(4) 证券交易所交易时间非正常停市；

(5) 本公司认为会有损于现有基金份额持有人利益的其他申购；

(6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资者的赎回申请：

(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常运行；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可兑付部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未兑付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回支付金额。同时在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间20个工作日，并在指定媒体上公告。投资者在申请赎回时可选择将当日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。

3、发生基金合同、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内至少在一种指定媒体上刊登暂停公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

2、暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应予以公告。如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前三个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

5、本基金 2007 年 1 月 12 日刊登《关于暂停长城久恒平衡型证券投资基金申购及转入业务的公告》、2007 年 1 月 13 日刊登《长城久恒平衡型证券投资基金分红预告与暂停申购及转入业务的公告》，自 2007 年 1 月 12 日起暂停本基金的申购及转入业务，2007 年 1 月 17 日起恢复本基金的正常申购及转入业务。2007 年 1 月 19 日刊登《长城久恒平衡型证券投资基金分红及暂停申购与转入业务的公告》，自 2007 年 1 月 19 日起暂停本基金的申购及转入业务，2007 年 1 月 22 日起恢复本基金的正常申购及转入业务。

### （十一）基金的转换

基金转换是指基金份额持有人可按规定申请将所持有的本基金份额转换为本基金管理人管理并在同一注册登记人登记的其它开放式基金份额。

基金管理人已开通本基金与长城消费增值股票型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城医疗保健股票型证券投资基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金之间的基金转换业务。

### （十二）基金的非交易过户与转托管

#### 1、非交易过户

基金注册登记人受理继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。其中继承是指

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；捐赠仅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、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理，并按基金注册登记人规定的标准收取过户费用。

## 2、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，转入到直销机构需符合有关最低金额的规定。投资者在进行转托管时，可以将一个销售机构的基金份额全部或部分转出。办理转托管业务的基金份额持有人需在原销售机构办理转托管转出手续，然后在拟转托管转入的销售机构办理转托管转入手续，基金份额将在注册登记确认后自动转入持有人指定的销售机构。转托管业务收取一定的固定手续费。

## 八、基金的投资管理

### （一）投资目标

本着安全性、流动性原则，控制投资风险，谋求基金资产长期稳定增长。

### （二）投资对象

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

### （三）投资理念

锁定投资风险，追求长期增长。

### （四）投资策略

本基金以资产配置作为控制风险、获得超额收益的核心手段，通过资产的动态配置、股票资产的风格调整以及证券选择三个层次进行投资管理。

**资产配置策略：**根据基金的风险约束条件，运用均值方差理论，得到基金资产的基准配置比例，在此基础上结合当期市场状况采用合适的战术资产调整策略。

**风格调整策略：**按照中信风格指数的构成方式划分风格资产、确定各风格资产的基础投资比例，并根据风格资产收益率的向量自回归模型进行动态调整。

**证券选择策略：**在各个风格资产内的适度分散化策略。

**选股标准：**在各个风格资产内部分别选择同时满足以下条件的上市公司构成风格资产股票库：

- 1、非ST类上市公司；

- 2、经营活动产生的现金流量净额为正的上市公司；
- 3、主营业务利润贡献率排名居前四分之三的上市公司。

对于范围以外的股票，本基金将根据上市公司基本面结合二级市场走势，有选择地纳入研究范围，但该部分投资不会作为基金投资的重点。

#### （五）业绩比较基准

本基金选取的比较基准是70%×中信综指+30%×中信国债指数。

#### （六）组织架构和投资决策程序

本基金管理人内部设立基金管理部、研究部、集中交易室、监察稽核部、投资决策委员会和风险控制与审计委员会，进行基金资产的投资和风险控制。基金管理实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策程序如下：

1、公司研究部策略研究员及行业研究员定期对宏观经济、市场、行业、投资品种和投资策略等提出分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供投资决策依据。

2、公司研究部行业研究员负责建立和维护公司股票库体系，在公司股票库的基础上，研究部研究员与本基金管理小组研究建立符合本基金合同规定和投资需求的股票投资备选库。

3、本基金管理小组在基金经理的领导下，在对经济形势和市场运作态势进行讨论分析后，拟定下一阶段基金投资持仓比例，明确股票、债券、现金和融资比例，做出《资产配置提案》和重点个股投资方案，报投资决策委员会讨论。

4、投资决策委员会在基金经理上报的资产配置提案的基础上，进行讨论并确定下一阶段的资产配置和重点个股投资决定，会议决定以书面形式下达给基金经理。

5、根据投资决策委员会确定的资产配置决议和重点个股投资决定，基金经理负责在基金股票投资备选库中选择拟投资的个股制定投资组合方案。

6、在基金经理权限内的投资，由基金经理自主实施；超过基金经理权限的，根据规定须报经投资决策委员会执行委员或投资决策委员会批准的，须经报批后实施。

7、公司研究部负责开发基金投资组合的分析评价体系及其他辅助分析统计工具，对本基金投资组合进行定期跟踪分析，为基金经理和投资决策委员会提供决策支持。

#### （七）投资组合

1、本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的25%；

2、本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%；

3、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；

4、本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

5、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

#### （八）投资限制

- 1、本基金不得投资于其他基金；
- 2、本基金不得将基金资产用于抵押、担保；
- 3、本基金不得从事证券信用交易；
- 4、本基金不得进行房地产投资；
- 5、本基金不得从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 6、本基金不得将资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
- 7、本基金不得从事法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

