

# 长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

## 招募说明书更新（2022年第2号）

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇二二年八月

长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）由长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）更名而来，长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）由久富证券投资基金转型而成。依据中国证监会2007年2月1日证监基金字[2007]25号文核准的久富证券投资基金基金份额持有人大会决议，久富证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）”。自2007年2月12日起，由《久富证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。根据《长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更基金名称、基金类别并相应修改基金合同条款的公告》，长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）自2015年8月3日起更名为“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”，并相应修改基金合同和托管协议。

## 重要提示

（一）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。

（二）投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金招募说明书、基金产品资料概要和基金合同。

（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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

（四）本招募说明书所载内容截止日为2022年8月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年6月30日，财务数据未经审计。

## 目录

一、绪言.....	3
二、释义.....	4
三、基金管理人.....	9
四、基金托管人.....	18
五、相关服务机构.....	22
六、基金的历史沿革.....	24
七、基金的存续.....	26
八、基金的集中申购与基金合同的生效.....	27
九、基金份额的上市交易.....	28
十、基金份额的申购与赎回.....	29
十一、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记.....	40
十二、基金的投资.....	42
十三、基金的业绩.....	49
十四、基金的财产.....	52
十五、基金资产估值.....	53
十六、基金的收益与分配.....	58
十七、基金的费用与税收.....	59
十八、基金的会计与审计.....	62
十九、基金的信息披露.....	63
二十、风险揭示.....	67
二十一、基金的终止与清算.....	70
二十二、基金合同的内容摘要.....	72
二十三、基金托管协议的内容摘要.....	84
二十四、对基金份额持有人的服务.....	98
二十五、其他应披露事项.....	99
二十六、招募说明书的存放及查阅方式.....	101
二十七、备查文件.....	102

## 一、绪言

《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）及其他有关规定以及《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）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发售的。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合同当事人之间基本权利义务的法律文件。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额，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。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为必要条件。基金合同的当事人应按照《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。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF），本基金由久富证券投资基金转型而成，并自长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）更名而来；
基金久富：	指久富证券投资基金，运作方式为契约型封闭式；
基金合同或本基金合同：	指《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；本基金合同由《久富证券投资基金合同》修订而成；
招募说明书：	指《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新；
基金产品资料概要：	指《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新；
托管协议	指基金管理人和基金托管人签订的《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及其不时做出的任何有效修订和补充，本托管协议由《久富证券投资基金托管协议》修订而成；
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；
深交所：	指深圳证券交易所；
《基金法》：	指2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员第十四次会议《全国人民代表大会常务委员关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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；
《运作办法》：	指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《销售办法》：	指中国证监会2013年3月15日颁布、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；
《信息披露办法》：	指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《流动性风险规定》:	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订;
元:	指人民币元;
基金合同当事人:	指受本基金合同约束, 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:	指交通银行股份有限公司;
基金份额持有人:	指依照法律法规或基金合同合法取得基金份额的投资人;
基金转型:	指对包括基金久富由封闭式转为开放式基金, 调整存续期限, 终止上市, 调整投资目标、范围和策略, 修订基金合同, 并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”等一系列事项的统称;
本基金合同生效日:	指本《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效起始日, 本基金合同自久富证券投资基金终止上市之日起生效, 原《久富证券投资基金基金合同》自同一日起失效;
集中申购期	指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间, 最长不超过 1 个月;
注册登记业务:	指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务。具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;
注册登记人:	指办理基金注册登记的机构, 本基金的注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司;
注册登记系统:	指中国证券登记结算有限公司开放式基金注册登记系统;
证券登记结算系统:	指中国证券登记结算有限公司深圳分公司证券登记结算系统;
会员单位:	指具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位;
投资人:	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者;
个人投资者:	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人;

机构投资者:	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织;
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,经中国证监会批准可以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的机构投资者;
基金份额持有人大会:	指按照本基金合同之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议;
销售场所	指场外销售场所和场内交易场所,分别简称场外和场内;
场外:	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所;
场内:	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所;
上市交易:	指基金存续期间投资者通过会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为;
存续期:	指自《久富证券投资基金基金合同》生效之日起至本《长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限;
工作日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日;
申购:	指在本基金基金合同生效后的存续期间,投资人申请购买本基金基金份额的行为;
赎回:	指基金份额持有人按本基金合同规定的条件,要求基金管理人购回本基金基金份额的行为;
巨额赎回:	指在本基金单个开放日内,基金净赎回申请份额(基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额)与净转出申请份额(基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额)之和超过上一开放日本基金总份额 10% 的情形。
基金转换:	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为;
系统内转托管:	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托

	管的行为；
跨系统转登记：	指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为；
费用类别：	指将基金份额持有人持有的基金份额依据其选择以前端或后端收费方式缴纳认购/申购费用所划分成的不同份额级别类型；
投资指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
基金账户：	指注册登记人为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
开放日：	指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期；
T 日：	指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日起（不包括 T 日）的第 n 个工作日；
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、银行存款利息及其他合法收入；
基金资产总值：	基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
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余额总数后得出的基金份额的资产净值；
基金份额类别：	指根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式等事项的不同将本基金基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值；



A 类基金份额:	指在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别;
C 类基金份额:	指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别;
销售服务费:	指从 C 类基金份额的基金资产中计提的, 用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用;
流动性受限资产:	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产, 包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款 (含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等;
基金财产估值:	指计算评估基金财产和负债的价值, 以确定基金资产净值和基金份额净值的过程;
摆动定价机制:	指当开放式基金遭遇大额申购赎回时, 通过调整基金份额净值的方式, 将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响, 确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待;
法律法规:	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
不可抗力:	指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素, 包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 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. 住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层
3. 办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层
4. 法定代表人：王军
5. 组织形式：有限责任公司
6. 成立日期：2001年12月27日
7. 电话：0755-29279188                      传真：0755-29279000
8. 联系人：崔金宝
9. 客户服务电话：400-8868-666
10. 注册资本：壹亿伍仟万元
11. 股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券股份有限公司	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%

#### (二) 基金管理人主要人员情况

##### 1、董事、监事及高管人员介绍

###### (1) 董事

王军先生，董事长，学士。1999年加入中国华能集团有限公司，历任财务部主管、副处长、处长、副主任等职务。2018年11月出任长城基金管理有限公司董事长。

邱春杨先生，董事、总经理、首席信息官、投资决策委员会主任，博士。2001年3月至2002年10月任职于南方证券资产管理部；2002年11月至2020年7月任职于广发基金

管理有限公司(含广发基金筹备期), 历任研究发展部产品设计小组组长、机构理财部副总经理、金融工程部总经理、产品总监、公司副总经理和督察长职务。2020年7月出任长城基金管理有限公司总经理。

韩飞先生, 董事, 硕士, 现任长城证券股份有限公司副总裁。1997年6月加入长城证券有限责任公司, 历任营业部总经理、创新产品开发部副总经理(主持工作)、营销管理总部副总经理、广州天河北营业部总经理、广东分公司(筹)负责人等职务; 2015年3月至2018年12月, 任长城证券广东分公司总经理; 2018年12月至2019年8月, 任长城证券经纪业务总部总经理兼广东分公司总经理; 2019年8月至今, 任长城证券副总裁。

曾晓玲女士, 董事, 硕士, 现任长城证券股份有限公司总裁助理兼人力资源部总经理。曾任职于深圳义达会计师事务所、蛇口集装箱码头有限公司、富鼎投资管理有限公司、上海东方威球货运代理有限公司。2003年5月加入长城证券, 在资产管理部从事资产监理工作, 2005年3月调入风险管理部, 历任经理、总经理助理、副总经理、部门总经理; 2019年3月至今任公司总裁助理, 2021年3月至今任人力资源部总经理。

