

# 长盛货币市场基金 基金合同

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

## 目录

一、	前言	1
二、	释义	2
三、	基金的基本情况	6
四、	基金份额的发售	8
五、	基金的备案	10
六、	基金份额的申购与赎回	11
七、	基金合同当事人	18
八、	基金份额持有人大会	25
九、	基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	32
十、	基金的托管	34
十一、	基金的销售与服务代理	35
十二、	基金份额的登记	36
十三、	基金的投资	37
十四、	基金的财产	46
十五、	基金资产估值	47
十六、	基金的费用与税收	53
十七、	基金的收益与分配	56
十八、	基金的会计与审计	59
十九、	基金的信息披露	60
二十、	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	65
二十一、	违约责任	67
二十二、	争议的处理	68
二十三、	《基金合同》的效力	69
二十四、	基金合同存放地点和查询办法	70
二十五、	其他事项	71
二十六、	基金合同摘要	72

## 一、 前言

为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范基金运作，依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《货币市场基金监督管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的基础上，订立《长盛货币市场基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）。

本基金合同是规定本基金合同当事人之间权利义务的基本法律文件。本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。基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者依本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所有条款和条件的承认和接受。本基金合同的当事人按照《基金法》、《运作办法》、《管理办法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

长盛货币市场基金（以下简称“本基金”）由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《管理办法》、本基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于基金没有风险。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。

基金管理人保证依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

## 二、 释义

本基金合同中，除非文意另有所指,下列词语具有如下含义:

- 1、基金或本基金：指依据《基金合同》所设立的长盛货币市场基金
- 2、基金合同、本基金合同：指《长盛货币市场基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
- 3、招募说明书：指《长盛货币市场基金招募说明书》及根据法律法规所作的更新
- 4、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛货币市场基金基金托管协议》
- 5、基金产品资料概要：指《长盛货币市场基金基金产品资料概要》及其更新
- 6、份额发售公告：指《长盛货币市场基金份额发售公告》
- 7、《证券法》：指《中华人民共和国证券法》
- 8、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》
- 9、《运作管理办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》
- 10、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
- 11、《管理办法》：指《货币市场基金监督管理办法》
- 12、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日起实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、中国银监会：指中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体
- 16、基金管理人：指长盛基金管理有限公司
- 17、基金托管人：指兴业银行股份有限公司
- 18、基金销售代理人：指依据有关代理销售协议办理本基金申购、赎回

和其它基金业务的代销机构

- 19、 基金注册登记机构: 指长盛基金管理有限公司
- 20、 个人投资者: 指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
- 21、 机构投资者: 指经有关政府部门批准设立并在中国境内合法注册的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织
- 22、 基金账户: 指基金注册登记机构为投资者开立的记录其持有长盛基金管理有限公司所管理的开放式基金的基金权益和客户资料情况的账户
- 23、 《基金合同》生效日: 指本基金依《基金合同》规定的条件募集, 达到《基金合同》生效条件, 并由基金管理人依照《基金法》的规定向中国证监会办理基金备案手续, 并获得中国证监会书面确认之日
- 24、 《基金合同》终止日: 指《基金合同》规定的终止事由出现后按照《基金合同》规定的程序清算完毕, 清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
- 25、 募集期: 指自基金份额开始发售之日起计算, 最长不超过3 个月的期限。基金募集期的具体起止日期将在本基金的发售公告中列明
- 26、 存续期: 指《基金合同》生效日至《基金合同》终止日之间的不定期期限
- 27、 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
- 28、 开放日: 指为基金投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
- 29、 T 日: 指日常申购、赎回或其它交易的申请日
- 30、 T+n日: 指自T 日起第n 个工作日
- 31、 元: 指人民币元
- 32、 认购: 指在基金募集期内, 基金投资者购买本基金基金份额的行为
- 33、 申购: 指在本基金合同生效后, 投资人申请购买本基金份额的行为
- 34、 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基金份额的行为
- 35、 销售服务费用: 指本基金用于持续销售和服务基金份额持有人的费用。本基金对基金份额计提销售服务费, 该笔费用从基金资产中扣除, 属于基

金的营运费用

36、 摊余成本法：指计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法摊销，每日计提收益

37、 每万份基金份额净收益：指每万份基金份额的日净收益或者每万份基金份额净收益累计值

38、 基金七日年化收益率：指以最近七日（含节假日）收益所折算的年化收益率

39、 基金份额分类：本基金将分设四类基金份额：A类基金份额、B类基金份额、D类基金份额、E类基金份额。四类基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费或设置不同的收益支付方式并分别公布每万份基金份额净收益和七日年化收益率

40、 A类基金份额：指按照0.25%年费率计提销售服务费且收益支付方式为按月支付的基金份额类别

41、 B类基金份额：指按照0.01%年费率计提销售服务费且收益支付方式为按月支付的基金份额类别

42、 D类基金份额：指按照0.25%年费率计提销售服务费且收益支付方式为按日支付的基金份额类别

43、 E类基金份额：指按照0.01%年费率计提销售服务费且收益支付方式为按日支付的基金份额类别

44、 升级：指当投资人在单个基金账户保留的A类基金份额达到B类基金份额的最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资人在该基金账户保留的A类基金份额全部升级为B类基金份额；D类基金份额和E类基金份额不进行基金份额升级

45、 降级：指当投资人在单个基金账户保留的B类基金份额不能满足该类基金份额的最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资人在该基金账户保留的B类基金份额全部降级为A类基金份额；D类基金份额和E类基金份额不进行基金份额降级

46、 基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券差价、银行存款利

息以及其它收益

47、 基金资产总值：指基金所购买的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其它投资所形成的价值总和

48、 基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值

49、 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单位基金份额资产净值的过程

50、 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）、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

51、 基金销售网点：指基金管理人的直销网点及基金销售代理人的代销网点

52、 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

### 三、 基金的基本情况

(一) 基金名称：长盛货币市场基金

(二) 类别：货币市场基金

(三) 运作方式：契约型开放式

(四) 基金的投资目标：在保持本金低风险的前提下，力求实现高流动性和高于业绩比较基准的收益

(五) 存续期限：不定期

(六) 最低募集份额总额：本基金的最低募集份额总额不少于两亿份

(七) 基金份额面值与认购费用：每份基金份额面值为人民币1元；本基金不收取认购费用

(八) 基金份额净值：本基金的基金份额净值按照开放日收市后基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算。本基金采用摊余成本法估值，通过每日计算收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币1.00元。

(九) 基金份额类别设置

#### 1、基金份额分类

本基金根据销售服务费和收益支付方式的不同进行基金份额类别划分。本基金A类和B类两类基金份额的收益支付方式均为按月支付，但按照不同的费率计提销售服务费；本基金D类基金份额和E类基金份额的收益支付方式均为按日支付，但按照不同的费率计提销售服务费。四类基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

#### 2、基金份额类别的限制

投资者可自行选择申购的基金份额类别，不同基金份额类别之间不得互相转换，但依据招募说明书约定因申购、赎回、基金转换等交易而发生基金份额自动升级或者降级的除外。

本基金A类、B类、D类、E类基金份额的金额限制具体见招募说明书。基金管理人可以在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整申购各类基金份额的具体限制。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。

### 3、基金份额的升降级

本基金 A 类、B 类基金份额升降级的数量限制及规则，由基金管理人在招募说明书中规定。D类基金份额和E类基金份额不进行基金份额升降级。

在对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可以调整基金份额升降级的数量限制及规则等，并在调整实施前依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可根据基金实际运作情况，经与基金托管人协商一致并经履行适当程序，在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，增加新的基金份额类别，或取消某基金份额类别，或对基金份额分类办法及规则进行调整，或调整某类基金份额类别的费率等，调整实施前依照《信息披露办法》的规定进行公告，且无需召开持有人大会审议。