#### （九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则

- 1、不谋求对所投资企业的控股或者进行直接管理；
- 2、所有参与行为均应在合法合规和维护基金投资者利益的前提下进行，并谋求基金资产的保值和增值。

#### （十）投资组合报告

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

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年11月21日复核了本基金招募说明书更新中的投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2014年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	35,700,209.34	8.51
	其中：股票	35,700,209.34	8.51
2	固定收益投资	349,281,462.50	83.29
	其中：债券	349,281,462.50	83.29
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	22,356,366.71	5.33

7	其他资产	12,028,250.28	2.87
8	合计	419,366,288.83	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	32,318,647.95	7.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	116,413.89	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,265,147.50	0.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,700,209.34	8.54

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300066	三川股份	529,960	7,509,533.20	1.80
2	300124	汇川技术	232,170	6,985,995.30	1.67
3	600887	伊利股份	153,847	3,984,637.30	0.95
4	300145	南方泵业	165,960	3,480,181.20	0.83
5	600062	华润双鹤	180,000	3,421,800.00	0.82
6	300386	飞天诚信	25,609	3,265,147.50	0.78
7	600594	益佰制药	80,000	3,000,000.00	0.72

8	600499	科达洁能	100,000	1,911,000.00	0.46
9	002470	金正大	70,000	1,741,600.00	0.42
10	603010	万盛股份	10,589	123,891.30	0.03

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,036,000.00	0.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,767,200.00	57.60
	其中：政策性金融债	240,767,200.00	57.60
4	企业债券	106,478,262.50	25.47
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	349,281,462.50	83.56

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018001	国开1301	2,032,280	208,003,858.00	49.76
2	018002	国开1302	309,380	32,763,342.00	7.84
3	122289	13日照港	286,000	29,254,940.00	7.00
4	126018	08江铜债	249,350	23,144,667.00	5.54
5	111056	09湖交投	150,000	14,985,000.00	3.58

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细



注：本基金本报告期末未投资股指期货，本期末未持有股指期货。

## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

### 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 11、投资组合报告附注

**11.1** 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

**11.2** 基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	68,945.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,904,613.75
5	应收申购款	29,485.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,206.04
8	其他	-
9	合计	12,028,250.28

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300066	三川股份	7,509,533.20	1.80	重大事项停牌
2	300386	飞天诚信	3,265,147.50	0.78	新股锁定
3	603010	万盛股份	123,891.30	0.03	新股中签

## 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 九、基金的业绩

过往一定阶段长城久恒净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较  
(截止2014年9月30日)

时间段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率 标准差④	①-③	②-④
2003年度	3.89%	0.48%	4.50%	0.86%	-0.61%	-0.38%
2004年度	-2.69%	0.96%	-12.56%	0.95%	9.87%	0.01%
2005年度	5.03%	0.99%	-4.16%	0.99%	9.19%	0.00%
2006年度	115.54%	1.11%	70.68%	0.99%	44.86%	0.12%
2007年度	76.88%	1.61%	102.06%	1.60%	-25.18%	0.01%
2008年度	-34.96%	1.46%	-47.68%	2.12%	12.72%	-0.66%
2009年度	37.83%	1.15%	68.32%	1.42%	-30.49%	-0.27%
2010年度	-6.25%	1.05%	-1.01%	1.10%	-5.24%	-0.05%
2011年度	-20.29%	0.94%	-19.28%	0.94%	-1.01%	0.00%
2012年度	10.73%	0.87%	5.27%	0.93%	5.46%	-0.06%
2013年度	20.31%	1.00%	2.68%	0.94%	17.63%	0.06%
2014年1月1日至 2014年9月30日	1.08%	0.70%	14.13%	0.70%	-13.05%	0.00%
基金合同生效日 至2014年9月30日	265.13%	1.11%	162.08%	1.23%	103.05%	-0.12%

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

### 十、基金的财产

#### (一) 基金财产的构成

是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收申购款以及其它资产的价值总和。

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

## （二）基金财产的账户

本基金以托管人和基金联名的方式开设证券账户、以基金名义开设的银行账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记人自有的资产账户以及其它基金资产账户相独立。

## （三）基金财产的保管及处分

1、本基金基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

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

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

4、非因本基金财产本身承担的债务，不得对本基金财产强制执行。

## 十一、基金资产估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法：

(1) 上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### (2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

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市价估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

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

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

(1) 证券交易所市场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，按最近交易日的收盘价估值；

(2) 证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘净价估值；

(3) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术或按成本确定公允价值；

(4) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

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

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

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

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值方法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值；

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

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、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。

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

#### **(五) 估值程序**

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，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，小数点后第四位四舍五入。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。基金管理人每个开放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。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### **(六) 暂停估值的情形**

1、基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时。  
2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。  
3、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的。

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### **(七) 基金份额净值估值错误的确认及处理方式**

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。基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后三位。当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### **1、差错类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或代销机构、

或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

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

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 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) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (八) 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并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

### (九) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(2)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

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

## 十二、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券已实现价差、银行存款利息以及其他合法收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