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。

朱静女士, 董事, 硕士, 现任东方证券股份有限公司职工董事、战略发展总部总经理、工会办事机构主任, 东方金融控股(香港)有限公司董事、总经理, 上海东证期货有限公司董事, 东证国际金融集团有限公司董事, 上海东方证券资产管理有限公司监事, 诚泰融资租赁(上海)有限公司董事。自1992年7月至1995年5月任西安矿山机械厂职员, 1995年5月至1999年2月任上海财通国际投资管理有限公司证券管理部经理、副总经理, 1999年3月至2015年2月历任东方证券股份有限公司经纪业务总部职员、业务规划董事、运行资深主管、总经理助理, 营运管理总部总经理助理、副总经理, 董事会办公室副主任, 自2015年2月起担任东方证券股份有限公司战略发展总部总经理, 2019年4月起兼任东方金融控股(香港)有限公司总经理, 2021年9月起兼任东方证券股份有限公司工会办事机构主任。

张文栋先生, 董事, 硕士, 现任北方国际信托股份有限公司副总经理。曾任职于深圳新产业投资股份有限公司, 2003年10月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务二部总经理、北方国际信托股份有限公司业务总监、运营总监、副总经理。

万建华先生, 独立董事, 博士研究生, 高级经济师, 现任上海市互联网金融行业协会会长, 通联支付网络服务股份有限公司董事长。曾任中国人民银行资金管理局宏观分析处处长; 招商银行总行常务副行长; 长城证券董事长; 招商证券董事长; 中国银联首任董事长、总裁; 上海国际集团总裁; 国泰君安证券董事长等职务。

唐纹女士, 独立董事, 学士, 现已退休。曾任电力部科学研究院系统所工程师, 中国

国际贸易促进委员会经济信息部副处长、处长，中国华能集团香港公司副总经理、党委书记。

徐英女士，独立董事，学士，现已退休。曾任北京财贸学院金融系助教、讲师，海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理，长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记，景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事，新华资产管理股份有限公司副董事长。

温子健先生，独立董事，硕士，现已退休。曾任内蒙古广播事业局技术员，南京物资学校教师，人民日报记者，深圳证券时报社有限公司社长兼总编辑。

## (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），现任长城证券股份有限公司董事会秘书。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4月至2015年3月，历任长城证券财务部总经理、财务负责人；2015年3月至2019年4月，任长城证券董事会秘书兼财务负责人；2019年4月至今，任长城证券董事会秘书。

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风险总监。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、北方国际信托股份有限公司风险总监。

杨斌先生，监事，硕士，现任东方证券股份有限公司副总裁、首席风险官、合规总监，上海东证期货有限公司董事，东方金融控股（香港）有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司董事，东方证券承销保荐有限公司董事，上海东方证券创新投资有限公司董事。曾任职于中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处，自1998年7月至2004年3月任上海证管办稽查处、稽查局案件审理处副主任科员、主任科员，自2004年3月至2015年5月先后于上海证监局稽查处、机构二处、机构一处、期货监管处、法制处等部门任职，历任主任科员、副处长、处长。

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。

赵永强先生，职工监事，学士，现任长城基金管理有限公司运行保障部总经理。2004年7月加入华润（深圳）有限公司任职财务会计；2008年4月加入中国平安保险（集团）股份有限公司，任职于资金部、财务部；2010年4月加入长城基金管理有限公司，任职于运行保障部。

崔金宝先生，职工监事，学士，现任长城基金管理有限公司综合管理部副总经理（主持

工作)。2002年8月至2013年9月任职于华能临沂发电有限公司财务部，2013年9月至2019年10月任职于华能山东发电有限公司财务部。2019年10月加入长城基金管理有限公司，任综合管理部副总经理；2021年9月起主持综合管理部工作。

张静女士，职工监事，硕士，现任长城基金管理有限公司监察稽核部业务主管。2005年7月至2007年5月任职于摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部，2007年5月加入长城基金管理有限公司。

侯涛先生，职工监事，本科，现任长城基金管理有限公司综合管理部副总经理。1994年9月至1998年7月任职于安徽省电力建设第一工程公司，1998年7月至2001年7月任职于安徽省芜湖市供电局，2001年7月至2012年9月任职于深圳证券通信有限公司，2012年9月加入长城基金管理有限公司。

### (3) 高级管理人员

王军先生，董事长，简历同上。

邱春杨先生，董事、总经理，简历同上。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼权益投资部总经理、投资决策委员会委员、基金经理，硕士。曾任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、长城证券股份有限公司。2001年10月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、研究部总经理、公司总经理助理。

车君女士，督察长兼监察稽核部总经理，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。2011年12月加入长城基金管理有限公司。

## 2、本基金基金经理简历

陈良栋先生，硕士。2011年7月加入长城基金管理有限公司，历任行业研究员、“长城消费增值股票型证券投资基金”基金经理助理。自2015年11月至2018年9月任“长城保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月至2018年11月任“长城久益保本混合型证券投资基金”基金经理，自2015年11月至2018年11月任“长城久祥保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年3月至2019年1月任“长城久安保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年8月至2019年7月任“长城久鼎保本混合型证券投资基金”基金经理，自2018年11月至2020年6月任“长城久祥灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。自2017年3月至今任“长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2018年12月至今任“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理，自2021年9月至今任“长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金”基金经理，自2022年6月至今任“长城产业成长混合型证券投资基金”基金经理，自2022年8月至今任“长城产业趋势混合型证券投资基金”基金经理。

长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）（原“久富证券投资基金”转型）历任基金经理如下：项志群先生自2007年2月起至2008年2月任该基金基金经理；徐九龙先生自2008年2月至2009年3月担任该基金基金经理；李硕先生自2008年2月至2009年3月担任该基金基金经理；韩刚自2009年1月至2009年9月担任该基金基金经理；杨建华自2009年9月至2016年9月担任该基金基金经理；何以广先生自2016年9月至2018年12月担任该基金基金经理。

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：

邱春杨先生，投资决策委员会主任，公司总经理、首席信息官。

杨建华先生，投资决策委员会委员，公司副总经理、投资总监兼权益投资部总经理、基金经理。

张勇先生，投资决策委员会委员，公司总经理助理、固定收益投资总监、基金经理。

何以广先生，投资决策委员会委员，公司总经理助理、研究部总经理、基金经理。

马强先生，投资决策委员会委员，公司总经理助理、多元资产投资部总经理、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，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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. 编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

7. 计算并公告基金净值信息，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. 国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### （四）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

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

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

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

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

3、本基金管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

(1) 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、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

#### (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、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

3、不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏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、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### (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；风险控制委员会、合规审查委员会、督察长和监察稽核部、风险管理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、风险管理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、风险管理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、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 13 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 137 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 11 位。

截至 2022 年 3 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 12.32 万亿元。2022 年一季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 233.4 亿元。

交通银行总行设资产托管部（下文简称“托管部”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

#### (二) 主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至

2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生2020年7月起担任本行行长；2016年11月至2020年5月任中国投资有限责任公司副总经理；2014年12月至2016年11月任中国光大集团股份公司副总经理；2014年6月至2014年12月任中国光大(集团)总公司执行董事、副总经理(2014年6月至2016年11月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业(集团)有限责任公司董事长)；2009年9月至2014年6月历任中国光大银行行长助理、副行长(期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理)；1993年7月至2009年9月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生2003年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生2022年4月起任本行资产托管部总经理；2014年12月至2022年4月任本行资产托管部副总经理；2000年7月至2014年12月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生2000年于复旦大学获经济学硕士学位。

### (三) 基金托管业务经营情况

截至2022年3月31日，交通银行共托管证券投资基金646只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产、QDIE资金、QDLP资金和QFLP资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### (二) 内部控制原则

1、合法性原则：托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，

覆盖各项业务、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，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管部内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行

复查，督促基金管理人改正。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人有关重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 长城基金管理有限公司直销中心