## 四、 基金份额的发售

### （一）基金份额的发售

1.发售时间：本基金的发售时间以基金份额发售公告的公告时间为准。本基金募集期自基金份额发售之日起不超过三个月。募集期内，如本基金达到了基金合同第五条第1款规定的基金备案的条件，基金管理人有权决定停止基金发售，基金管理人决定停止基金发售时应就有关情况作出公告，自公告日开始基金管理人可以拒绝接受认购申请。

2.发售方式：本基金采用网下公募方式，包括直销和代销两种途径。

3.发售对象：合格的个人投资者和机构投资者（法律、法规及其它有关规定禁止投资证券投资基金的除外）。

### （二）基金份额的认购和持有限额

#### 1.投资者认购原则

投资者认购前，需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

募集期内，投资者可多次认购基金份额，首次认购最低金额和追加认购最低金额参见本基金的招募说明书或更新后的招募说明书。

投资者的认购申请经受理后，在募集期内不允许撤销。

#### 2.认购费用

本基金不收取认购费用。

#### 3.认购份额的计算

本基金认购份额的计算包括认购金额和认购金额在基金认购期内产生的利息，其中利息以注册登记机构的记录为准。计算如下：

本金认购份额 = 认购金额 / 基金份额面值

利息认购份额 = 利息 / 基金份额面值

认购份额 = 本金认购份额 + 利息认购份额

#### 4.基金认购的规定

##### （1）认购程序

投资人认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续，请详细查阅本基金的基金份额发售公告。

(2) 投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但认购申请一旦被受理，即不得撤销。

(3) 认购确认

销售网点（包括直销中心和代销网点）受理申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

5.首次募集期间认购资金利息的处理方式

有效认购资金的利息在募集期结束时归入投资者认购金额中，折合成基金份额，归投资者所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

6.本基金对单个基金份额持有人持有基金份额没有比例或数量的上限限制。

## 五、 基金的备案

### 1.基金备案的条件

基金备案的条件为：基金募集份额总额不少于两亿份，基金募集金额不少于两亿元人民币，基金份额持有人的人数不少于两百人。

### 2.基金备案的程序

基金备案条件满足后，基金管理人应自募集期限届满之日起十日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告起十日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

### 3.基金合同的生效

本基金合同经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或授权代理人签字，并经中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

### 4.基金合同不能生效时对已募集资金的处理方式

募集期限届满，未达到基金合同生效条件，或募集期内发生使基金合同无法生效的不可抗力，则基金募集失败。

本基金募集失败，基金管理人应当承担下列责任：

- (1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- (2) 在基金募集期限届满后30天内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。
- (3) 基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。

5.本基金合同生效后的存续期内，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。

6.基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 六、 基金份额的申购与赎回

### （一）日常申购与赎回的场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点进行（具体名单见本基金管理人公告或基金管理人网站公示）。投资者可按销售机构提供的交易方式办理基金的申购和赎回。销售代理人或销售代理人的代销网点如有变动，基金管理人将予以公示。

### （二）申购与赎回的开放日及开放时间

1、申购、赎回的开放日：指本基金为投资人办理基金份额申购、赎回等业务的工作日，为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购、赎回时除外）。

#### 2、开放时间：

上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日交易时间，即上午9:30-11:30，下午1:00-3:00。

若未来证券交易市场、证券交易所交易时间更改或根据实际情况需要，基金管理人可以对申购、赎回时间进行调整，在实施前3个工作日在至少一种证监会指定的媒介上刊登公告。

#### 3、申购的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过15个工作日开始办理。

#### 4、赎回的开始时间

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过15个工作日开始办理。

### （三）申购与赎回的原则

1、本基金采用“确定价”原则，即申购、赎回基金份额的价格以1.00元人民币为基准进行计算；

2、本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；

3、投资者在全部赎回本基金份额时，基金管理人自动将投资者账户内待结转的基金收益全部结转并与赎回款一起支付给投资者；投资者部分赎回，且赎回后可用余额足以弥补负的待结转收益的，不进行待结转收益的结转。投资者

部分赎回，且赎回后可用余额不足以弥补负的待结转收益的，进行待结转收益的结转；

4、当日的申购、赎回申请可以在当日交易时间结束以前撤销，在当日的交易时间结束以后不得撤销；

5、本基金管理人可根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则。本基金管理人必须于新规则开始实施之日的3个工作日之前在至少一种中国证监会指定的媒介上刊登公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售代理人规定，在开放时间内提出申购或赎回的申请，并办理有关手续。投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。基金份额持有人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）及注册登记机构必须有足够的基金份额余额，否则会因所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

##### 2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T日晚对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2工作日起到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询；T日申购成功的基金份额T+2个工作日起可以赎回。

##### 3、申购和赎回款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

投资者T日的赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定将赎回款项于T+1日从基金托管账户划出，基金管理人通过各销售机构划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同及招募说明书有关规定处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

##### 1、申购的数额限制

(1) 基金管理人可以规定投资人首次申购和每次申购各类基金份额的最低金额，具体规定请参见招募说明书。

(2) 投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规、中国证监会、本招募说明书另有规定的除外。

(3) 基金管理人可以依照相关法律法规以及基金合同的约定，在特定市场条件下暂停或者拒绝接受一定金额以上的资金申购，具体以基金管理人的公告为准。

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

(5) 根据市场情况，基金管理人可以调整认（申）购基金份额的最低金额限制，基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒介上刊登公告。

## 2. 赎回数额的限制

本基金基金管理人可以规定投资人每次赎回各类基金份额的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

## 3. 在销售机构保留的基金份额最低数量限制

本基金基金管理人可以规定投资人保留的各类基金份额的最低份额，具体规定请参见招募说明书。

## (六) 申购与赎回份额的计算方式

### 1、本基金申购份额的计算：

申购份额 = 申购金额 / 每基金份额申购价格

申购份额计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

### 2、本基金赎回金额的计算：

(1) 一般情况下，赎回金额 = 赎回份额 × 每基金份额赎回价格

(2) 发生收取强制赎回费的情形下，赎回金额的计算公式如下：

赎回费用 = (赎回份额 - T日本基金总份额 × 1%) × 每基金份额赎回价格 × 1%

赎回金额 = 赎回份额 × 每基金份额赎回价格 - 赎回费用

赎回金额计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

(七) 申购与赎回的价格、费用

- 1、本基金申购、赎回基金的单位价格以1.00元人民币为基准进行计算；
- 2、除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金的申购费用和赎回费用均为零。

3、如发生下列情形之一：

(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时；

(2) 当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时；

基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

(八) 拒绝或暂停申购与赎回的情况与处理

1、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人不能接受申购；
- (2) 证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 基金资产规模过大，使基金管理人认为继续扩大基金规模会影响基金投资业绩，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或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响的某笔申购；
- (5) 当影子定价法确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到0.5%时；
- (6) 接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额50%以上时；



(7) 当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

(8) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人立即在指定媒介上刊登暂停公告。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

(2) 证券交易所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(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时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；

(4) 基金管理人无正当理由认为需要暂停接受基金赎回申请的；

(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确认后，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请；

(6) 法律、法规规定或经中国证监会批准或基金合同约定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在指定媒介上刊登公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分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金额。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. 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介公告。

4. 单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额10%的，基金管理人可以采取延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的措施。

(九) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的情形及处理方式

### （1）巨额赎回的认定

若一个工作日内的基金份额净赎回申请（赎回申请总数扣除申购申请总数后的余额）超过上一日基金份额总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

### （2）巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人将根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的赎回申请时，将按正常赎回程序处理投资人赎回申请。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为没有能力全部兑付投资人的赎回申请或全部兑付投资人的赎回申请可能对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在不低于上一日基金总份额的10%，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，直至将申请赎回份额全部赎回为止。投资人在申请赎回时有权对当日未获受理部分份额选择延迟赎回或放弃延迟赎回。

3) 若本基金发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人单日的赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%以上的情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的部分进行自动延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日，并与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权，以此类推，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作延期赎回处理。

4) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人应通过指定媒介、基金管理人的公司网站或代销机构的网点在3个交易日内刊登公告，并说明有关处理方法。