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

### （三）收益分配原则

- 1、每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 3、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 4、基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；
- 5、在符合有关分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，成立不满3个月，收益可以不分配，年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成；
- 6、投资者可以选择现金分红方式或红利再投资方式，默认方式为现金分红方式，投资者分红方式的变更须在分红权益登记日前向销售机构提出申请；
- 7、红利分配时所发生的银行转账或其他注册登记费用由投资者自行承担。基金管理人若收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定；
- 8、法律法规以及中国证监会的其他规定。

### （四）收益分配方案

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

### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，经基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后5个工作日内公告。

## 十三、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

- 1、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）证券交易费用；



- (4) 基金法定信息披露费用；
- (5) 基金持有人大会费用；
- (6) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

## 2、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

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下：

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

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的2.5%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 上述（一）中（3）至（7）项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

## 3、不列入基金费用的项目

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

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购费

申购费用由基金申购人承担，归基金管理人及代销机构所有，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

## (1) 前端申购费

申购金额（元）	前端申购费率
$1,000 \leq M < 100$ 万	1.2%
$100$ 万 $\leq M < 500$ 万元	0.9%
$500$ 万 $\leq M < 1000$ 万元	0.3%
$1000$ 万元 $\leq M$	每笔收取固定费用1000元

申购份额的计算方式：

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)，对于1000万元（含）以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份数 = 净申购金额 / T日基金份额净值

例：某投资者投资5,000元申购本基金，对应费率为1.2%，假设申购当日基金份额净值为1.066元，则其可得到的申购份额数为：

净申购金额 =  $5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71$

申购费用 =  $5,000 - 4,940.71 = 59.29$

申购份数 =  $4,940.71 / 1.066 = 4,634.81$

即：投资者投资5,000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.066元，则可得到4,634.81份基金份额。

例：某投资者投资100万元申购本基金，对应费率为0.9%，假设申购当日基金份额净值仍为1.066元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $1,000,000 / (1 + 0.9\%) = 991,080.28$

申购费用 =  $1,000,000 - 991,080.28 = 8,919.72$

申购份数 =  $991,080.28 / 1.066 = 929,718.84$

即：投资者投资100万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值也是1.066元，则可得到929,718.84份基金份额。

## (2) 后端申购费

持有基金时间	后端申购费率
1年以内	1.5%
满1年不满2年	1.2%
满2年不满3年	0.9%
满3年不满4年	0.6%
满4年不满5年	0.3%

满5年后	0
------	---

注： 以上的持有基金的起始时间为投资者申购确认之日。

后端申购费的计算基数为本次要赎回的基金份额在当初购买时所需的申购金额，计算方法为：当初购买本次赎回份额的申购资金总额－申购资金总额/（1+后端申购费率）。

举例说明，某投资人提出申购请求，申购金额为10000元，当日基金份额净值为1.100元，3年后申请赎回，基金份额净值为1.800元。则在前端收费和后端收费模式下，计算结果如下（本例中数据皆为假设，并不作为判断基金可能收益的依据）：

	前端收费	后端收费
申购金额（A）	10000.00	10000.00
申购份额（ $B=A/(1+前端申购费率^*)/1.1$ ）	8983.11	9090.91
总赎回金额（ $C=B\times 1.8$ ）	16169.60	16363.64
申购费率（D）	1.2%	0.6%
申购费用（ $E=A-A/(1+D)$ ）	118.58	59.64
赎回费用（ $F=C\times 0.5\%$ ）	80.85	81.82
净赎回金额 （前端： $G=C-F$ ，后端： $G=C-E-F$ ）	16088.75	16222.18

注\*：采取后端收费时，前端申购费率为0。

## 2、赎回费

（1）赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费用由基金赎回人承担。自2004年7月1日起将赎回费用中归入基金资产部分的比例提高到赎回费用总额的25%，其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

### （2）基金赎回支付金额的计算

本基金的赎回支付金额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回金额 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额

赎回费用 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额×赎回费率

赎回支付金额 = 赎回金额 - 赎回费

例：某投资者赎回本基金1万份基金份额，赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.066元，则可得到的赎回支付金额为：

赎回金额 =  $1.066 \times 10,000 = 10,660$

赎回费用 =  $1.066 \times 10,000 \times 0.5\% = 53.30$ 元

赎回支付金额 =  $10660 - 53.30 = 10,606.70$ 元

即：投资者赎回本基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.066 元，则其可得到的赎回支付金额为 10,606.70 元。

### 3、转换费用

(1) 基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

#### ①如转入基金的申购费率>转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额=转出金额-转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率-转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差

转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差

例：某投资者持有长城货币市场证券投资基金 10 万份基金份额，持有期为 100 天，决定转换为本基金，假设转换当日转入基金（本基金）份额净值是 1.250 元，转出基金（长城货币市场证券投资基金）对应赎回费率为 0，申购补差费率为 1.2%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1=100,000 元

转出基金赎回费=0

转入总金额=100,000-0=100,000 元

转入基金申购费补差=100,000-100,000/(1+1.2%)=1,185.77 元

转入净金额=100,000-1,185.77=98,814.23 元

转入份额=98,814.23/1.25=79,051.38 份

基金转换费=0+1,185.77=1,185.77 元

#### ②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

基金转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

例：某投资者持有本基金 10 万份基金份额，持有期为 100 天，决定转换为长城货币市场证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金）份额净值是 1.250 元，转出基金对应赎回费率