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

法定代表人：王军

电话：0755-29279128

传真：0755-29279124

联系人：余伟维

客户服务电话：400-8868-666

网址：www.ccfund.com.cn

##### (2) 长城基金管理有限公司网上直销系统

网上直销系统包括基金管理人网上交易平台(<https://etrade.ccfund.com.cn/etrading/>)、长城基金管家(手机APP)和基金管理人指定的电子交易平台。个人投资者可以登录基金管理人网上交易平台、长城基金管家(手机APP)和基金管理人指定的电子交易平台，在与基金管理人达成网上交易相关协议、接受基金管理人相关服务条款、了解基金网上交易业务规则后，通过基金管理人网上直销系统办理开户、申购、赎回等业务。

#### 2、场外代销机构

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时在网站上公示。

本基金销售机构及联系方式请查阅本基金管理人网站上的公示信息。

#### 3、场内代销机构

指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站([www.szse.cn](http://www.szse.cn))。

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) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：任瑞新

电话：(010) 58598835

传真：(010) 58598907

（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：0755-33256666

传真：0755-33206888

联系人：李伟健

（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：Tony Mao 毛鞍宁

电话：0755-25028023

传真：0755-25026023

联系人：昌华



## 六、基金的历史沿革

长城久富核心成长混合型投资基金（LOF）由长城久富核心成长股票型投资基金（LOF）更名而来，长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）由久富证券投资基金转型而成。

### （一）久富证券投资基金

久富证券投资基金是根据中国证券监督管理委员会《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2002]11号）批准，由原富岛基金、兴沈基金、久盛基金经清理规范、合并而成的契约型封闭式证券投资基金，基金发起人为长城证券股份有限公司和长城基金管理有限公司。基金久富于2002年4月18日在深交所上市，基金存续期延长五年（至2007年5月20日）。本基金于2002年5月28日成功扩募至5亿份基金单位，每份基金单位面值1元，发起人认购500万份，其余49500万份由社会公众持有，扩募部分于2002年6月6日在深交所上市交易。

2007年1月15日，久富证券投资基金基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论通过了基金久富转型议案，内容包括基金久富由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会2007年2月1日证监基金字[2007]25号文核准，持有人大会决议生效。依据持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市，自2007年2月12日起，原《久富证券投资基金基金合同》失效，《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）”（现更名为长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF））。

### （二）富岛基金、兴沈基金、久盛基金

**富岛基金：**海南富岛基金于92年4月经中国人民银行海南省分行[琼银字（1992）市管字23号文]批准设立的。基金管理人为海南省证券公司，托管人为交通银行海南分行。富岛基金为封闭型信托投资基金，封闭期为20年，基金规模为16000万单位。基金从1992年8月3日起，在海南证券交易中心上市交易。富岛基金在1992年，送股比例为10送2股；1996年为每10个基金派发现金1.50元（含税）；1997年为每10个基金派发现金1.50元（含税）；其余年度均未进行分配。

**兴沈基金：**兴沈基金是于1992年5月经中国人民银行沈阳市分行[沈银金字（1992）100号文]批准设立的封闭式契约型不定存续期基金。沈阳市信托投资公司为发起人和管理人。兴沈基金规模为3510万份基金单位，沈阳市信托投资公司作为发起人持有300万份基金单位，其余3210万份基金单位均上市流通。兴沈投资基金于1992年10月23日在沈阳证券交易中心上市，并于1994年3月7日与上海证券交易所联网上市。兴沈基金在1993年送股比例为10送1.7股；1994年至1997年每年分红为每10个基金派发现金1.9元、1.5元、0.8

元、0.5 元；以后年度均未进行分配。

久盛基金：久盛投资基金是江西省证券公司于 1992 年 6 月经中国人民银行江西省分行[赣银字（1992）157 号文]批准设立的封闭式契约型不定存续期基金。江西省证券公司为发起人和管理人。久盛投资基金规模为 3509 万份基金单位，江西省证券公司作为发起人持有 290 万份基金单位，其余 3219 万份基金单位均上市流通。久盛投资基金于 1993 年 9 月 17 日在沈阳证券交易中心上市，并于 1994 年 3 月 7 日与上海证券交易所联网上市。久盛投资基金历年平均分配率为 10.20%。

依据《暂行办法》、《国务院办公厅转发中国证监会〈原有投资基金清理规范方案〉的通知》（国办发（1999）28 号）及中国证监会《关于海南省原有投资基金清理规范方案的批复》（证监基金字[2000]47 号）、《关于江西省原有投资基金清理规范方案的批复》（证监基金字[2000]20 号）、《关于沈阳兴沈基金清理规范方案的批复》（证监基金字[2000]64 号）的有关精神，富岛、久盛、兴沈投资基金现被清理规范。

## 七、基金的存续

### (一) 基金份额的变更登记

原基金久富终止上市之后，其基金份额仍然登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统(以下简称“中国结算深圳证券结算系统”)。在2007年5月18日本基金上市交易后，投资人可通过深交所LOF平台办理本基金份额的买卖和申购赎回业务。

### (二) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

## 八、基金的集中申购与基金合同的生效

### (一) 基金的集中申购

本基金根据中国证监会 2007 年 2 月 1 日证监基金字[2007]25 号《关于核准久富证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，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进行集中申购，集中申购期自 2007 年 3 月 5 日起至 2007 年 3 月 6 日止。本次集中申购共募集 7,934,819,964.27 份基金份额，有效申购户数为 237,127 户。

本基金原有基金份额 1,140,424,000.00 份，集中申购后，本基金总份额为 9,075,243,964.27 份。

### (二) 基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2007 年 2 月 12 日正式生效。

### (三) 基金的类型

混合型。

### (四) 基金的运作方式

契约型上市开放式。

### (五) 基金存续期限

不定期。

## 九、基金份额的上市交易

### (一) 上市交易的地点

深圳证券交易所。

### (二) 上市交易的时间

2007年5月18日。

### (三) 上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循深圳证券交易所相关业务规则的规定。

### (四) 上市交易的费用

本基金上市交易的费用比照封闭式基金的有关规定办理。

### (五) 上市交易的行情揭示

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

### (六) 上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

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

## 十、基金份额的申购与赎回

投资者可通过场外或场内两种方式对本基金 A 类基金份额进行申购与赎回。投资者仅可通过场外方式对本基金 C 类基金份额进行申购、赎回。

### （一）场内基金份额的申购与赎回

#### 1、申购与赎回办理的场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位（具体名单见“五、相关服务机构”）。

#### 2、申购、赎回账户

投资人通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

#### 3、申购与赎回办理的开放日及开放时间

##### （1）开放日及开放时间

深圳证券交易所的工作日为本基金的场内申购赎回开放日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。在基金合同约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。

##### （2）申购与赎回的开始时间

本基金已于 2007 年 3 月 19 日开放申购业务，于 2007 年 5 月 18 日开放赎回业务。

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。

#### 4、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

（2）基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购、赎回申报单位以深圳证券交易所的规定为准。

（3）当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

（4）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体规定请参见相关公告。

#### 5、申购和赎回的费用

##### （1）A 类基金份额申购费用

本基金 A 类基金份额的申购费率随申购金额的增加而递减。申购费用在申购时收取并由申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

场内申购金额 (M, 含申购费)	申购费率
M < 50 万元	1.5%
50 万元 ≤ M < 200 万元	1.0%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.5%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

(2) A 类基金份额赎回费用

持续持有期	赎回费率
1—6 天	1.5%
7 天及以上	0.5%

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,对持续持有期不少于 7 日的投资者收取的赎回费,不低于赎回费总额的 25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(3) 基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费用和赎回费用标准,调整后的申购费用和赎回费用标准在最新的招募说明书及基金产品资料概要中列示。上述费用标准如发生变更,基金管理人最迟应于新的费用标准实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(4) 当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

6、基金申购份额、赎回金额的计算方式

本基金根据各类基金份额净值计算申购份额和赎回金额。

(1) 申购 A 类基金份额的计算方法:

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

$$\text{申购手续费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日该类基金份额的基金份额净值}$$