## 2、连续巨额赎回成立的条件及处理方式

### （1）连续巨额赎回的认定

本基金连续三个开放日发生巨额赎回，为连续巨额赎回。

(2) 连续巨额赎回的处理方式

发生连续巨额赎回时，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，但延迟支付时间不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

(十) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个工作日的各类基金份额的每万份基金净收益和基金七日年化收益率。

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1个工作日在至少一种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各类基金份额的每万份基金净收益和基金七日年化收益率。

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；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。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个工作日在至少一种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工作日的各类基金份额的每万份基金净收益和基金七日年化收益率。

## 七、 基金合同当事人

### （一）基金管理人

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼10D

办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心3层

法定代表人：胡甲

成立时间：1999年3月

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】6号

组织形式：有限责任公司

注册资本：20600万元

存续期间：持续经营

### （二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路167号

法定代表人：吕家进

注册日期：1988年7月20日

注册资本：207.74亿元人民币

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74号

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

### （三）基金份额持有人

基金投资人自取得依本基金合同所发行的基金份额，即成为基金份额持有人，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。基金份额持有人成为本基金合同的当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。

### （四）基金管理人的权利与义务

#### 1.基金管理人的权利

- (1) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金资产；
- (2) 根据本基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、质押、收益分配等方面的业务规则；
- (3) 根据法律法规和本基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，亲自或委托其他机构向投资者收取事先公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；
- (4) 根据本基金合同规定销售基金份额；
- (5) 提议召开基金份额持有人大会；
- (6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (7) 依据本基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定，并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银行监管机构，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取其它必要措施保护基金投资者的利益；
- (8) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金销售代理人的作为或不作为违反了法律法规、本基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、本基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益；
- (9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (10) 自行担任基金注册登记代理机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册与过户登记业务，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；
- (11) 根据国家有关规定在法律法规允许的前提下依法为基金融资；
- (12) 依据本基金合同的规定，决定基金收益的分配方案；
- (13) 按照《基金法》、《运作办法》、《管理办法》代表基金行使因投资于证券所产生的权利；
- (14) 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；

(15) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2.基金管理人的义务

(1) 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；

(2) 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；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(5) 依法接受基金托管人的监督；

(6) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(7) 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；按照规定计算基金资产净值，并公告各类基金份额的每万份基金份额净收益和基金七日年化收益率；

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

(9) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项和分红款项；

(10) 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；

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

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

(13) 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；

(14) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

(15) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

(16) 对所管理的不同基金资产分别设账、进行基金会计核算，编制基金的财务会计报告；

(17) 保管基金的会计账册、报表、记录15年以上；

(18) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；

(19) 保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(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所在地中国证监会派出机构并通知基金托管人；

(21) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(22) 公平对待所管理的不同基金财产；

(23) 负责为基金聘请注册会计师和律师；

(24) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(五) 基金托管人的权利与义务

#### 1.基金托管人的权利

(1) 依照基金合同的约定获得基金托管费和其他法律法规允许或监管部门批准的收入；

(2) 监督基金管理人对本基金的运作，如认为基金管理人违反了基金合同的有关规定，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

(3) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(4) 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；

(5) 法律、法规、基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

#### 2.基金托管人的义务

(1) 遵守《基金法》、《运作办法》、《管理办法》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金资产；

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

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

(4) 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；

(5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

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

(8) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(9) 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；

(10) 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；

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

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

(13) 建立健全内部控制制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产相互独立，保证其托管的基金资产与其托管的其他基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(14) 负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的基金划款指



令，并负责办理基金名下的资金往来；

(15) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的每万份基金份额净收益和基金七日年化收益率；

(16) 采取适当、合理的措施，使本基金的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定，并使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(17) 按规定保存有关基金托管事务的完整记录15 年以上；

(18) 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；

(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中国银监会，并通知基金管理人；

(20) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

(21) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；

(22) 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。

(六) 基金份额持有人的权利与义务

#### 1. 基金份额持有人的权利

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金资产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 依照相关法律法规和本合同的规定，要求召开基金份额持有人大会；

(5) 按相关法律法规的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查询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) 要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制定的其他法律文件的规定履行其义务，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) 在不同的基金直销或代销机构之间转托管；

(10) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件规定的其他权利。

同一类别每份基金份额享有同等的合法权益。

## 2. 基金份额持有人的义务

(1) 遵守基金合同；

(2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；

(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本基金其他当事人利益的活动；

(5) 返还持有基金过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

(6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 八、 基金份额持有人大会

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。基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

### （一）召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有10%以上（不含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）提前终止基金合同；
- （2）基金扩募或延长基金合同期限；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）变更基金类别；
- （5）变更基金份额持有人大会程序；
- （6）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；
- （7）更换基金管理人、基金托管人；
- （8）对基金当事人权利和义务产生重大影响的基金合同修改，但基金合同及法律、法规另有规定的除外；
- （9）《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，不需召开基金份额持有人大会：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）因相应的法律、法规（包括证券监督管理部门的要求，下同）发生变动，必须对基金合同进行修改、变更；
- （3）对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （4）对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （5）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

## （二）召集人和召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，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开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定，在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；

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十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当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（不含10%）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十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%（不含10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起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；

4、代表基金份额10%以上（不含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（不含10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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

## （三）通知时间、内容和方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒介公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

（1）会议召开时间、地点、方式；

- (2) 会议审议事项、议事程序、表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 代理投票委托书送达时间和地点；
- (5) 基金份额持有人出席会议需准备的文件和需履行的手续
- (6) 会务常设联系人姓名、电话；
- (6) 其他注意事项。

2、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。

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议召开方式

- (1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
- (2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
- (3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
- (4) 会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜或转换基金运作方式必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 2、基金份额持有人大会召开条件

###### (1) 现场开会

必须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，有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的50%（不含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

(至少应在15 个工作日后)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) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时, 通讯会议方可举行:

1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后, 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占在权益登记日基金总份额的50%以上(不含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它代表, 同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求, 则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在15 个工作日后), 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。

## (五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容仅限于本基金合同“八、基金份额持有人大会(二)召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项;

(2) 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;

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

1) 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解释和说明;

2) 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。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额10%以上（不含10%）的基金份额持有人召集大会时，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（不含50%）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。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 10 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## (六) 决议形成的条件、表决方式和程序

### 1、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代理人所持表决权的50%（不含50%）以上通过方为有效；除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

(2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、提前终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过

方为有效。

## 2、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

(2) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(3) 对于通讯开会方式的表决，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无效表决。

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

## (七) 计票

### 1、现场开会

(1) 如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选举两名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选举三名代表担任监票人；

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

(3) 如果大会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；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会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，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### 2、通讯方式开会

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

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日



起五日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒介公告。

## 九、 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### （一）基金管理人和基金托管人的更换条件

#### 1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的,可更换基金管理人:

- (1) 被依法取消基金管理资格;
- (2) 经基金份额持有人大会有效决议予以解任;
- (3) 依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产;
- (4) 法律、法规及基金合同规定的其他情形。

#### 2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的,可更换基金托管人:

- (1) 被依法取消基金托管人资格;
- (2) 经基金份额持有人大会有效决议予以解任;
- (3) 依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产;
- (4) 法律法规及基金合同规定的其他情形。

### （二）基金管理人和基金托管人的更换程序

#### 1、基金管理人的更换程序

(1) 提名: 新任基金管理人由基金托管人或代表10%或以上基金份额的基金份额持有人提名, 新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件;

(2) 决议: 基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后六个月内对被提名的基金管理人形成决议;

(3) 备案: 相关基金份额持有人大会决议经中国证监会备案;

(4) 审计: 基金管理人职责终止的, 应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计, 并将审计结果予以公告同时报中国证监会备案;

(5) 交接: 基金管理人职责终止的, 应当妥善保管基金管理业务资料, 及时办理基金管理业务的移交手续, 新任基金管理人或临时基金管理人应当及时接收;

(6) 公告: 基金管理人更换后, 由基金托管人在更换基金管理人的基金份

额持有人大会决议生效后2个工作日内以临时报告书形式进行公告；

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果长盛基金管理有限责任公司或新任基金管理人要求，应按照其要求替换或删除基金名称中的“长盛”字样。