为 0.5%，申购补差费率为 0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

$$\text{转出金额} = 100,000 \times 1.25 = 125,000 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金赎回费} = 125,000 \times 0.5\% = 625 \text{ 元}$$

$$\text{转入总金额} = 125,000 - 625 = 124,375 \text{ 元}$$

$$\text{转入基金申购费补差} = 0$$

$$\text{转入净金额} = 124,375 - 0 = 124,375 \text{ 元}$$

$$\text{转入份额} = 124,375 / 1 = 124,375 \text{ 份}$$

$$\text{基金转换费} = 125,000 \times 0.5\% = 625 \text{ 元}$$

(2) 对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金)，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为 0。

(3) 转出基金赎回费的 25% 计入转出基金资产。

(4) 计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下，调整上述收费方式和费率水平，但最迟应于新收费办法开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

### （三）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

确认。

## （二）基金审计

1、本基金管理人聘请具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，并由基金管理人报中国证监会备案。

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，更换后报中国证监会备案。更换会计师事务所应在5个工作日内公告。

## 十五、基金的信息披露

### （一）总则

本基金管理人、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基金信息披露义务人，按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及中国证监会和基金合同的有关规定披露本基金信息，并保证公开披露信息的内容真实、准确、完整，并就其保证承担连带责任。

公开披露基金信息涉及财务会计、法律等事项的，应当根据有关规定由具有从事证券业务资格的会计师事务所、律师事务所等专业机构审查验证，并出具书面意见。相关专业机构及其人员保证其所出具文件的内容真实、准确、完整，并就其保证承担连带责任。

一个基金会计年度内的信息披露事项必须固定在至少一种中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站上公告。

基金信息披露义务人应当确保披露信息在规定时间内发出，并保证投资人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。

### （二）本基金的信息披露内容

- 1、基金招募说明书；
- 2、基金合同；
- 3、基金托管协议；
- 4、基金份额发售公告；
- 5、基金募集情况；
- 6、基金合同生效公告；
- 7、基金份额上市交易公告书；
- 8、基金资产净值、基金份额净值；

- 9、基金份额申购、赎回价格；
- 10、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；
- 11、临时报告；
- 12、基金份额持有人大会决议；
- 13、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动；
- 14、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 15、澄清公告；
- 16、中国证监会规定的其他信息。

### （三）基金招募说明书

基金募集前，基金发起人根据《证券投资基金法》及其他有关规定编制招募说明书，并向社会公开披露有关信息。

基金发起人编制完成招募说明书后，将经签署的招募说明书及其摘要随其他设立申请文件一并报送中国证监会审核。基金获准设立后，基金管理人应当在基金募集三日前将招募说明书及其摘要刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊和公司网站上，并将招募说明书正文放置在基金管理人所在地、各销售网点，供公众查阅，同时一式二份报送中国证监会备案。

本基金成立后，基金管理人应于每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至少一种中国证监会指定的全国性报刊上。

基金管理人应在公告的15日前将更新的招募说明书报中国证监会审核，并就有关更新内容提供书面说明。

### （四）基金合同

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金募集前，由基金发起人、基金管理人和基金托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关规定签订，并向社会公开披露有关信息。

经签署的基金合同及其摘要随其他设立申请文件一并报送中国证监会审核。基金获准设立后，基金管理人应当在基金份额发售三日前将基金合同摘要刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，基金合同正文及其摘要登载在基金管理人、基金托管人的网站上，并将基金合同正文放置在基金管理人所在地、各销售网点，供公众查阅，同时一式二份报送中国证监会备案。

### （五）基金托管协议

基金托管协议是基金管理人和基金托管人之间为了明确双方权利义务关系而订立的合同。基金募集前，由基金管理人和基金托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关规定签订，并向社会公开披露有关信息。

经签署的基金托管协议随其他设立申请文件一并报送中国证监会审核。基金获准设立后，基金管理人、基金托管人应当在基金份额发售三日前将基金托管协议登载在网站上，并将基金托管协议正文放置在基金管理人所在地、各销售网点，供公众查阅，同时一式二份报送中国证监会备案。

#### （六）基金份额发售公告和基金合同生效公告

基金管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日同时刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊和公司网站上。

基金募集期限届满，并按照《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》的有关规定办理完毕验资和基金备案手续后，基金合同生效。基金管理人应当在基金合同生效的次日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊和公司网站上登载基金合同生效公告。

#### （七）定期公告

本基金定期报告包括年度报告、半年度报告、季度报告、基金净值公告。由基金管理人根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》的规定和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件进行编制并公告，同时报中国证监会备案。

##### 1、年度报告

基金管理人在本基金每个会计年度结束后九十日内编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于基金管理人的国际互联网网站上，将年度报告摘要刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，年度报告正文一式二份报送中国证监会备案。基金年度报告的财务会计报告须经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计并出具审计报告。

##### 2、半年度报告

基金管理人在本基金每个会计年度的前六个月结束后六十日内编制完成半年度报告，并将半年度报告正文登载于基金管理人的国际互联网网站上，将半年度报告摘要刊登在至少一种由中国证监会指定的全国性报刊上，半年度报告正文一式二份报送中国证监会备案。