场内申购份额保留到整数位,不足 1 份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例:某投资人投资 10 万元申购本基金,假设申购当日的基金份额净值为 1.0160 元,则其可得到的申购份额为:

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0160 = 96,970.64 \text{ 份}$$

因场内份额保留至整数份,故投资者申购所得份额为 96,970 份,不足 1 份部分对应的

申购资金返还给投资者。

$$\text{实际净申购金额} = 96,970 \times 1.0160 = 98,521.52 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,521.52 - 1,477.83 = 0.65 \text{ 元}$$

(2) 基金赎回金额的计算方法:

赎回总金额 = 赎回份数 × 赎回当日该类基金份额的基金份额净值

赎回手续费 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回手续费

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例: 某投资人赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额, 持有时间为 10 个月, 赎回费率为 0.5%, 假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0250 元, 则其可得净赎回金额为:

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.0250 = 10,250 \text{ 元}$$

$$\text{赎回手续费} = 10,250 \times 0.5\% = 51.25 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,250 - 51.25 = 10,198.75 \text{ 元}$$

即投资人赎回 10,000 份 A 类基金份额, 假设赎回当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0250 元, 则可得到 10,198.75 元净赎回金额。

## 7、申购与赎回的登记结算

基金申购、赎回的登记结算按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### (二) 场外基金份额的申购与赎回

#### 1、申购与赎回场所

(1) 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的申购、赎回。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或者基金管理人网站披露并不时更新的销售机构名录中列明。;

(2) 基金管理人可以酌情增加或减少基金销售机构;

(3) 销售机构可以酌情增加或减少其销售网点、变更营业场所。

#### 2、申购、赎回的办理时间

##### (1) 开放日及业务办理时间

基金开放日为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日, 即上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。目前, 上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午: 9:30-11:30, 下午 1:00-3:00。若出现新的证券交易市场或证券交易所交易时间更改或其他原因, 基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。在基金合同约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。

##### (2) 申购赎回的开始日

本基金已于 2007 年 3 月 19 日开放申购业务, 于 2007 年 5 月 18 日开放赎回业务。



### 3、申购、赎回的原则

(1) “未知价”原则，即申购、赎回价格以受理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，赎回以持有的基金份额申请。

(3) 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申(认)购的先后次序进行顺序赎回。

(4) 当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

(5) 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。在变更上述原则时，基金管理人必须最迟在新规则实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 4、申购、赎回的程序

(1) 申请方式：书面申请或销售机构规定的其他方式。

(2) 投资人在提交申购基金的申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资人在提交赎回申请时，账户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

(3) 申购、赎回的确认与通知：T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 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。

(4) 申购、赎回款项的支付：基金申购采用全额缴款方式。基金份额持有人赎回申请确认后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内将赎回款项划往基金份额持有人账户。

(5) 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，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

5、申购、赎回的数额约定：本基金管理人规定，本基金单笔最低申购金额为 1 元。投资人通过销售机构申购本基金时，当销售机构设定的最低申购金额高于该申购金额限制时，除需满足基金管理人规定的最低申购金额限制外，还应遵循销售机构的业务规定。基金申购份额计算单位为份，四舍五入保留到小数点后两位。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体规定请参见相关公告。

投资人赎回时按份额赎回基金，基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请不得低于 10 份，全额赎回时不受该限制。投资者每个交易账户不设最低基金份额余额限制。赎回金额计算单位为人民币元，赎回金额按四舍五入保留到小数点后两位。

基金管理人可根据市场情况，调整申购金额、赎回份额及最低持有份额的数量限制，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介上公告。

### 6、申购、赎回的费用

(1) 申购费率

本基金分为 A 类和 C 类基金份额。投资人在申购 A 类基金份额时支付申购费用，申购 C 类基金份额不支付申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金 A 类基金份额的的申购费率随申购金额的增加而递减，投资人每笔申购的适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：

(1) A 类基金份额申购费率

申购金额(M, 含申购费)	申购费率
M<50 万元	1.5%
50≤M<200 万元	1.0%
200≤M<500 万元	0.5%
M≥500 万元	每笔收取 1000 元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户以外的其他投资者。

(2) A 类基金份额特定申购费率

申购金额(M, 含申购费)	申购费率
M<50 万元	0.3%
50≤M<200 万元	0.2%
200≤M<500 万元	0.1%
M≥500 万元	每笔收取 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户，包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金 A 类基金份额申购费由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

(2) 赎回费率

本基金的场外赎回费率根据投资人持有本基金时间的增加而递减，本基金对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别采取不同的赎回费率结构，具体费率如下表所示：

1) A 类基金份额赎回费率

持续持有期	赎回费率

1—6 天	1.5%
7—364 天	0.5%
365—729 天	0.25%
730 天及以上	0

2) C类基金份额赎回费率

持续持有期	赎回费率
1—6 天	1.5%
7—29 天	0.5%
30 天及以上	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,对持续持有期不少于7日的投资者收取的赎回费,不低于赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金申购、赎回费率由基金管理人根据基金合同的规定确定并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。在不违反法律法规和基金合同约定的前提下,基金管理人有权根据市场情况调整收费方式及相关费率,但最迟应于调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

7、申购份额、赎回金额的计算方式

(1) 基金申购份额的计算

1) 申购 A 类基金份额的计算方法

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购手续费 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日该类基金份额的基金份额净值

申购份额以当日该类基金份额的基金份额净值为基准计算,计算结果以四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例:某投资人投资 10 万元申购本基金 A 类基金份额,假设申购当日 A 类基金份额的基

基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的 A 类基金份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.0160 = 96,970.64 \text{ 份}$$

2) 申购 C 类基金份额的计算方法

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日该类基金份额的基金份额净值}$$

例：某投资人投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.1000 元，则其可得到的 C 类基金份额为：

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.1000 = 90,909.09 \text{ 份}$$

(2) 基金赎回金额的计算

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回手续费} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回手续费}$$

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资人赎回本基金 A 类基金份额 10,000 份，持有时间为 1 年半，适用的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日本基金 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0250 元，则：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.0250 = 10,250 \text{ 元}$$

$$\text{赎回手续费} = 10,250 \times 0.25\% = 25.63 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,250 - 25.63 = 10,224.37 \text{ 元}$$

即投资者赎回 10,000 份本基金 A 类基金份额，可得到 10,224.37 元赎回金额。

8、基金份额净值的计算

$$T \text{ 日各类基金份额净值} = T \text{ 日该类基金份额资产净值} / T \text{ 日该类基金份额余额。}$$

T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况经中国证监会同意可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

9、申购、赎回的注册登记

投资人申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人在 T+2 日(含该日)后有权赎回该部分基金份额。投资人赎回本基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日自动为投资人扣除权益并办理注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### (三) 拒绝或暂停接受申购

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常运作；
- (2) 证券交易场所在交易时间非正常停市；
- (3) 基金规模过大，使相应的基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (4) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- (5) 基金管理人、基金托管人、基金代销机构和登记注册机构的技术保障或人员支持等不充分；
- (6) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时，基金管理人有权对该等申购申请进行部分确认或拒绝接受该等申购申请；
- (7) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

(8) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

2、基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

- (1) 拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；
- (2) 拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；
- (3) 按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

3、拒绝或暂停接受申购的处理如果投资者的申购申请被拒绝或暂停接受，被拒绝的申购款项将退还给投资者。

基金暂停申购，基金管理人应当在中国证监会指定媒介上公告。暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

#### **(四) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形**

除下列情形外，基金管理人不得暂停接受投资者的赎回申请或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常运作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- (3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- (4) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项；
- (5) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日报中国证监会备案，并在规定期限内编制临

时报告书，在指定媒介上予以公告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付时，可支付部分将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在中国证监会指定媒介上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