## 2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或代表10%或以上基金份额的基金份额持有人提名，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会或中国银监会规定的资格条件；

(2) 决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后六个月内对被提名的新任基金托管人形成决议；

(3) 备案：相关基金份额持有人大会决议经中国证监会备案；

(4) 审计：基金托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并予以公告，同时报中国证监会备案。

(5) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金托管业务资料，及时办理基金托管业务的移交手续，新任基金托管人或临时基金托管人应当及时接收；

(6) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内以临时报告书形式进行公告。

## 十、 基金的托管

基金托管人与基金管理人必须按照《基金法》、《运作办法》、《管理办法》、本基金合同及有关规定订立《长盛货币市场基金托管协议》。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十一、 基金的销售与服务代理

本基金的认购、申购、赎回及相关的客户服务等业务由基金管理人和基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金上述业务的，应与代理人按照《基金法》、《运作办法》、《管理办法》、本基金合同及其他有关规定就本基金的销售和服务事项签订《长盛货币市场基金销售和服务代理协议》。订立代理协议的目的是为了明确基金销售代理人和基金管理人之间在基金份额认购、申购、赎回以及相关的客户服务等事宜中的权利、义务和职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十二、 基金份额的登记

(一) 本基金份额的注册登记机构由基金管理人担任。

(二) 注册登记机构享有如下权利：

- 1、建立和管理基金投资者基金份额账户；
- 2、取得注册登记费；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、法律法规规定的其他权利。

(三) 注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 3、接受基金管理人的监督；
- 4、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年；
- 5、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
- 6、按本基金合同及招募说明书、更新的招募说明书规定为投资人办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 7、如因注册登记机构的过错而造成持有人损失的，该损失的赔偿责任应该由注册登记机构承担；
- 8、法律法规规定的其他义务。

## 十三、 基金的投资

### （一）投资目标

在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的收益。

### （二）投资范围

本基金将投资于以下金融工具：

- 1、现金；
- 2、期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；
- 3、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；
- 4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

### （三）投资理念

- 1、确保基金投资的低风险特点，力争为投资者保证本金安全

本基金在投资中将严格按照合同规定将投资范围限定在短期债券投资品种上，以持有到期作为主要基金增值手段，力争规避市场价格波动的风险；同时通过滚动期限资产配置策略，控制平均到期期限，实现利率风险最小化的目标；在投资品种选择上，严格控制在高信用等级品种上，力争将信用风险控制最低水平。

- 2、保持基金资产的高流动性

本基金由于定位于一种现金管理工具，将切实保证本基金资产在任何时点上资产都具有较高流动性。在资产管理中，将采用动态期限结构管理的技术，实现基金资产流动性在时间上的均衡，力争实现流动性与收益性的最优化配置。

- 3、在控制风险的前提下，为投资人实现收益最大化

为了给投资人带来最大化收益，实现基金资产的保值增值，本基金在资产管理中将采用现代金融工程技术与数量化分析方法，通过实时计算机化分析系

统，一方面实现资产的动态最优化配置，另一方面及时准确把握市场机会，实现无风险套利。

#### （四）投资策略

##### 1、投资决策依据

（1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。

（2）宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；

（3）策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

##### 2、投资决策程序

###### （1）投资组合计划的拟定

基金管理小组每月月末拟定下月资产配置计划，报投资决策委员会审批。投资组合计划制定的依据未来宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化的研究与分析，以及据此作出的对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率的积极判断，在此基础上基金管理小组制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，并报投资决策委员会审批。投资组合计划是未来一段时间投资的基础与纲领。

如果基金管理小组认为影响各期限、品种收益率的因素产生了重大变化，还可以临时提出新的投资计划，并由投资决策委员会审批。

###### （2）投资计划的实施

基金管理小组在投资委员会通过的投资组合计划规定限制下，根据市场的实际情况，按照投资策略实施步骤，采用积极投资策略，通过动态调整优化投资组合，追求当期收益最大化。在动态调整的过程中，基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征，实现收益与风险的平衡。

在组合调整过程中，基金管理小组将根据未来可预测资金流动状况，合理管理组合现金头寸，保证组合流动性。

###### （3）交易执行

中央交易室负责执行基金管理小组下达的交易指令，同时履行一线监控的职能。在交易指令执行前，中央交易室对交易指令进行复核，确保交易指令执



行后基金各项投资比例符合法律法规以及基金合同、招募说明书的各项规定。

#### （4）组合监控与调整

基金经理与公司的风险管理人员将密切关注宏观经济和市场变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量情况，每日对组合的风险和流动性进行监控，确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平，确保组合的流动性能够满足投资者的赎回要求。当组合中货币市场工具价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时，或当组合中货币市场工具信用评级调整导致信用等级不符合要求时，基金管理小组应采取有效的措施，在合理的时间内调整组合。

### 3、投资管理的方法

本基金在投资组合管理中采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。本基金的核心投资策略由四部分组成：短期市场利率预期策略、期限结构的滚动配置策略、投资组合优化策略、无风险套利操作策略。

#### （1）短期市场利率预期策略

短期利率预期策略是指基金管理人根据对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化作出研究与分析，对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率进行积极的判断，并以此为依据制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，期限结构与品种配置计划是未来一段投资的基础。

#### （2）期限结构的滚动配置策略

为了保证组合资产高流动性，组合资产在到期期限配置上采用滚动配置的策略，即在一个相对固定的投资周期中，将各期限品种的投资均衡分布在不同时间上，从而保证在投资周期内的任何时刻都有稳定的到期现金流，最大限度地提高到期期限约束条件下的流动性。

#### （3）投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下，在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益最大化，约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约

束等。

#### （4）无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同，市场中常常存在无风险套利机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高，无风险套利的机会与收益会不断减少，但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会，基金管理人将贯彻谨慎的原则，充分把握市场无风险套利机会，为投资人带来更大收益。

同时，随着市场的发展、新的货币投资工具的推出，会产生新的无风险套利机会，本基金将加强对市场前沿的研究，及时发现市场中新的无风险套利机会，扩大基金投资收益。

为了保证上述投资策略的顺利实施，基金管理人根据货币市场基金的特点，开发了货币资产组合优化管理系统，以提高投资决策的科学化与实时化。

#### 4、投资品种的选择标准

在上述组合管理的基础上，基金管理小组也将充分重视根据市场形势灵活把握投资品种的主动选择，具有下列一项或多项特征的投资品种是本基金重点投资的对象：

（1）在相似到期期限和信用等级下，收益率较高的债券、票据或债券回购；

（2）相似条件下，流动性较高的债券、票据；

（3）相似条件下，交易对手信用等级较高的债券、票据或债券回购。

#### （五）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率(税后)。

#### （六）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

#### （七）建仓期

本基金管理人自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

#### （八）投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。为了实现投资目标，贯彻投资理念，本基金投资组合遵循下列规定：

1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票；
- (2) 可转换债券、可交换债券；
- (3) 剩余期限超过三百九十七天的债券；
- (4) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；
- (5) 信用等级在AAA 级以下的企业债券；
- (6) 信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；
- (7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、投资组合遵循如下投资限制

(1) 同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；

(2) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过5%。

(3) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(4) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(5) 到期日在10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；

(6) 除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的，基金管理人应在5 个工作日内进行调整；

(7) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天。

(8) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金持有的同一（指同一信用级）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为或相当于AAA以上（含AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(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10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(12) 本基金根据份额持有人集中度情况对本基金的投资组合实施调整，并遵守以下要求：

①当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；

②当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；

(13) 本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%；

(14) 本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；

(15) 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；

(16) 因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使货币市场基金投资不符合上述规定的比例（第（3）、（6）、（7）、（10）、（11）、（15）条除外）或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。但中国证监会规定的特殊情形除外。

(17) 法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 3、投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限计算方法

(1) 平均剩余期限的计算公式

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{期限} + \text{债券正回购} \times \text{期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