##### 3、季度报告

基金管理人应当在每个季度结束后十五个工作日内编制完成季度报告，并刊登在基金管理人的国际互联网网站及至少一种由中国证监会指定的全国性报刊上，同时分别报送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。

##### 4、基金净值公告

基金管理人应于本基金每个开放日的次日，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；

基金管理人应于半年度和年度最后一个市场交易日的次日，将最后一个交易日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载于基金管理人国际互联网网站、中国证监会指定的全国性报刊及其他披露媒介上。

#### （八）临时公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两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中国证监会派出机构备案。

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事件，包括但不限于下列情况：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、提前终止基金合同；
- 3、基金扩募；
- 4、延长基金合同期限；
- 5、转换基金运作方式；
- 6、更换基金管理人、基金托管人；
- 7、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 8、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 9、基金募集期延长；
- 10、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；
- 11、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 12、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；
- 13、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 14、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 15、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；
- 16、重大关联交易事项；
- 17、基金收益分配事项；
- 18、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 19、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 20、基金改聘会计师事务所；

- 21、变更基金份额发售机构；
- 22、基金更换注册登记机构；
- 23、开放式基金开始办理申购、赎回；
- 24、开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 25、开放式基金发生巨额赎回并延期支付；
- 26、开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 27、开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 28、中国证监会规定的其他事项。

### （九）澄清公告

1、在基金合同期限内，任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动时，相关的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送中国证监会。

2、有关基金信息公布后，中国证监会可要求基金信息披露义务人对公告内容作进一步公开说明。

### （十）基金份额申购、赎回价格

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

### （十一）其他应公开披露的信息

其他应公开披露的信息包括，但不限于：基金份额上市公告书、基金募集情况、基金份额持有人大会决议、基金管理人及基金托管人的基金托管部门的重大人事变动、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼和中国证监会规定的其他信息等。

### （十二）信息披露管理

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

2、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；特定基金信息披露事项应当符合中国证监会相关编报规则的规定。

3、基金托管人须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、定期报告和更新的招募说明书中有关内容进行复核、审查，并就此向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

4、基金管理人应建设、维护信息披露的国际互联网网站，并及时更新国际互联网网站披露的信息。

5、基金管理人、基金托管人可选择中国证监会指定的全国性报刊披露信息，所选择的报刊在一个基金会计年度内不得更换。

6、基金管理人除在其国际互联网网站及中国证监会指定的全国性报刊上披露信息外，还可以根据需要在其他报刊或销售资料中披露信息，但应当保证：

- （1）国际互联网网站及指定报刊上披露的同一信息应在同一天披露；
- （2）国际互联网网站及指定报刊不晚于非指定报刊或销售资料披露信息；
- （3）在不同宣传媒介上披露同一信息的内容一致；
- （4）在不同宣传媒介上披露信息不应影响投资人作出决策。

7、为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后十年。

8、基金管理人、托管人及其委托的机构通过新闻媒体披露与本基金有关的信息后，应当将相关的披露宣传材料报告中国证监会备案。

### （十三）信息披露文件的存放与查阅

本基金的信息披露文件文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售代理人的住所，供投资者查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 十六、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要包括：

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）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、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。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，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。

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

## （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本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。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

## （三）流动性风险

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者的申购和赎回。由于开放式基金在国内刚刚试点，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

## （四）技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

## （五）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金管理人、基金销售机构等机构无法正常工作，从而有影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 十七、基金的终止与清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，基金经中国证监会批准后将终止：

- 1、存续期内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元，基金管理人将宣布本基金终止；
- 2、基金经持有人大会表决终止的；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；
- 5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其

他适当的托管机构承受其原有权利及义务；

- 6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 7、中国证监会允许的其他情况。

## （二）基金的清算

### 1、基金清算小组

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

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

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

### 2、基金清算程序

- （1）基金终止后，发布基金清算公告；
- （2）由基金清算小组统一接管基金资产；
- （3）对基金资产和负债进行清理和确认；
- （4）对基金资产进行估值和变现；
- （5）将基金清算结果报告中国证监会；
- （6）公布基金清算结果公告；
- （7）进行基金剩余资产的分配。

### 3、清算费用

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

### 4、基金资产按下列顺序清偿

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

### 5、基金清算的公告

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

### 6、清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存。

## 十八、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》

### （一）基金管理人的权利和义务

#### 1、基金管理人的权利

- （1）自本基金成立之日起，依据本基金合同及有关法律运用本基金资产；
- （2）依照《基金法》、《试点办法》及其他有关规定，代表基金对被投资的上市公司行使股东权利；
- （3）依据本基金合同及有关法律监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国人民银行，必要时应采取措施保护基金投资者的利益；
- （4）选择、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
- （5）提议召开基金份额持有人大会；
- （6）担任注册登记人或委托其他机构担任注册登记人或更换注册登记人；
- （7）直接销售基金份额，获取认购（申购）费用；
- （8）依据基金合同的规定获得基金管理费收入及其他法定或约定的收入；
- （9）依据本基金合同及有关法律决定基金收益的分配方案；
- （10）在法律法规和基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理基金份额的申购和赎回；
- （11）基金终止时，组建或参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- （12）法律法规及基金合同规定的其他权利。