基金暂停赎回，基金管理人应及时在中国证监会指定媒介上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

### **(五) 巨额赎回的情形及处理**

#### **1、巨额赎回的情形及处理方式**

若一个工作日内的基金净赎回申请（净赎回申请=有效赎回申请总数-有效申购申请总数）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过前一日该基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况对于赎回申请分别决定全额赎回或者部分顺延赎回。

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

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于该基金总份额的 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，应当按单个账户赎回申请量占该基金赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；赎回未受理部分可延迟至下一个开放日办理，但投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销。顺延至下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将以下一个开放日的该类基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。场内的赎回申请在遇到巨额赎回时不予办理延期赎回，当日未获受理部分予以撤销。

(3) 若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过上一日基金总份额的 20%，基金管理人有权先行对该单个基金份额持有人超出 20%的赎回申请实施延期办理，而对该单个基金份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请与其他基金份额持有人的赎回申请，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。所有延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类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。具体见相关公告。

(4)巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

#### 2、连续巨额赎回的情形及处理方式

基金连续2个开放日以上(含2个开放日)发生巨额赎回，即为连续巨额赎回。

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20个工作日，并应当在中国证监会指定媒介上公告。

#### (六)其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《基金合同》或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。基金管理人应当立即在中国证监会指定媒介上刊登暂停公告。

#### (七)重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日在中国证监会指定媒介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。

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中国证监会指定媒介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该类基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前3个工作日在中国证监会指定媒介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该类基金份额净值。

#### (八)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。

#### (九)定期定额投资计划

“定期定额投资计划”是指投资者可通过本基金的销售机构提交申请，约定每月扣款时间、扣款金额及扣款方式，由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

本基金管理人已通过本招募说明书“五、相关服务机构”中的“(一)基金份额发售机构”中列明的销售机构为投资者提供本基金的定期定额投资服务，具体业务开通情况及办理

程序请查阅相关公告并遵循各销售机构的规定。

#### **(十) 其他特殊交易**

在相关法律法规有明确规定的条件下,基金管理人还可办理除上述业务以外的其他特殊交易业务。



## 十一、基金的非交易过户和基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

### (一) 基金的非交易过户

1、非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行，及基金注册与过户登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。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其他具有社会公益性质的社会团体。

“强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金注册登记人可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

2、办理非交易过户业务必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册登记人或其指定的机构申请办理。

### (二) 基金份额的登记

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

2、登记在注册登记系统中的基金份额可通过基金销售机构申请赎回，但不可卖出。

3、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可上市交易，也可直接申请赎回。

### (三) 系统内转托管

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

2、份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构(网点)时，销售机构(网点)之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

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

### (四) 跨系统转登记

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

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

## 十二、基金的投资

### (一) 投资目标

投资于具有核心竞争力的企业，分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益，力争为基金持有人实现稳定的超额回报。

### (二) 投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票（包含存托凭证）、债券、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基金总资产 60%—95%，债券占基金总资产 0%—35%，权证投资占基金资产净值 0%—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金股票资产中，不低于 80%的资金将投资于具有核心成长优势的上市公司发行的股票。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) 投资理念

本基金将依托长城基金公司富有效率的研究团队，执行严格风险收益配比原则与选股流程，重估值、弱偏好，努力突破自身的习惯性束缚，以追求知行合一、坚持不懈的工作理念构建均衡而富有活力的投资组合。

### (四) 投资策略

基金投资的核心策略是“自下而上、精选个股”，同时根据市场偏好适度配置主题类资产以保持组合的均衡性。精选原则将继承基金久富以往富有成效的核心企业评价体系，以“具备核心竞争力、能够在市场中获取超额收益的企业”为主，构建均衡的投资组合。

#### 1、资产配置策略

本基金为混合型基金，对于股票、债券、现金及其他金融产品等大类资产的配置策略，主次分明，以股票为主。基于对各类资产风险收益水平的分析，结合主要投资对象—具备核心竞争力上市公司持续成长能力及估值水平，参考基金流动性要求，在重点投资于具备持续成长能力与获取超额利润能力的优势企业的前提下实现大类资产配置，以求基金资产在股票、债券及短期金融工具的投资中实现风险和收益的最佳匹配。

#### 2、股票投资策略

本基金的股票投资策略将立足于公司的估值体系，在平衡市场总体估值水平的基础上，将重点投资于具备核心竞争力的持续成长型企业，强调对公司核心竞争力的判断，及核心竞争力所拥有的超额收益能力的评估。同时适度兼顾因行业发展、重组购并等要素的变化而导致的估值调整所带来的阶段性机会；对于新经济、新业务模式等创新型公司依据供求关系、市场地位、发展前景给予一定估值弹性；对于主题类资产则重点把握市场心理与企

业重估的实质性基础。股票组合构建所追求的目标是双高：高 $\alpha$ 、高夏普比率。

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

### 3、基金操作策略

本基金的操作策略核心有二，一是保持组合获得超额收益的能力，主要在于股票类资产的操作倾向于长、中、短期类目标的处理，其中长期类资产依据估值水平的变化调整权重，而中、短期类资产的选择是为了发掘新的长期投资目标。二是降低组合的风险系数，保持组合均衡，主要通过行业配置、主题配置、持股集中度的调整以及均值偏离度的评估等操作来保持组合的均衡，降低组合的风险。

### 4、债券及短期金融工具投资策略

本基金认为股票市场投资风险较大时，将择机把部分股票资产转换为债券资产以获取较稳定的收益。由于目前中国债券市场仍处于制度完善与规则建立的发展阶段，本基金采取组合久期控制下的主动性投资策略，结合收益率曲线选择有利投资品种，构建债券投资组合，并综合运用久期控制、期限结构配置、跨市场套利、相对价值判断和信用风险评估等管理手段实现债券组合的动态优化调整。

### 5、衍生金融工具套利和风险锁定策略

本基金在进行权证等金融工具投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。对于其他金融衍生产品则以控制风险为目标，作为主动型基金将始终保持较高的股票投资仓位，金融衍生产品将会是本基金锁定风险的工具，但不作为投资目标。

### (五)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $75\% \times$ 沪深300指数收益率 $+25\% \times$ 中证综合债指数收益率。

沪深300指数选择中国A股市场中市值规模最大、流动性强和基本因素良好的300家上市公司作为样本股，充分反映了A股市场的行业代表性，描述了沪深A股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证综合债指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券整体走势的跨市场债券指数，该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。基于本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

### (六)风险收益特征

本基金是较高预期收益较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金，但低于股票基金。

### (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) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
- (6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (8) 依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

## 2、基金投资组合比例限制

- (1) 持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;
- (2) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的 10%,并按有关规定履行信息披露义务;
- (3) 本基金股票投资比例为 60%-95%;
- (4) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
- (5) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不展期;
- (6) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%;
- (7) 基金的投资组合中保留的现金或者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%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款;
- (8) 权证投资比例遵照相关法律法规的规定执行;
- (9) 资产支持证券投资比例遵照相关法律法规的规定执行;
- (10) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;
- (11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
- (12) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
- (13) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;
- (14) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

3、法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

(八) 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 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除第（七）条第 2 款的第（7）、（11）、（12）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

(九) 基金管理人代表基金行使股东权利或债务权利的处理原则及方法

1、不谋求对所投资企业的控制或者进行管理；

2、依照《民法通则》、《民事诉讼法》、《企业破产法》、《基金法》及其他法律法规的有关规定行使有关权利。所有参与均以在合法合规的前提下维护基金投资人利益并谋求基金财产的保值和增值为目标。

(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。

本基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于2022年8月24日复核了投资组合报告，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 2022 年 6 月 30 日，本报告中财务资料未经审计。

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	1,859,173,146.77	90.53
	其中：股票	1,859,173,146.77	90.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	184,945,796.98	9.01
8	其他资产	9,474,500.46	0.46
9	合计	2,053,593,444.21	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比
----	------	---------	----------

			例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,736,863,447.36	86.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	64,386,984.00	3.19
F	批发和零售业	1,911,800.00	0.09
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	33,642,850.64	1.67
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	22,310,119.29	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	41,711.34	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,859,173,146.77	92.24