(2) 平均剩余存续期限的计算公式

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{期限} + \text{债券正回购} \times \text{期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金、期限在一年以内(含一年)的一年以内(含一年)的银行存款、同业存单、逆回购、中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

### (3) 各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

①银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；

②回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

③银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算；

④中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；

⑤组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

### (九) 禁止行为

本基金禁止以下投资行为：

- 1、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券或进行证券回购；
- 2、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；

- 3、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 7、投资于与基金托管人或基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
- 8、与管理人的股东进行交易，通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数。
- 9、法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

## 十四、 基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金所拥有的各类证券价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其它投资等所形成的资产总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产按有关规定开立基金专用资金账户、证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人和注册登记机构自有的资产账户以及其他基金财产账户严格分开、相互独立。

### （四）基金财产的保管和处分

1、本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、基金销售代理人、注册登记机构以其自有的资产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押或其它权利。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

4、除法律法规、《基金合同》的有关规定处分外，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

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金财产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值计算出的基金份额收益。本基金采用固定份额净值，基金帐面份额净值始终保持为1.00 元。

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

本基金依法持有的银行存款、各类有价证券和应收款项以及其他投资等资产。

### （四）估值方法

本基金估值采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法摊销，每日计提收益或损失。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

1、本基金目前投资工具的估值方法如下：

（1）基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

（2）基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

（3）基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

（4）基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(5) 基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

2、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。即使存在上述情况，基金管理人若采用上述（1）-（5）规定的方法为基金财产进行了估值，仍应被认为采用了适当的估值方法。

3、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。前述情形及处理方法应当履行信息披露义务。

4、如有新增事项，按国家有关法律法规的最新规定估值。

5、采用本估值方法可能对基金资产净值波动带来的影响：适用影子定价法对估值对象进行调整时，调整差额于当日计入基金资产净值，基金资产净值可能产生相应的波动。

6、上述估值方法如有变动，基金管理人将依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

根据有关法律法规，开放式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見，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （六）每万份基金净收益的确认和估值错误的处理

本基金各类基金份额的日每万份基金净收益保留小数点后四位，第五位采用去尾的方式。各类基金份额的基金七日年化收益率以四舍五入的方式保留至百分号内小数点后三位。

当基金资产的估值导致任一类基金份额的每万份基金净收益小数点后4位或基金七日年化收益率百分号内小数点后3位以内发生差错时，视为估值错误。

当基金管理人确认已经发生估值错误情形时，基金管理人应当立即公告并予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金资产净值0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；错误偏差达到基金资产净值的0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。基金合同的当事人应将按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、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者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差

错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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

（5）基金管理人及基金托管人基金资产净值计算错误偏差达到基金资产净值0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金资产净值计算错误偏差达到基金资产净值0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

#### （七）暂停估值的情形

1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金财产价值时；

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

4、中国证监会认定的其他情形。

#### （八）特殊情形的处理

1、基金管理人按估值方法的第2、3项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

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

的措施消除由此造成的影响。

## 十六、 基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

#### 1、与基金运作有关的费用

- （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）基金信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （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。

上述（3）至（7）项费用由基金托管人根据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。基金成立前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

#### 2、与基金销售有关的费用

- （1）基金销售服务费
- （2）基金认购费用

本基金不收取认购费用。

- （3）申购费

本基金不收取申购费用。

- （4）赎回费

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取赎回费用。

如发生下列情形之一：

（1）在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时；

（2）当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个

交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时；

基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

## （二）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0.15%年费率计算。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

M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前两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0.05%的年费率计算。计算方法如下：

$$H=M \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

M为前一日的基金资产净值

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前两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由B类基金份额降为A类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对



于由A类基金份额升级为B类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的销售服务费率。D类基金份额的年销售服务费率为0.25%，E类基金份额的年销售服务费率为0.01%，D类基金份额和E类基金份额不进行基金份额升降级。四类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，计算方法如下：

$H = M \times \text{对应类别的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H为每日该类基金份额应计提的销售服务费

M为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金管理人可以调整销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒介上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构。

### （三）基金管理费、基金托管费和基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须按本基金合同的规定进行公告并办理备案手续。

### （四）不得列入基金费用的项目

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

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十七、 基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

基金收益包括基金投资所得债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

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

### （二）基金收益分配原则

1、本基金的各项基金份额均采用人民币 1.00 元的固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起每日将各类基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，使各类基金份额的基金账面份额净值始终保持1.00 元；基金投资当期亏损时，相应调减持有人持有份额，各类基金份额的基金份额净值始终为1.00 元。

2、本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额的收益分配为“每日分配、按月支付”，根据每日基金收益情况，为 A 类基金份额和 B 类基金份额的投资者每日计算并分配当日收益，每月累计收益支付时采用红利再投资（即红利转基金份额）方式将收益结转为相应类别的基金份额。在每月累计收益支付时若累计收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额；若累计收益为负值，则相应缩减投资者基金份额。

本基金D类基金份额和E类基金份额的收益分配为“每日分配、按日支付”，根据每日基金收益情况，为D类基金份额和E类基金份额的投资者每日计算并分配当日收益，且每日进行支付。每日收益支付时采用红利再投资(即红利转基金份额)方式将收益结转为相应类别的基金份额。在当日收益支付时，若当日收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额；若当日收益为负值，则相应缩减投资者基金份额。

3、基金收益分配采用复利分配的方式，即投资者当日分配的收益，在下一工作日享受收益分配。

4、本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。

5、当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。

在符合相关法律、法规及规范性文件的规定，并且不影响投资者利益情况下，经与基金托管人协商一致并得到批准后，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （三）收益分配方案的确定与公告

1、本基金开放后每工作日公布前一工作日的各类基金份额的每万份基金份额净收益与基金七日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个工作日，披露节假日期间各类基金份额的每万份基金净收益和节假日最后一日各类基金份额的七日年化收益率，以及节假日后首个开放日各类基金份额的每万份基金净收益和七日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

#### 2、计算方法

本基金按日分配收益，基金管理人另行公告。基金收益计算方法为：

（1）各类基金份额的日每万份基金净收益=当日该基金份额的基金净收益/当日该基金份额的基金份额总额×10000；

其中，单个基金账户当日分配的基金收益自其下一工作日起享有分配权益，纳入基金份额总额的计算。

各类基金份额的每万份基金净收益保留至小数点后第4位，第五位舍去。

$$\text{期间每万份基金净收益} = \sum_{w=1}^n (r_w / S_w) \times 10000;$$

其中， $r_1$ 为期间各类基金份额的首日基金净收益， $s_1$ 为期间各类基金份额的首日基金份额总额， $r_w$ 为第 $w$ 日各类基金份额的基金净收益， $S_w$ 为第 $w$ 日各类基金份额的基金份额总额， $r_n$ 为期间最后一日各类基金份额的基金净收益， $S_n$ 为期间最后一日各类基金份额的基金份额总额。

$$\text{(2) 七日年化收益率} = \left\{ \left[ \prod_{i=1}^7 \left( 1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{365/7} - 1 \right\} \times 100\%$$

其中， $R_i$ 为最近第*i*个自然日(包括计算当日)的各类基金份额的每万份基金净收益。

七日年化收益率四舍五入保留至百分号内小数点后第3位。

(3) 法律法规另有规定的，从其规定，基金管理人应当在变动以上计算方式前3个工作日在指定媒介披露。

## 十八、 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；基金募集的会计年度按如下原则处理：如果合同生效至本年度末少于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，记账单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、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、本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所具有证券、期货相关业务资格的注册会计师对基金进行年度审计；
- 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；
- 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，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。更换会计师事务所应在2个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒介上公告。

## 十九、 基金的信息披露

本基金的信息披露严格按照《基金法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其它有关规定进行。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （一）信息披露义务人

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

本基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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”）及互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。指定网站包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。

（二）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （三）公开披露的信息

#### 1、基金募集信息披露

##### （1）基金招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制招募说明书，并在基金份额发售的三日前将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；同时，基金管理人、基金托管人将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