#### 2、基金管理人的义务

- （1）遵守基金合同；
- （2）自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- （3）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
- （4）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其他业务或委托其他机构代理这些业务；
- （5）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与登记过户工作或委托其他机构代理该项业务；
- （6）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基

金资产和管理人的自有资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

（7）除依据《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他法律法规的规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；

（8）接受基金托管人的监督；

（9）负责基金注册与登记过户。基金管理人应严格按照《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，为基金投资者办理基金注册与登记过户，并接受基金托管人的监督；

（10）按规定计算并公告基金份额净值；

（11）严格按照《基金法》、《试点办法》和本基金合同及其他有关规定，受理并办理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（12）严格按照《基金法》、《试点办法》和本基金合同及其他有关规定履行信息披露及报告义务；

（13）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《试点办法》和本基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

（14）依据本基金合同的规定向基金份额持有人分配基金收益；

（15）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（16）依据《基金法》、《试点办法》和本基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；

（17）保存基金的会计账册、报表、记录15年以上；

（18）确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出；并且保证投资者能够按照招募说明书公告的时间和方式查阅与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

（19）参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

（22）监督基金托管人按基金合同规定履行自己的义务；

（23）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（24）法律法规及基金合同规定的其他义务。

## （二）基金托管人的权利和义务

### 1、基金托管人的权利

（1）依法持有并保管基金资产；

（2）依据本基金合同约定获得基金托管费；

- (3) 监督本基金的投资运作；
- (4) 监督基金管理人的注册与登记过户服务；
- (5) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 依据本基金合同以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产；
- (3) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备有足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的本基金资产与基金托管人自有资产以及其他基金的资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册保管、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (5) 除依据《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；
- (6) 保管基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同和有关凭证、资料；
- (7) 以托管人和基金联名的方式开设证券账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来，代理基金的资金结算业务；
- (8) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《试点办法》、基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (9) 复核基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值；
- (10) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；
- (11) 采取适当、合理的措施，使本基金份额的认购、申购和赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；
- (12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算本基金份额的认购、申购、赎回的方法符合《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定；
- (13) 采用适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定；
- (14) 在定期报告内出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (15) 负责保存基金份额持有人名册；
- (16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等15年以上；



- (17) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (18) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；
- (21) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### **(三) 基金份额持有人的权利和义务**

1、每份基金份额代表同等的权利和义务。

2、基金份额持有人的权利

- (1) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并对审议事项行使表决权；
- (2) 分享基金收益；
- (3) 按基金合同的规定查询或者获取公开的基金业务和基金财务状况资料；
- (4) 申购、赎回及其他对基金份额处分的权利，并在规定的时间内取得有效申请的款项或基金份额；
- (5) 因基金管理人或基金托管人或基金注册登记人或基金销售机构的过错导致利益受到损害时，有要求赔偿的权利；
- (6) 获取基金清算后的剩余资产；
- (7) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- (3) 在所持有的基金份额范围内承担基金亏损或者终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；
- (5) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### **(四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

1、本基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金的每一基金份额都拥有平等的投票权。

基金份额持有人大会决议生效须经基金份额持有人大会讨论通过。上述通过事项自中国证监会依法核准或出具无异议意见书之日起生效。

2、基金份额持有人大会召开事由

有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

(1) 修改基金合同（因相应的法律、法规发生变动导致必须对基金合同进行修改的情况除外）；

(2) 提前终止基金合同；

(3) 更换基金管理人；

(4) 更换基金托管人；

(5) 转换基金运作方式；

(6) 与其他基金合并；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(8) 基金管理人和基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(9) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会；

(10) 中国证监会规定的其它情形以及法律法规及基金合同规定的其它事项。

### 3、基金份额持有人大会召集方式

(1) 在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定；

(2) 在更换基金管理人、审议与基金管理人利益冲突的事项或者基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集基金份额持有人大会；

(3) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集或在规定时间内未能做出书面答复，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；

基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。如果基金托管人也决定不召集或在规定时间内未能做出书面答复，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并应当至少提前三十日向中国证监会备案。基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

### 4、基金份额持有人大会的通知

召开基金份额持有人大会，召集人必须至少提前三十日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

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

采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交、收取方式和截止时间。

#### 5、基金份额持有人大会的召开方式

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开,也可以采取通讯等方式召开。

基金份额持有人大会的召开方式由召集人确定,但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表百分之五十以上基金份额的持有人参加,方可召开。

##### (1) 现场方式召开

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并行使表决权。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。

亲自出席会议者应持有基金份额的凭证、受托出席会议者应出具的委托人持有基金份额的凭证以及委托人的代理投票授权委托书应当符合法律、法规、基金合同和会议通知的规定。

如果出席会议的持有人代表的基金份额未达到百分之五十以上,或有其他情况未达到现场开会的条件,则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为15天,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。再次开会仍然必须达到上述所有相关条件,才能视为有效。

##### (2) 通讯方式召开

通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

- 1) 召集人按本基金合同的规定公告会议通知后,在两个工作日内连续公布相关提示性公告;
- 2) 召集人在基金托管人(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；

3) 直接出具书面意见的基金份额持有人所提交的持有基金份额的凭证, 以及受托代表他人出具书面意见的代理人所应出具的委托人持有基金份额的凭证和委托人的代理投票授权委托书应当符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定；

4) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果以通讯方式开会达不到上述通讯方式开会的条件, 或者召集人收到的出具书面表决意见书的基金份额持有人所代表的基金份额未能达到权益登记日基金总份额的百分之五十以上, 则对同一议题可履行再次开会程序。再次开会日期的提前通知期限为15天, 但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。再次开会仍然必须达到上述所有相关条件, 才能视为有效。

## 6、基金份额持有人大会的议事内容与程序

### (1) 议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项, 如修改基金合同、提前终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、与其他基金合并、提高基金管理人或基金托管人的报酬标准以及召集人认为需要提交基金份额持有人大会讨论的其它事项。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人应按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性：召集人负责对提案进行审议, 如果提案所涉及事项与基金有直接关系, 并且不超出法律、法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的, 则可以提交大会审议；对于不符合上述要求的, 不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决, 应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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

单独或合并持有权益登记日基金总份额百分之十以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 以及基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 如未获得基金份额持有人大会审议通过, 就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议, 其时间间隔不少于六个月。

### 3) 议事程序

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照下列第(8)款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, 在基金管理人未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权出席会议的代表主

持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额百分之五十以上多数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。

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

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前30天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 7、基金份额持有人大会的表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权；

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1) 一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上通过方为有效，除下列2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过方为有效。更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金合同、转换基金运作方式等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4) 采取通讯方式进行表决时，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无效表决。

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

## 8、计票

(1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点，但只能重新清点一次；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人的代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会

议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果；

4) 记票过程应当由公证机关予以公证。

## (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下, 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的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9、生效与公告

基金份额持有人大会决议应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案, 大会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。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人均具有法律约束力。

基金份额持有人大会决议应在生效之日起五个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## (五) 基金合同解除和终止的事由、程序

### 1、基金合同的修改

(1) 本基金合同的修改应经基金发起人、基金管理人和基金托管人同意；

(2) 修改本基金合同应召开基金份额持有人大会, 基金合同修改的内容应经基金份额持有人大会决议通过；

(3) 基金合同的修改应报中国证监会批准, 自批准之日起生效；但出现下列情况时, 可不经基金份额持有人大会决议, 由基金管理人和基金托管人同意后修改公布, 并报中国证监会备案：

1) 因相应的法律、法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行修改的情形；

2) 基金合同的修改并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的；

3) 因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更, 当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

### 2、基金合同的终止

(1) 出现下列情况之一的, 本基金合同经中国证监会批准后将终止：

1) 存续期间内, 基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人, 或连续60个工作日基金资产净值低于5000万元, 基金管理人将宣布本基金终止；

2) 基金份额持有人大会表决终止的；

3) 因重大违法行为, 基金被中国证监会责令终止的；

4) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由, 不能继续担任本基金管理人的职务, 而无其他适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；

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

6) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤消;

7) 中国证监会允许的其他情形。

#### (2) 基金合同的终止程序

本基金终止后, 应当依照有关法律法规和本基金合同的规定对基金进行清算。本基金合同于中国证监会批准基金清算结果并予以公告之日终止。

#### (六) 争议解决方式

各方当事人同意, 因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议, 如经友好协商或调解未能解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对当事人均有约束力。

本基金合同受中国法律管辖。

#### (七) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

1、本基金合同经基金发起人、基金管理人、基金托管人三方盖章以及三方法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。本基金合同的有效期限自生效之日起至该基金清算结果报中国证监会批准并公告之日止。基金份额持有人根据本基金合同的规定依法持有本基金份额即表示对本基金合同的承认和接受。

2、本基金合同自生效之日起对本基金合同的各方当事人具有同等的法律约束力。

3、本基金合同正本一式十份, 除上报中国证监会和中国人民银行各二份外, 基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有二份, 每份具有同等的法律约束力。

4、本基金合同存放在基金管理人和基金托管人的营业场所, 投资者可免费查阅, 也可按工本费购买本基金合同印制件或复印件; 如涉及争议事项需协商、仲裁的, 应以基金合同正本为凭。

### 十九、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《长城久恒平衡型证券投资基金托管协议》

#### (一) 托管协议当事人

##### 1、基金管理人

名称: 长城基金管理有限公司

住所: 深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址: 深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

邮政编码: 518026

法定代表人：杨光裕

成立日期：2001年12月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2001]55号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

存续期间：持续经营

## 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（1）基金托管人根据《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，对本基金的投资范围、基金资产的投资组合、所托管的基金管理人的所有基金的投资比例、基金资产净值的计算、基金管理费和基金托管费的计提和支付、基金收益分配等事项进行监督和核查。其中对基金的投资比例监督和核查自本基金成立之日起6个月后开始。

（2）基金托管人发现上述事项基金管理人的行为违反《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证



在规定期限内及时改正。

(3) 基金托管人发现基金管理人上述事项有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

#### 2、基金管理人

(1) 根据《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，基金管理人对基金托管人及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金资产实行分账管理、擅自动用基金资产等行为进行监督和核查。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，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在下一工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。

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

#### 3、基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

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

### (三) 基金财产的保管

#### 1、基金资产保管的原则

(1) 基金托管人应安全、完整地保管基金的全部资产。

(2) 基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的资产。基金托管人为基金设立独立的账户，本基金资产与基金托管人的其他资产或其他业务以及其他基金的资产实行严格的分账管理。保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立。