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

3、 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 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	300627	华测导航	5,373,311	184,788,165.29	9.17
2	603596	伯特利	1,840,791	147,594,622.38	7.32
3	603208	江山欧派	1,352,575	97,696,492.25	4.85
4	002384	东山精密	3,684,700	84,490,171.00	4.19
5	688065	凯赛生物	742,129	82,970,022.20	4.12
6	600519	贵州茅台	40,100	82,004,500.00	4.07
7	002594	比亚迪	239,258	79,790,150.42	3.96
8	300681	英搏尔	1,327,370	76,682,164.90	3.80
9	002812	恩捷股份	280,435	70,234,945.75	3.48
10	300750	宁德时代	129,068	68,922,312.00	3.42

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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：无。

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：无。

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：无。

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：无。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：无。

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：无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

11、投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内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是否超出基金合同规定的备选股票库

本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	896,828.69
2	应收证券清算款	8,169,064.31



3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	408,607.46
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,474,500.46

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 十三、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

(截止 2022 年 06 月 30 日)

长城久富 (LOF) A

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
自基金合同生效日至 2007 年 12 月 31 日	97.03%	1.82%	64.84%	1.58%	32.19%	0.24%
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	-44.82%	1.90%	-53.36%	2.28%	8.54%	-0.38%
2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	74.35%	1.77%	67.87%	1.54%	6.48%	0.23%
2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2.65%	1.47%	-8.57%	1.19%	11.22%	0.28%
2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	-22.94%	1.13%	-18.35%	0.98%	-4.59%	0.15%
2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	7.96%	1.19%	7.06%	0.96%	0.90%	0.23%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	7.53%	1.21%	-4.97%	1.05%	12.50%	0.16%
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	15.43%	1.15%	40.22%	0.92%	-24.79%	0.23%
2015 年 1	32.95%	2.99%	7.24%	1.87%	25.71%	1.12%

月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-22.61%	1.98%	-7.69%	1.05%	-14.92%	0.93%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	25.08%	0.79%	16.11%	0.48%	8.97%	0.31%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-22.49%	1.35%	-17.72%	1.00%	-4.77%	0.35%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	33.74%	1.24%	27.90%	0.93%	5.84%	0.31%
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	65.84%	1.82%	21.26%	1.07%	44.58%	0.75%
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	34.48%	1.42%	-2.39%	0.88%	36.87%	0.54%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	-6.63%	1.88%	-6.36%	1.09%	-0.27%	0.79%
自基金合 同生效日 至 2022 年 6 月 30 日	458.04%	1.64%	105.28%	1.27%	352.76%	0.37%

长城久富 (LOF) C

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
自基金合 同生效日	12.55%	1.93%	4.40%	1.06%	8.15%	0.87%

至 2022 年 6 月 30 日						
----------------------	--	--	--	--	--	--

注：本基金自2022年3月22日起增设C类基金份额。

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，但投资者购买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，本基金不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 十四、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

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

### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金需按有关规定开立基金专用银行存款账户以及证券账户，上述账户与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

### （四）基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 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范围。
- 4、基金财产的债权债务不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债权债务互相抵消；不同基金财产的债权债务，不得相互抵消。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十五、基金资产估值

### (一) 估值目的

基金财产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，并为基金份额的申购、赎回与转换等提供计价依据。

### (二) 估值日

本基金合同生效后，每工作日对基金资产进行估值。

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、债券等有价证券和银行存款本息等资产。

### (四) 估值方法

#### 1、股票估值方法

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

#### (2) 未上市股票的估值：

1) 首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第(1)条确定的估值价格进行估值。

3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第(1)条确定的估值价格进行估值。

#### 4) 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

① 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第(1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第(1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

② 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第(1)条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(D1-Dr)/D1$$
(FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初始取得成本(因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整)；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交

易所的交易天数，不含估值日当天)。

(3) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

(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) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的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，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值方法

(1) 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 4、资产支持证券估值方法

(1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 5、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财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各因素，可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，对本基金采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

8、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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

9、根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。各类基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式和电子文档报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- 4、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；

5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金管理人应当暂停基金估值；



6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(七) 基金份额净值的计算

$T$ 日各类基金份额净值= $T$ 日该类基金资产净值/ $T$ 日该类基金份额余额

各类基金份额净值的计算，均精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

(八) 估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致任一类基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为该类基金份额净值估值错误。

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财产估值的准确性、及时性。当任一类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；计价错误达到或超过该类基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记人、代理销售机构或投资人自身的原因造成差错，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。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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。

3、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，向责任人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。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，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) 如果因基金管理人原因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，如果因基金托管人原因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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、本基金合同或其他规定，基金管理人或基金托管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，则基金管理人或基金托管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。

#### 4、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，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

(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；

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；

(3) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记人的交易数据的，由基金注册登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(4) 基金管理人及基金托管人计价错误达到基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

#### (九) 特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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，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，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十六、基金的收益与分配

### （一）收益的构成

- 1、买卖证券差价；
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 3、银行存款利息；
- 4、已实现的其他合法收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权；
- 2、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 3、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；
- 4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；
- 5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。
- 6、本基金收益每年最多分配4次，年度收益分配比例不低于可分配收益的40%；
- 7、本基金收益以现金形式分配，但基金份额的持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为相应类别的基金份额；基金份额的持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配方案的确定与公告

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日内在指定媒介公告。

### （五）收益分配中发生的费用

- 1、采用现金分红方式，可从现金红利中提取一定的数额或比例用于支付注册登记手续费。如收取该项费用，具体提取方式在定期更新的招募说明书或公告中规定。
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 十七、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) C类基金份额的销售服务费；
- (4) 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- (5) 基金合同生效以后的信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### 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

本基金年管理费率为 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

##### (2) 基金托管人的基金托管费

本基金年托管费率为 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

##### (3) C类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算方

法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(4) 本条第 1 款第 (4) 至第 (8) 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购费用

本基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式等，请见本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中列明的相关内容。

### 2、赎回费用

本基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式，以及赎回费计入基金财产的比例等，请见本招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”中列明的相关内容。

### 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。

#### ①如转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率

$$\text{转出金额} = \text{转出基金份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$

$$\text{转出基金赎回费} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

$$\text{转入总金额} = \text{转出金额} - \text{转出基金赎回费}$$

$$\text{转入基金申购费补差费率} = \text{转入基金适用申购费率} - \text{转出基金适用申购费率}$$

$$\text{转入基金申购费补差} = \text{转入总金额} - \text{转入总金额} / (1 + \text{转入基金申购费补差费率})$$

$$\text{转入净金额} = \text{转入总金额} - \text{转入基金申购费补差}$$

$$\text{转入份额} = \text{转入净金额} / \text{转入基金当日基金份额净值}$$

$$\text{基金转换费} = \text{转出基金赎回费} + \text{转入基金申购费补差}$$

#### ②如转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率

$$\text{基金转换费用} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

(2) 转出基金赎回费的 25% 计入转出基金资产（基金合同或招募说明书另有规定的除外）。

(3) 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，但最迟应在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(三) 不列入基金费用的项目

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

(四) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(五) 其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

(六) 税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十八、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日，如果基金成立少于2个月，可以并入下一个会计年度。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计制度按国家有关的会计制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应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，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意；
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。基金管理人应在更换会计师事务所后在2日内公告。

## 十九、基金的信息披露

### （一）披露原则

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

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

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，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。

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

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

### （二）基金相关信息披露

1、基金管理人应当在集中申购的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

#### 2、集中申购公告

基金管理人应当就集中申购的具体事宜编制集中申购公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和指定网站上。

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

4、基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明



书。

#### 5、基金产品资料概要

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

#### 6、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

### （三）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规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的规定单独编制，由基金托管人复核。基金定期报告，包括基金年度报告、中期报告和基金季度报告。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2、中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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、中期报告或者年度报告。