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

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，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。

##### （2）基金份额发售公告

基金管理人就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

##### （3）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

#### 2、基金运作定期信息披露

基金运作信息披露包括年度报告、中期报告、季度报告等定期报告和基金净值收益公告等，由基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》等相关法律法规进行编制，在指定媒介予以公告。

（1）年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载于指定网站上，将年度报告提示性公告登载在

指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

(3) 季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定网站上，将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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

基金管理人应当在本基金年度报告、中期报告中，至少披露报告期末基金前10名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。

(5) 基金的每万份基金净收益和基金七日年化收益率

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露公告一次各类基金份额的每万份基金净收益及七日年化收益率。

在开始办理基金份额申购或者赎回后基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日各类基金份额的每万份基金净收益及七日年化收益率。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的每万份基金净收益及七日年化收益率。

### 3、基金临时信息披露

基金发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载



在指定报刊和指定网站上。

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 终止基金合同、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (7) 基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- (8) 基金募集期延长或提前结束募集；
- (9) 基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- (10) 基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十
- (11) 涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- (12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- (13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- (14) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (15) 当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的正负偏离度绝对值达到0.5%的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值

与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续2个交易日出现负偏离度绝对值超过0.5%的情形；

(16) 开放式基金开始办理申购、赎回；

(17) 开放式基金发生巨额赎回并延期办理；

(18) 开放式基金暂停申购或暂停赎回或重新接受申购、赎回申请；

(19) 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

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

(21) 本基金投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单；

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

#### 4、澄清公告

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

#### 5、清算报告

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

##### (三) 信息披露文件的存放与查阅

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

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 二十、 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

对于基金合同当事人的权利、义务和职责产生重大影响的合同的变更，应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案，自表决通过之日起生效。但如因相应的法律、法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行变更的情形，或者基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，本基金合同终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

2、本基金终止后，须依据法律法规和本基金合同对基金进行清算。清算报告报中国证监会备案并予以公告后本基金合同终止。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算小组

（1）基金管理人应当自基金合同终止之日起30个工作日内组织成立基金财产清算小组。基金财产清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金财产清算小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）基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2、基金财产的清算程序

- (1) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行评估和变现；
- (4) 基金财产清算小组做出清算报告；
- (5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算报告报中国证监会备案；
- (8) 公布基金财产清算公告；
- (9) 对基金财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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小组优先从基金资产中支付。

### 4、基金财产清算后剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后如有余额，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；

清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组公告；

清算过程中的有关重大事项须及时公告；

基金清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后3个工作日内公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存15年以上。

## 二十一、违约责任

（一）由于基金合同一方当事人的过错，造成基金合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属基金合同双方或多方当事人的过错，根据实际情况，双方或多方当事人分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、基金管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或现时有效的法律、法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；

2、在没有过错的情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权利而造成的损失等。

（二）基金合同当事人违反基金合同，给其他方造成直接损失的，应进行赔偿。

（三）基金合同能够继续履行的应当继续履行。未违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要措施，防止损失的扩大。

## 二十二、争议的处理

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，应由各方通过协商予以解决。协商自一方向其他各方发出书面协商通知之日开始。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权就该争议向有管辖权的人民法院提起诉讼。在争议处理期间，除争议事项外，基金合同的其他条款继续全面有效，各方当事人均应遵守、履行。

## 二十三、《基金合同》的效力

（一）基金合同自投资人开始缴纳认购的基金份额的款项时成立，自基金管理人按照相关法律和基金合同的规定向中国证监会办理备案手续并得到中国证监会确认之日起生效。基金合同的有效期限自生效之日起至本基金清算结束报中国证监会备案并公告之日止。

（二）本基金合同自生效之日起对本基金合同当事人具有同等法律约束力。

（三）本基金合同正本一式陆份，除上报有关监管机构贰份外，基金管理人、基金托管人各持有贰份，每份具有同等的法律效力。

## 二十四、 基金合同存放地点和查询办法

本基金合同存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅；也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

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。



## 二十五、其他事项

本基金合同未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

## 二十六、基金合同摘要

### I、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利和义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司。

##### 1. 基金管理人的权利

(1) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金资产；

(2) 根据本基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、质押、收益分配等方面的业务规则；

(3) 根据法律法规和本基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，亲自或委托其他机构向投资者收取事先公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

(4) 根据本基金合同规定销售基金份额；

(5) 提议召开基金份额持有人大会；

(6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(7) 依据本基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律的规定，并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银行监管机构，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取其它必要措施保护基金投资者的利益；

(8) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金销售代理人的作为或不作为违反了法律法规、本基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、本基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

(10) 自行担任基金注册登记代理机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册与过户登记业务，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；

(11) 根据国家有关规定在法律法规允许的前提下依法为基金融资；

(12) 依据本基金合同的规定，决定基金收益的分配方案；

(13) 按照《基金法》、《运作办法》、《管理办法》代表基金行使因投资于证券所产生的权利；

(14) 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；

(15) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2.基金管理人的义务

(1) 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；

(2) 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；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(5) 依法接受基金托管人的监督；

(6) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(7) 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；按照规定计算基金资产净值，并公告各类基金份额的每万份基金份额净收益和基金七日年化收益率；

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

(9) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项和分红款项；

(10) 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；

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

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

(13) 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；

(14) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

(15) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

(16) 对所管理的不同基金资产分别设账、进行基金会计核算，编制基金的财务会计报告；

(17) 保管基金的会计账册、报表、记录15年以上；

(18) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；

(19) 保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(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所在地中国证监会派出机构并通知基金托管人；

(21) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(22) 公平对待所管理的不同基金财产；

(23) 负责为基金聘请注册会计师和律师；

(24) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

本基金的基金托管人为兴业银行股份有限公司。

### 1.基金托管人的权利

(1) 依照基金合同的约定获得基金托管费和其他法律法规允许或监管部门批准的收入；

(2) 监督基金管理人对本基金的运作，如认为基金管理人违反了基金合同的有关规定，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

(3) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(4) 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；

(5) 法律、法规、基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2.基金托管人的义务

(1) 遵守《基金法》、《运作办法》、《管理办法》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金资产；

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

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

(4) 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；

(5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

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

(8) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(9) 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；

(10) 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；

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

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

(13) 建立健全内部控制制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产相互独立，保证其托管的基金资产与其托管的其他基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(14) 负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的基金划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

(15) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额的每万份基金份额净收益和基金七日年化收益率；

(16) 采取适当、合理的措施，使本基金的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定，并使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(17) 按规定保存有关基金托管事务的完整记录15年以上；

(18) 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；

(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中国银监会，并通知基金管理人；

(20) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

(21) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；

(22) 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) 基金份额持有人的权利与义务

#### 1. 基金份额持有人的权利

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金资产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

- (4) 依照相关法律法规和本合同的规定，要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 按相关法律法规的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查询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) 要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制定的其他法律文件的规定履行其义务，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) 在不同的基金直销或代销机构之间转托管；
- (10) 法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件规定的其他权利。

同一类别每份基金份额享有同等的合法权益。

## 2. 基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- (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本基金其他当事人利益的活动；
- (5) 返还持有基金过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (6) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## II、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的同一类别每一基金份额拥有平等的投票权。

### (一) 召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有10%以上（不含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 提前终止基金合同；

- (2) 基金扩募或延长基金合同期限；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 变更基金类别；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；
- (7) 更换基金管理人、基金托管人；
- (8) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的基金合同修改，但基金合同及法律、法规另有规定的除外；
- (9) 《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 因相应的法律、法规（包括证券监督管理部门的要求，下同）发生变动，必须对基金合同进行修改、变更；
- (3) 对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (4) 对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (5) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

## （二）召集人和召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，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开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定，在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；

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十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当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（不含10%）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十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%（不含10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起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；

4、代表基金份额10%以上（不含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（不含10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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

### （三）通知时间、内容和方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒介公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- （1）会议召开时间、地点、方式；
- （2）会议审议事项、议事程序、表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）代理投票委托书送达时间和地点；
- （5）基金份额持有人出席会议需准备的文件和需履行的手续
- （6）会务常设联系人姓名、电话；
- （6）其他注意事项。

