长安宏观策略股票型证券投资基金招募说明书

(上接 B11 版)

(1)经济周期风险

随着经济运行的周期性变化,国家经济、微观经济、行业及上市公司的盈利水平也可能呈周期性变化,从而影响到证券市场及行业的走势。

(2)政策风险

因国家的各项政策,如财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等发生变化,导致证券市场波动而影响基金投资收益,产生风险。

(3)利率风险

由于利率发生变化和波动使得证券价格和证券利息产生波动,从而影响到基金业绩。

(4)信用风险

当证券发行人不能够实现发行时所做出的承诺,按时足额还本付息的时候,就会产生信用风险。信用风险主要来自于发行人和担保人。一般认为:国债的信用风险可以视为零,而其他债券的信用风险可根据专业机构的信用评级确定。当证券的信用等级发生变化时,可能会产生证券的价格变动,从而影响到基金资产。

(5)再投资风险

再投资获得的收益又被称做利息的利息,这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

(6)购买力风险

基金份额持有人收益将主要通过现金形式来分配,而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

(7)上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响,如经营决策、技术变革、新产品研发、竞争加剧等风险。如果基金所投资的上市公司基本面或发展前景产生变化,可能导致其股价的下跌,或者可分配利润的降低,使基金预期收益产生波动。虽然基金可以通过分散化投资来减少风险,但不能完全规避。

2、管理风险

(1)管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、手段和技术等因素,而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上,例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标;也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

(2)新产品创新带来的风险

随着中国证券市场不断发展,各种国外的投资工具也将被逐步引入,这些新的投资工具在为基金资产提供保值增值功能的同时,也会产生一些新的风险,例如利率期货带来的期货投资风险,期权产品带来的定价风险等。同时,基金管理人也可能因为对这些新的投资产品的不熟悉而发生投资错误,产生投资风险。

3、估值风险

本基金采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示利率风险,或经济环境发生重大变化时,在一定时期内可能高估或低估基金资产净值。基金管理人和基金托管人将共同协商,参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,使调整后的基金资产净值更公允地反映基金资产价值,确保基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

4、流动性风险

本基金面临的流动性风险主要表现在几个方面:建仓成本控制不力,建仓时效不高;基金资产变现能力差,或变现成本高;在投资人大额赎回时缺乏应对手段;证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是:

(1)市场整体流动性问题。

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响,在不同状况下,其流动性表现是不均衡的,具体表现为:在某些时期成交活跃,流动性非常好,而在另一些时期,则可能成交稀少,流动性差。在市场流动性出现问题时,本基金的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。这种风险在发生大额申购和大额赎回时表现尤为突出。

(2)市场中流动性不均匀,存在个股和个券流动性风险。

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同,即使在整体市场流动性较好的情况下,一些单一投资品种仍可能出现流动性问题,这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时,可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券,或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响,增加基金投资成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

5、本基金的特定风险

本基金属于股票型基金,在投资策略上坚持自上而下的宏观择时策略和行业配置策略,立足于对宏观经济和政策形势的研判以及行业生命周期和行业景气度的分析。但由于中国宏观经济处于转型期和变革期,对经济周期和行业发展的分析与预测比较复杂且存在诸多不确定性,而且国内资本市场也处在快速发展、不断完善的过程中,可能导致本基金的资产配置和行业配置偏离最优,影响基金的业绩。

6、其他风险

(1)技术风险

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

(2)大额申购 /赎回风险

本基金是开放式基金,基金规模将随着投资人对基金单位的申购与赎回而不断变化,若是由于投资人的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大量现金;或由于投资人的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响。

(3)顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回,并导致基金管理人的现金支付出现困难,基金投资人在赎回基金单位时,可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

(4)其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险,以及证券市场、基金管理人及基金代销机构可能因不可抗力无法正常工作,从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

(二)声明

本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金,须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过基金代销机构代理销售,但是,基金资产并不是代销机构的存款或负债,也没有经基金代销机构担保收益,代销机构并不能保证其收益或本金安全。

第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)基金合同的变更

1、下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意:

(1)终止基金合同;

(2)转换基金运作方式;

(3)变更基金类别;

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;

(5)变更基金份额持有人大会议事程序;

(6)更换基金管理人、基金托管人;

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

(8)本基金与其他基金的合并;

(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;

(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

① 调低基金管理费、基金托管费;

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

③ 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

④ 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

⑤ 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

⑥ 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体公告。

(二)本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;

2、基金管理人职责终止,而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的;

3、基金托管人职责终止,而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的;

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1、基金财产清算小组

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

(2)基金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)在基金财产清算过程中,基金管理人和基金托管人应各自履行职责,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。

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

2、基金财产清算程序

(1)基金合同终止时,由基金清算小组统一接管基金财产;

(2)对基金财产进行清理和确认;

(3)对基金财产进行估价和变现;

(4)制作清算报告;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;

(6)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(7)将基金清算结果报告中国证监会;

(8)公布基金清算报告;

(9)对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金财产清算的期限为 6 个月,但股票停牌及法律法规另有规定的除外。

5、基金财产按下列顺序清偿:

(1)支付清算费用;

(2)交纳所欠税款;

(3)清偿基金债务;

(4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)—(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

第十八部分 基金合同的内容摘要

(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者自依招募说明书、基金合同取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人,直至其不再持有本基金的基金份额,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

(1)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

1)分享基金财产收益;

2)参与分配清算后的剩余基金财产;

3)依法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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9)法律法规和基金合同规定的其他权利。

(2)根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

1)遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

2)缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用;

3)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

4)不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;