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

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

### （四）基金净值信息

1、基金合同生效后，基金管理人应当在不晚于每个交易日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露交易日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

2、基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和

年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

#### (五) 临时报告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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及决定的事项；
- 2、基金终止上市交易、基金合同终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金集中申购期的延长或提前终止；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、某一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；
- 17、基金开始办理申购、赎回；
- 18、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、调整本基金份额类别设置；

24、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （六）澄清公告

在基金合同期限内，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，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### （七）中国证监会规定的其他信息

#### （八）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，指定专门部门及高级管理人员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等法规的规定。

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、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介和基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

#### （九）信息披露文件的存放与查阅

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

## 二十、风险揭示

### (一) 市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，进而使基金收益水平发生变化，使基金运作客观上面临一定的市场风险，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、产业政策、地区发展政策发生变化，导致证券市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

#### 2、经济周期风险

随着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，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、购买力风险

若发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而导致基金的实际投资收益率下降。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受公司经营决策、技术更新、新产品研究开发、行业竞争、管理团队、人员素质等多种因素的影响。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、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。基金投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

### (二) 管理风险

在基金管理过程中，可能由于基金管理人经济形势、证券市场的判断有偏或获取的信息不完全等因素，导致影响本基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术也可能对本基金的收益水平造成一定的影响。

### (三) 流动性风险

基金投资中会因市场流动性相对不足或投资者大额赎回等原因面临流动性风险，使证券交易的执行难度提高，证券买入成本或变现成本增加，对基金净值产生影响。

我国股票市场在大幅下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果这时出现较大规模的基金赎回申请，可能造成基金仓位调整和资产变现困难，基金将面临流动性风险。

### (四) 信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金财产损失。

#### (五) 技术风险

在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

#### (六) 上市交易的风险

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

#### (七) 其他风险

1、自然灾害、战争等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，导致基金财产的损失，从而带来风险；

2、金融市场危机、行业竞争等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人的利益受损；

3、其他意外导致的风险。

4、本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

5、本基金资产有可能投资于科创板股票。科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块存在差异，基金投资科创板股票的风险包括但不限于：

##### 1) 科创板企业退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快，退市情形更多，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节。一旦所投资的科创板股票进入退市流程，将面临退出难度较大、成本较高的风险。

##### 2) 市场风险

科创板企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生

物医药等高新技术和战略新兴产业领域，大多数企业为初创型公司，上市门槛略低于 A 股其他板块，企业未来盈利、现金流、估值等均存在不确定性，个股投资风险加大。此外，科创板企业普遍具有前景不确定、业绩波动大、风险高的特征，市场可比公司较少，估值与发行定价难度较大。

同时，科创板竞价交易较主板设置了更宽的涨跌幅限制(上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%)、科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

### 3) 流动性风险

科创板投资门槛较高，由此可能导致整体流动性相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

### 4) 集中度风险

科创板为新增板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

### 5) 监管规则变化的风险

科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，导致基金投资运作产生相应调整变化。

## 二十一、基金的终止与清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （二）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

#### 3、清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）基金清算组作出清算报告；
- （6）会计师事务所对清算报告进行审计；
- （7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （8）将基金清算结果报告中国证监会；
- （9）公布基金清算公告；
- （10）对基金剩余财产进行分配。

#### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- (1) 支付基金财产清算费用；
- (2) 缴纳基金所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 6、基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十二、基金合同的内容摘要

以下内容摘自《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）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) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- 2) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- 3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- 4) 根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费；
- 5) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
- 6) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它法律法规规定的费用；
- 7) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 8) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- 9) 自行担任基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记手续，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- 10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- 11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；
- 12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
- 13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
- 14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- 15) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- 16) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
- 18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

(2) 基金管理人的义务

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

2) 办理基金备案手续；

3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

7) 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资产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；

9) 接受基金托管人依法进行的监督；

10) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

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，应予以保密，不得向他人泄露；

13) 按基金合同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) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

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

17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

19) 编制基金季度报告、中期报告和年度报告；

20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

- 21) 组织并参加基金财产清算组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 22) 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;
- 23) 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的合法权益, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- 24) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
- 25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动;
- 26) 公平对待所管理的不同基金, 防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资源分配;
- 27) 以基金管理人的名义, 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;
- 28) 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) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费;
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的, 不予执行并向中国证监会报告;
- 4) 在基金管理人职责终止时, 提名新的基金管理人;
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会;
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人, 如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的, 应及时呈报中国证监会和中国银监会, 以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;
- 7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

### 2、基金托管人的义务

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产;
- 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资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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

4) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外, 不以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;

7) 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;

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

9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值及基金份额申购、赎回价格;

10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

11) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 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, 还应说明基金托管人是否采取了适当的措施;

12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料, 保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上;

13) 根据有关法律法规, 建立并保存基金份额持有人名册;

14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回、基金转换转出款项;

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

17) 按照规定监督基金管理人的投资运作;

18) 参加基金财产清算组, 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、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会和银行监管机构, 并通知基金管理人;

20) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 基金托管人应为基金向基金管理人追偿;

21) 因违反基金合同导致基金财产的损失, 应承担赔偿责任, 其责任不因其退任而免除;

22) 不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动;

23) 法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人权利和义务

#### 1、基金份额持有人的权利

- 1) 分享基金财产收益;
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- 7) 监督基金管理人的投资运作;
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

#### 2、基金份额持有人的义务

- 1) 遵守基金合同;
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用;
- 3) 在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动;
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;

- 7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

#### (四) 基金持有人大会

1、本基金的基金份额持有人大会,由本基金的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。

2、有以下事由情形之一时,应召开基金份额持有人大会:

- (1) 终止基金合同;
- (2) 转换基金运作方式;
- (3) 更换基金托管人;
- (4) 更换基金管理人;
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准或提高销售服务费率的除外;

- (6) 本基金与其它基金的合并;
- (7) 变更基金类别;
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略;
- (9) 变更基金份额持有人大会程序;

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

3、以下情况不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费率、基金托管费率；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率、调低销售服务费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 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；
- (6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

4、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

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

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

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

(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。

## 5、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，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

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

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

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

## 6、基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或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。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

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

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，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变。

## 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

④ 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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，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变。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超



出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将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进行解释和说明。

程序性。大会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。

4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

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

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

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

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 8、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除下小项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及代理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、转换基金运作方式、终止基金合同、本基金与其他基金合并等重大事项必须以特别决议方式通过。

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

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(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。

## 9、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如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代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

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参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人，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。

## 10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

(1) 基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

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

(3) 基金份额持有人大会决定的事项应当自表决通过之日起 5 日内报中国证监会备案, 并予以公告。

#### (五) 基金合同的变更、终止与基金资产的清算

##### 1、基金合同的变更

(1) 基金合同变更涉及本基金合同第十节第(二)项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的, 应经基金份额持有人大会决议同意。关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决定的事项应依法报中国证监会备案并在指定媒介公告。

(2) 除上述第(1)项规定的情形外, 经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更, 该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

##### 2、基金合同的终止

有下列情形之一的, 本基金合同终止:

- (1) 基金份额持有人大会决定终止;
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止, 在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的;
- (3) 因重大违法、违规行为, 被中国证监会责令终止的;
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

##### 3、基金财产的清算

(1) 基金合同终止, 应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

##### (2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组, 在基金财产清算组接管基金财产之前, 基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

##### (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止后, 由基金财产清算组统一接管基金财产;
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限;
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认;

- 4) 对基金财产进行评估和变现;
- 5) 基金清算组作出清算报告;
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计;
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会;
- 9) 公布基金清算公告;
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用;
- 2) 缴纳基金所欠税款;
- 3) 清偿基金债务;
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (6) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### (六) 争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、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首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