2、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。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议召开方式

（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；

（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人

出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；（3）通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；（4）会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜或转换基金运作方式必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 2、基金份额持有人大会召开条件

###### （1）现场开会

必须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，有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的50%（不含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书代理手续完备，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（至少应在15个工作日后）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）通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1）召集人按基金合同规定公布会议通知后，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

所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的50%以上（不含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它代表，同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在15 个工作日后),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。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容仅限于本基金合同“八、基金份额持有人大会（二）召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

（2）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；

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

1) 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解释和说明；

2) 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。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额10%以上（不含10%）的基金份额持有人召集大会时，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（不含50%）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。

## （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 10 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## （六）决议形成的条件、表决方式和程序

### 1、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代理人所持表决权的50%（不含50%）以上通过方为有效；除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

（2）特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、提前终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

### 2、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

（2）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（3）对于通讯开会方式的表决，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无效表决。

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

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如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选举两名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选举三名代表担任监票人；

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

（3）如果大会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；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会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，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

### 2、通讯方式开会

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

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒介公告。

## III、基金收益分配原则、执行方式

### （一）基金收益的构成

基金收益包括基金投资所得债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及

其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

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

## （二）基金收益分配原则

1、本基金各类基金份额均采用人民币 1.00 元的固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起每日将各类基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，使各类基金份额的基金账面份额净值始终保持1.00 元；基金投资当期亏损时，相应调减持有人持有份额，各类基金份额的基金份额净值始终为1.00 元。

2、本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额的收益分配为“每日分配、按月支付”，根据每日基金收益情况，为 A 类基金份额和 B 类基金份额的投资者每日计算并分配当日收益，每月累计收益支付时采用红利再投资（即红利转基金份额）方式将收益结转为相应类别的基金份额。在每月累计收益支付时若累计收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额；若累计收益为负值，则相应缩减投资者基金份额。

本基金D类基金份额和E类基金份额的收益分配为“每日分配、按日支付”，根据每日基金收益情况，为D类基金份额和E类基金份额的投资者每日计算并分配当日收益，且每日进行支付。每日收益支付时采用红利再投资(即红利转基金份额)方式将收益结转为相应类别的基金份额。在当日收益支付时，若当日收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额；若当日收益为负值，则相应缩减投资者基金份额。

3、基金收益分配采用复利分配的方式，即投资者当日分配的收益，在下一工作日享受收益分配。

4、本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。

5、当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。

在符合相关法律、法规及规范性文件的规定，并且不影响投资者利益情况下，经与基金托管人协商一致并得到批准后，基金管理人可酌情调整基金收益

分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

### (三) 收益分配方案的确定与公告

1、本基金开放后每工作日公布前一工作日的各类基金份额的每万份基金份额净收益与基金七日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个工作日，披露节假日期间各类基金份额的每万份基金净收益和节假日最后一日各类基金份额的七日年化收益率，以及节假日后首个开放日各类基金份额的每万份基金净收益和七日年化收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。

### 2、计算方法

本基金按日分配收益，基金管理人另行公告。基金收益计算方法为：

(1) 各类基金份额的日每万份基金净收益=当日该基金份额的基金净收益/当日该基金份额的基金份额总额×10000；

其中，单个基金账户当日分配的基金收益自其下一工作日起享有分配权益，纳入基金份额总额的计算。

各类基金份额的每万份基金净收益保留至小数点后第4位，第五位舍去。

期间每万份基金净收益=  $\sum_{w=1}^n (r_w / S_w) \times 10000$ ；

其中， $r_1$  为期间各类基金份额的首日基金净收益， $s_1$  为期间各类基金份额的首日基金份额总额， $r_w$ 为第w日各类基金份额的基金净收益， $S_w$ 为第w日各类基金份额的基金份额总额， $r_n$ 为期间最后一日各类基金份额的基金净收益， $S_n$ 为期间最后一日各类基金份额的基金份额总额。

(2) 七日年化收益率=  $\left\{ \left[ \prod_{i=1}^7 \left( 1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{365/7} - 1 \right\} \times 100\%$

其中， $R_i$ 为最近第i个自然日(包括计算当日)的各类基金份额的每万份基金净收益。

七日年化收益率四舍五入保留至百分号内小数点后第3位。

(3) 法律法规另有规定的，从其规定，基金管理人应当在变动以上计算方式前3个工作日在指定媒介披露。

#### IV、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### (一) 基金费用的种类

##### 1、与基金运作有关的费用

- (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) 基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (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。

上述(3)至(7)项费用由基金托管人根据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。基金成立前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

##### 2、与基金销售有关的费用

- (1) 基金销售服务费
- (2) 基金认购费用

本基金不收取认购费用。

- (3) 申购费

本基金不收取申购费用。

- (4) 赎回费

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金不收取赎回费用。

如发生下列情形之一：

(1) 在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时；



(2) 当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时；

基金管理人应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

## (二) 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0.15%年费率计算。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

M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前两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0.05%的年费率计算。计算方法如下：

$$H=M \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

M为前一日的基金资产净值

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前两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由B类基金份额降级

为A类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对于由A类基金份额升级为B类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的销售服务费率。D类基金份额的年销售服务费率为0.25%，E类基金份额的年销售服务费率为0.01%，D类基金份额和E类基金份额不进行基金份额升降级。四类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，计算方法如下：

$$H=M \times \text{对应类别的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日该类基金份额应计提的销售服务费

M为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金管理人可以调整销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒介上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构。

### （三）基金管理费、基金托管费和基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商酌情调低基金管理人费率、基金托管费率和基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须按本基金合同的规定进行公告并办理备案手续。

### （四）不得列入基金费用的项目

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

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## V、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的收益。

## （二）投资范围

本基金将投资于以下金融工具：

1、现金；

2、期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；

3、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；

4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

## （三）投资理念

1、确保基金投资的低风险特点，力争为投资者保证本金安全

本基金在投资中将严格按照合同规定将投资范围限定在短期债券投资品种上，以持有到期作为主要基金增值手段，力争规避市场价格波动的风险；同时通过滚动期限资产配置策略，控制平均到期期限，实现利率风险最小化的目标；在投资品种选择上，严格控制在高信用等级品种上，力争将信用风险控制最低水平。

2、保持基金资产的高流动性

本基金由于定位于一种现金管理工具，将切实保证本基金资产在任何时点上资产都具有较高流动性。在资产管理中，将采用动态期限结构管理的技术，实现基金资产流动性在时间上的均衡，力争实现流动性与收益性的最优化配置。

3、在控制风险的前提下，为投资人实现收益最大化

为了给投资人带来最大化收益，实现基金资产的保值增值，本基金在资产管理中将采用现代金融工程技术与数量化分析方法，通过实时计算机化分析系统，一方面实现资产的动态最优化配置，另一方面及时准确把握市场机会，实现无风险套利。

## （四）投资策略

## 1、投资决策依据

(1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。

(2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；

(3) 策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

## 2、投资决策程序

### (1) 投资组合计划的拟定

基金管理小组每月月末拟定下月资产配置计划，报投资决策委员会审批。投资组合计划制定的依据未来宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化的研究与分析，以及据此作出的对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率的积极判断，在此基础上基金管理小组制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，并报投资决策委员会审批。投资组合计划是未来一段时间投资的基础与纲领。

如果基金管理小组认为影响各期限、品种收益率的因素产生了重大变化，还可以临时提出新的投资计划，并由投资决策委员会审批。

### (2) 投资计划的实施

基金管理小组在投资委员会通过的投资组合计划规定限制下，根据市场的实际情况，按照投资策略实施步骤，采用积极投资策略，通过动态调整优化投资组合，追求当期收益最大化。在动态调整的过程中，基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征，实现收益与风险的平衡。