(3) 基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

(4) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

(5) 基金托管人应当设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

(6) 除依据《中华人民共和国信托法》、《基金法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关

规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金资产。

## 2、基金设立募集期间及募集资金的验资

(1) 基金设立募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管行的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金设立募集期满，由基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 基金管理人应将属于基金资产的全部资金划入基金托管人以基金名义开立的基金银行账户中。验资报告出具后，基金成立。

(4) 若基金未达到规定的募集额度不能成立，按规定办理退款事宜。

## 3、基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

## 4、基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立托管人与基金联名的证券账户，用于本基金证券投资的清算和存管。并对证券账户业务发生情况进行如实记录。

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

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，管理和运用由基金管理人负责。

## 5、债券托管专户的开设和管理

(1) 基金成立后，由基金管理人负责代理基金向中国证监会和中国人民银行申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。

(2) 基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央

国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

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

#### 6、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展而需要开立的其他账户，可以根据基金合同或有关法律法规的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、清算备付金账户开立和管理

清算备付金账户的开立和管理按照中国证监会和中国证券登记结算有限责任公司有关规定办理，用于证券资金清算。

#### 8、证券账户卡保管

证券账户卡由基金托管人保管原件。

#### 9、基金资产投资的有关实物证券的保管

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

#### 10、与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。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。如上述合同只有一份正本且该正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。

### (四) 基金资产净值计算与复核

#### 1、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。

#### 2、估值程序

(1) 基金份额净值是按照每个开放日闭市后，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，小数点后第四位四舍五入。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。基金管理人每个开放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。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。

### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

注册登记人负责编制和保管基金持有人名册。基金成立日、基金权益登记日、基金持有人大会权利登记日、每月最后一个开放日的持有人名册，由注册登记机构负责编制，并交由托管人保存。

基金托管人不得将所保存的基金持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

基金托管人和基金管理人对基金持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

### （六）争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会深圳分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金持有人的合法权益。

### （七）托管协议的修改与终止

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

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或本基金基金合同终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生《基金法》、《试点办法》、基金合同或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）账单服务

- 1、基金份额持有人可登录本基金管理人网站账户查询系统查阅对账单。
- 2、基金份额持有人可通过网站、电话等方式向本基金管理人定制对账单。基金管理人根据基金份额持有人的对账单定制情况，向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司旗下基金份

额的持有人定期或不定期发送对账单，但由于基金份额持有人未详实填写或未及时更新相关信息（包括姓名、手机号码、电子邮箱、邮寄地址、邮政编码等）导致基金管理人无法送出的除外。

## （二）红利再投资服务

若基金份额持有人选择本基金收益以基金份额形式进行分配，该持有人当期分配所得的红利将按照基金分红权益登记日(R日)下一开放日(R+1日)的基金份额净值为基准计算自动转为基金份额，并免收申购费用。

## （三）定期投资计划

本基金管理人已通过建设银行、农业银行、中国银行、招商银行、交通银行、华夏银行、光大银行、兴业银行、中信银行、北京银行、民生银行、浦发银行、平安银行、深圳农村商业银行、东莞农村商业银行、包商银行、中信建投证券、海通证券、申银万国证券、国泰君安证券、国信证券、长城证券、银河证券、安信证券、招商证券、平安证券、兴业证券、国盛证券、齐鲁证券、中信证券（山东）、广州证券、世纪证券、华泰证券、恒泰证券、东海证券、日信证券、华宝证券、长江证券、中信证券、民生证券、天源证券、华融证券、国海证券、中信证券（浙江）、信达证券、广发证券、西南证券、深圳众禄基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、北京增财基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、上海好买基金销售有限公司等机构为投资者提供本基金定期定额投资的服务，详情请查阅相关公告。

## （四）客户服务中心（Call Center）电话服务

1、24 小时自动语音应答服务，为投资者提供基金净值查询、基金账户查询、基金信息查询等服务。

2、工作时间由专门客服人员为投资者提供全面业务咨询（包括公司信息、基金信息、基金投资指南等）及投诉受理等服务。

公司网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)

客服邮箱：[support@ccfund.com.cn](mailto:support@ccfund.com.cn)

客服电话：400-8868-666

## 二十一、其他应披露的事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	关于恢复旗下基金所持拓维信息股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-05-21
2	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持停牌股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-06-25
3	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持停牌股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-06-28
4	长城基金管理有限公司关于董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	证券时报及本基金管理人网站	2014-07-05
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-08-09
6	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持三川股份股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-08-19
7	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-09-02
8	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-09-03
9	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持华宇软件股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-09-19
10	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持飞利信股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-09-30
11	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-10-29
12	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014-11-04
13	在本报告期内刊登的其他公告		

## 二十二、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人和基金代销机构的办公场所和营业场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十三、备查文件

- （一）中国证监会批准长城久恒平衡型证券投资基金设立的文件
- （二）《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城久恒平衡型证券投资基金托管协议》

- （四）法律意见书
- （五）基金发起人营业执照
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八）中国证监会规定的其他文件

上述备查文件存放在基金管理人的办公场所，基金投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长城基金管理有限公司  
二〇一四年十二月十二日