(七)基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 二十三、基金托管协议的内容摘要

以下内容摘自《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》。

### （一）基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

办公地址：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

法定代表人：王军

注册时间：2001年12月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字[2001]55号

注册资本：人民币壹亿伍仟万元

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

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

#### 2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987年3月30日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发[1987]40号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.62亿元人民币

组织形式：股份有限公司

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

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

根据《基金合同》的约定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票（含存托凭证）、债券、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出以上范围的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在10个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在10个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在10个工作日内纠正。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

(1) 本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基金总资产60%—95%，债券占基金总资产0%—35%，权证投资占基金资产净值0%—3%。本基金股票资产中，不低于80%的资金将投资于具有核心成长优势的上市公司发行的股票。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。

(2) 本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款；

(3) 持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

(4) 本基金与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%，并按有关规定履行信息披露义务；

(5) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(6) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

(7) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

(8) 权证投资比例遵照相关法律法规的规定执行；

(9) 资产支持证券投资比例遵照相关法律法规的规定执行；

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

司可流通股票的 30%;

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

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

(13) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行, 与境内上市交易的股票合并计算;

(14) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第 (2)、(11)、(12) 项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的, 基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时, 本基金不受上述投资组合限制并相应修改其投资组合限制规定。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出有关法律法规的规定及基金合同的约定的基金投融资比例限制的行为, 应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的, 基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为, 应立即报告中国证监会, 同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金投资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

(1) 承销证券;

(2) 向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额, 但是国务院另有规定的除外;

(5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

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

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8) 依照法律、行政法规有关规定, 由中国证监会规定禁止的其他活动。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定, 基金合同生效后 2 个工作日内, 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者与本机构有其他重大

利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

基金托管人发现基金管理人以上投资禁止行为的，应及时以书面形式通知基金管理人在10个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在10个工作日内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在10个工作日内纠正。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，基金托管人于收到名单后2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，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，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

(3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。



基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,应拒绝结算,并立即报告中国证监会,同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

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

(2) 此处流通受限证券与上文所述的流动性受限资产并不完全一致,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前,向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票,基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

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

(5) 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核,基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因切实履行监督职责而拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

7、基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资其他方面进行监督。

8、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、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、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行为进行监督和核查。

9、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，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。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在 10 个工作日内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并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、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，并及时向中国证监会报告。

### （三）基金管理人应对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人应对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户/证券账户和债券托管账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在 10 个工作日内纠正，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 10 个工作日内，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 10 个工作日内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

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在 10 个工作日内纠正。

#### （四）基金财产的保管

##### 1、基金财产保管的原则

- （1）基金托管人应安全保管基金财产。
- （2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- （3）基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。
- （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和独立。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；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。

对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金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。基金托管人对此不承担任何责任。

##### 2、基金的银行账户的变更和管理

- （1）基金托管人应负责本基金的银行账户的变更和管理。
- （2）基金托管人以本基金的名义变更原封闭式基金银行账户的资料。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《中华人民共和国票据法》、《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。
- （5）基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户、及时核查基金银行存款账户余额。

##### （6）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。

### 3、基金证券交收账户、资金交收账户的变更和管理

(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变更基金证券账户的资料。

(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和未经另一方同意擅自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) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户（即基金交收账户），用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金名义在托管清算系统中为本基金开立二级清算备付金账户。

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

### 4、债券托管账户的变更和管理

《基金合同》生效后，基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司变更基金银行间债券市场债券托管账户的资料，并向中国人民银行报备。

基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

### 5、基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入登记结算机构的代保管库，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。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

### 6、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金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，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，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，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## (五) 基金资产净值计算和会计核算

### 1、基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日该类基金资产净值除以计算日该类基金总份额后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核盖章后，将复核结果以加密传真通知基金管理人，由基金管理人各类基金份额净值予以公布。待条件成熟后，双方可协商采用电子对账方式。

本基金按以下方法估值：

(1) 股票估值方法

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 未上市股票的估值：

①首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

②首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第1)条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第1)条确定的估值价格进行估值。

④非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

I 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1)条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本时，采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

II 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1)条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr)/D1$  (FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初始取得成本(因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整)；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天)。

3) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易的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，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## (3) 权证估值方法

1) 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## (4) 资产支持证券估值方法

1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 全国银行间市场交易的资产支持证券, 根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(5) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(6) 在任何情况下, 基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如基金管理人认为上述估值方法对基金财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各因素, 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。

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, 发现方应及时通知对方, 以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值, 以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》, 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, 基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

## 2、净值差错处理

当发生净值计算错误时, 由基金管理人负责处理, 由此给基金份额持有人和基金造成损失的, 由基金管理人先行对基金份额持有人或者基金支付赔偿金。基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任, 经确认后按以下条款进行赔偿。

(1) 如采用本协议第八章“基金资产估值、基金资产净值计算与复核”中估值方法的第(1) — (5) 进行处理时, 若基金管理人净值计算出错, 基金托管人在复核过程中没有发现, 且造成基金份额持有人损失的, 由双方共同承担赔偿责任, 其中基金管理人承担 70%, 基金托管人承担 30%;

(2) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果, 虽然多次重新计算和核对, 尚不能达成一致时, 为避免不能按时公布基金份额净值的情形, 以基金管理人的计算结果对外公布, 由此给基金份额持有人和基金造成的损失, 由基金管理人负责赔付;

(3) 基金管理人、基金托管人按本协议第八章“基金资产估值、基金资产净值计算与复核”中估值方法的第(6) 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于交易所及登记结算公司发送的数据错误, 有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误的, 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。

针对净值差错处理, 如果法律法规或证监会有新的规定, 则按新的规定执行; 如果行业有通行做法, 在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下, 相关各方当事人应本着

平等互利的原则重新协商确定处理原则。

### 3、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### 4、会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### 5、基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会公布的《证券投资基金信息披露管理办法》要求公告。季度报表的编制，应于季度结束之日起 15 个工作日内完成；《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。中期报告在上半年结束之日起两个月内公告；年度报告在每年结束之日起三个月内公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人；基金托管人在 5 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在更新招募说明书完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到 15 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 20 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人，基金托管人在收到后 30 个工作日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

### （六）基金份额持有人名册的保管



基金管理人可委托基金注册登记人登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于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、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记人负责编制和保管，并对持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。基金托管人无法妥善保存持有人名册的，依法承担相应的责任。

#### （七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中华人民共和国法律管辖。

#### （八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### 1、基金托管协议的变更

本协议相关各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，应报中国证监会核准。

##### 2、基金托管协议的终止

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

（4）发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

##### 3、基金财产的清算

（1）基金财产清算组

在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

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

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

#### (2) 基金财产清算程序

- 1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金清算组作出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

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

#### (4) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### (5) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。基金财产清算组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十四、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）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

## 二十五、其他应披露事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-21
2	长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF) 暂停大额申购、转换转入和定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-22
3	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-09
4	长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF) 收益分配公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-17
5	关于调整旗下部分基金最低赎回份额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-15
6	长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF) 收益分配公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-15
7	长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)恢复大额申购、转换转入和定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-20
8	长城基金管理有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-30
9	长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-04
10	长城基金管理有限公司关于终止杭州科地瑞富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-11
11	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-13
12	长城基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
13	关于长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF) 增设基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-21
14	长城基金管理有限公司关于上海分公司变更负责人的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-20
15	长城基金管理有限公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-21
16	长城基金管理有限公司深圳分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-21
17	长城基金管理有限公司关于北京分公司变更负责人的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-23

18	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	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
19	长城基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-18
20	长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-30
21	长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-01
22	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-08
23	长城基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-14
24	在本报告期内刊登的其他公告		

## 二十六、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构的办公场所以及相关网站，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本招募说明书复印件，但应以正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十七、备查文件

- (一) 久富证券投资基金基金份额持有人大会决议公告
- (二) 中国证监会核准久富证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件
- (三) 《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- (四) 《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- (五) 法律意见书
- (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) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在本基金管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复制件或复印件。

长城基金管理有限公司  
2022年8月31日