在组合调整过程中，基金管理小组将根据未来可预测资金流动状况，合理管理组合现金头寸，保证组合流动性。

### (3) 交易执行

中央交易室负责执行基金管理小组下达的交易指令，同时履行一线监控的职能。在交易指令执行前，中央交易室对交易指令进行复核，确保交易指令执行后基金各项投资比例符合法律法规以及基金合同、招募说明书的各项规定。

### (4) 组合监控与调整

基金经理与公司的风险管理人员将密切关注宏观经济和市场变化，结合基

金申购和赎回导致的现金流量情况，每日对组合的风险和流动性进行监控，确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平，确保组合的流动性能够满足投资者的赎回要求。当组合中货币市场工具价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时，或当组合中货币市场工具信用评级调整导致信用等级不符合要求时，基金管理小组应采取有效的措施，在合理的时间内调整组合。

### 3、投资管理的方法

本基金在投资组合管理中采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。本基金的核心投资策略由四部分组成：短期市场利率预期策略、期限结构的滚动配置策略、投资组合优化策略、无风险套利操作策略。

#### （1）短期市场利率预期策略

短期利率预期策略是指基金管理人根据对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化作出研究与分析，对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率进行积极的判断，并以此为依据制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，期限结构与品种配置计划是未来一段投资的基础。

#### （2）期限结构的滚动配置策略

为了保证组合资产高流动性，组合资产在到期期限配置上采用滚动配置的策略，即在一个相对固定的投资周期中，将各期限品种的投资均衡分布在不同时间上，从而保证在投资周期内的任何时刻都有稳定的到期现金流，最大限度地提高到期期限约束条件下的流动性。

#### （3）投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下，在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益最大化，约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约束等。

#### （4）无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同，市场中常常存在无风险套利

机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高，无风险套利的机会与收益会不断减少，但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会，基金管理人将贯彻谨慎的原则，充分把握市场无风险套利机会，为投资人带来更大收益。

同时，随着市场的发展、新的货币投资工具的推出，会产生新的无风险套利机会，本基金将加强对市场前沿的研究，及时发现市场中新的无风险套利机会，扩大基金投资收益。

为了保证上述投资策略的顺利实施，基金管理人根据货币市场基金的特点，开发了货币资产组合优化管理系统，以提高投资决策的科学化与实时化。

#### 4、投资品种的选择标准

在上述组合管理的基础上，基金管理小组也将充分重视根据市场形势灵活把握投资品种的主动选择，具有下列一项或多项特征的投资品种是本基金重点投资的对象：

(1) 在相似到期期限和信用等级下，收益率较高的债券、票据或债券回购；

(2) 相似条件下，流动性较高的债券、票据；

(3) 相似条件下，交易对手信用等级较高的债券、票据或债券回购。

(五) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率(税后)。

(六) 风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

(七) 建仓期

本基金管理人自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

(八) 投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。为了实现投资目标，贯彻投资理念，本基金投资组合遵循下列规定：

1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票；
- (2) 可转换债券、可交换债券；
- (3) 剩余期限超过三百九十七天的债券；
- (4) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券；
- (5) 信用等级在AAA 级以下的企业债券；
- (6) 信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；
- (7) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

## 2、投资组合遵循如下投资限制

(1) 同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；

(2) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过5%。

(3) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(4) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(5) 到期日在10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过30%；

(6) 除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的，基金管理人应在5 个工作日内进行调整；

(7) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120 天，平均剩余存续期不得超过240天。

(8) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的

10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金持有的同一（指同一信用级）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（10）本基金应投资于信用级别评级为或相当于AAA以上（含AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（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10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（12）本基金根据份额持有人集中度情况对本基金的投资组合实施调整，并遵守以下要求：

①当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；

②当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；

（13）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%；

（14）本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%；前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工



具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；

(15) 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；

(16) 因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使货币市场基金投资不符合上述规定的比例（第（3）、（6）、（7）、（10）、（11）、（15）条除外）或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。但中国证监会规定的特殊情形除外。

(17) 法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 3、投资组合平均剩余期限和平均剩余存续期限计算方法

#### (1) 平均剩余期限的计算公式

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{期限} + \text{债券正回购} \times \text{期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

#### (2) 平均剩余存续期限的计算公式

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{期限} + \text{债券正回购} \times \text{期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金、期限在一年以内(含一年)的一年以内(含一年)的银行存款、同业存单、逆回购、中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、买断式回购产生的待回购债券、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式

债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

(3) 各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

①银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；

②回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；

③银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算；

④中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算；

⑤组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

(九) 禁止行为

本基金禁止以下投资行为：

- 1、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券或进行证券回购；
- 2、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；
- 3、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；

- 6、从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 7、投资于与基金托管人或基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 8、与管理人的股东进行交易，通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数。
- 9、法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

## VI、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （二）基金资产净值、每万份基金份额净收益和七日年化收益率公告

1、本基金开放后每工作日公布前一工作日的各类基金份额的每万份基金份额净收益与基金七日年化收益率。基金收益公告由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，每工作日公告一次，披露公告截止日前一个工作日（含节假日）各类基金份额的每万份基金份额收益及以最近七日收益所折算的年资产收益率。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、计算方法

本基金按日分配收益，基金管理人另行公告。基金收益计算方法为：

（1）各类基金份额的日每万份基金净收益=当日该基金份额的基金净收益/当日该基金份额的基金份额总额×10000；

其中，单个基金账户当日分配的基金收益自其下一工作日起享有分红权益，纳入基金份额总额的计算。

各类基金份额的每万份基金净收益保留至小数点后第4位，第五位舍去。

期间每万份基金净收益=  $\sum_{w=1}^n (r_w / S_w) \times 10000$ ；

其中， $r_1$ 为期间各类基金份额的首日基金净收益， $s_1$ 为期间各类基金份额的首日基金份额总额， $r_w$ 为第 $w$ 日各类基金份额的基金净收益， $S_w$ 为第 $w$ 日各类基金份额的基金份额总额， $r_n$ 为期间最后一日各类基金份额的基金净收益， $S_n$ 为期间最后一日各类基金份额的基金份额总额。

$$(2) \text{ 七日年化收益率} = \left\{ \left[ \prod_{i=1}^7 \left( 1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{365/7} - 1 \right\} \times 100\%$$

其中， $R_i$ 为最近第*i*个自然日(包括计算当日)的各类基金份额的每万份基金净收益。

七日年化收益率四舍五入保留至百分号内小数点后第3位。

(3) 法律法规另有规定的，从其规定，基金管理人应当在变动以上计算方式前3个工作日在指定媒介披露。

## VII、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

### (一) 基金合同的变更

对于基金合同当事人的权利、义务和职责产生重大影响的合同的变更，应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案，自表决通过之日起生效。但如因相应的法律、法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行变更的情形，或者基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案。

### (二) 基金合同的终止

1、出现下列情况之一的，本基金合同终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- (3) 法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

2、本基金终止后，须依据法律法规和本基金合同对基金进行清算。清算报告报中国证监会备案并予以公告后本基金合同终止。

### (三) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组

(1) 基金管理人应当自基金合同终止之日起30个工作日内组织成立基金财产清算小组。基金财产清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金

财产清算小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) 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

## 2、基金财产的清算程序

- (1) 基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行评估和变现；
- (4) 基金财产清算小组做出清算报告；
- (5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算报告报中国证监会备案；
- (8) 公布基金财产清算公告；
- (9) 对基金财产进行分配。

## 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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小组优先从基金资产中支付。

## 4、基金财产清算后剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后如有余额，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；

清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组公告；

清算过程中的有关重大事项须及时公告；

基金清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后3个工作日内公告。

## 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存15年以上。

## VIII、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，应由各方通过协商予以解决。协商自一方向其他各方发出书面协商通知之日开始。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有权就该争议向有管辖权的人民法院提起诉讼。在争议处理期间，除争议事项外，基金合同的其他条款继续全面有效，各方当事人均应遵守、履行。

## IX、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同正本一式陆份，除上报有关监管机构贰份外，基金管理人、基金托管人各持有贰份，每份具有同等的法律效力。

本基金合同存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅；也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

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。