5)执行生效的基金份额持有人大会决议;

6)遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则;

7)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;

8)法律法规和基金合同规定的其他义务。

2、基金管理人的权利与义务

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

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

2)依照本基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

3)依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

4)在符合有关法律法规和本基金合同的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式;

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

6)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;

7)自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

8)选择、更换代销机构,并依据销售代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

9)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

10)依法召集基金份额持有人大会;

11)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

12)根据国家有关规定,在法律法规允许的前提下,以基金的名义依法为基金融资、融券;

13)法律法规规定的其他权利。

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

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

2)办理基金备案手续;

3)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

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

5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,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;

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

7)依法接受基金托管人的监督;

8)计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

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

10)按规定受理基金份额的申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

11)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12)编制季度、半年度和年度基金报告;

13)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

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

15)按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

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

17)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

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

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

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

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

22)按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23)建立并保存基金份额持有人名册;

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

25)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

26)不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动;

27)法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

3、基金托管人的权利与义务

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

1)获得基金托管费;

2)监督基金管理人对本基金的投资运作;

3)自本基金合同生效之日起,依法保管基金财产;

4)在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;

5)根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益;

6)依法召集基金份额持有人大会;

7)按规定取得基金份额持有人名册;

8)法律法规规定的其他权利。

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

1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

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

3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同基金财产分别设置账户,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》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

5)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

6)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

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

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

9)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于 15 年;

10)按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

11)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

12)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;

13)按照规定监督基金管理人的投资运作;

14)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

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

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

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

18)按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务,基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;

19)根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册;

20)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;

21)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;

22)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

23)法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

4、本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据,不因基金账户名称而有所改变。

(二)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、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的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、召开事由

(1)当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

1)终止基金合同;

2)转换基金运作方式;

3)变更基金类别;

4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;

5)变更基金份额持有人大会程序;

6)更换基金管理人、基金托管人;

7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;

8)本基金与其他基金的合并;

9)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

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

11)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

12)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2)出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改,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、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用;

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

3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

4)基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

6)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

3、召集人和召集方式

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

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

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

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

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

4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1)基金份额持有人大会的召集人(以下简称"召集人")负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体和基金管理人网站公告。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;

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的截止时间和收取方式。

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

5、基金份额持有人出席会议的方式

(1)会议方式

1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规、监管机构允许的其他方式开会。

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,基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4)会议的召开方式由召集人确定。

(2)召开基金份额持有人大会的条件

1)现场开会方式

在同时符合以下条件时,现场会议方可举行:

① 经核对、汇总,到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上(含 50%,下同);

② 亲自出席会议者持有基金份额持有人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及授权委托等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 25 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 召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的,不影响表决效力;

③ 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上;

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代表,同时提交的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,并与注册登记机构记录相符;

如果开会条件达不到上述的条件,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后),且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。

3)在法律法规和监管机构允许的情况下,本基金亦可采用其他非书面方式由基金份额持有人向其授权代表进行授权。

在法律法规和监管机构允许的情况下,本基金亦可采用其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

6、议事内容与程序

(1)议事内容及提案权

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

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 日提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

3)召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核,符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

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

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

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

5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当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。基金管理人为召集人的,其授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上(含 50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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 日公布提案,在所通知的表决截止日期第 2 日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。

7、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、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

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

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

(5)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

8、计票

(1)现场开会

1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人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或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的,不影响计票的效力及表决结果。

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。

(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不派代表监督计票的,不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人,由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

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

(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议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体和基金管理人网站公告。

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

10、法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

(三)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

(1) 下列涉及到基金合同内容变更的事项应召开基金份额持有人大会并经基金份额持有人大会决议同意:

1)终止基金合同;

2)转换基金运作方式;

3)变更基金类别;

4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略;

5)变更基金份额持有人大会议事程序;

6)更换基金管理人、基金托管人;

7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

8)本基金与其他基金的合并;

9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;

10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

① 调低基金管理费、基金托管费;

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

③ 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

④ 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

⑤ 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

⑥ 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2)关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。基金管理人应在上述基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒体公告。

2、本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

(1)基金份额持有人大会决定终止的;

(2)基金管理人职责终止,而在 6 个月内没有新的基金管理人承接的;

(3)基金托管人职责终止,而在 6 个月内没有新的基金托管人承接的;

(4)相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

(1)基金财产清算小组

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

2)基金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)在基金财产清算过程中,基金管理人和基金托管人应各自履行职责,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。

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

(2)基金财产清算程序

1)基金合同终止时,由基金清算小组统一接管基金财产;

2)对基金财产进行清理和确认;

3)对基金财产进行估价和变现;

4)制作清算报告;

5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;

6)聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

7)将基金清算结果报告中国证监会;

8)公布基金清算报告;

9)对基金剩余财产进行分配。

(3)清算费用

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

(4)基金财产清算的期限为 6 个月,但股票停牌及法律法规另有规定的除外。

(5)基金财产按下列顺序清偿:

1)支付清算费用;

2)交纳所欠税款;

3)清偿基金债务;

4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)—3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

(6)基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

(7)基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(四)争议解决方式

对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议,基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

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

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(五)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册,供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

第十九部分 托管协议的内容摘要

(一)托管协议当事人

1、基金管理人

名称:长安基金管理有限公司

住所:上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 371 室

办公地址:上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 16 层

邮政编码:201204

法定代表人:万跃楠

成立时间:2011 年 9 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可【2011】1351 号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1 亿元人民币

存续期间:持续经营

经营范围:基金募集、基金销售、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:中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所:北京市西城区金融大街 3 号

办公地址:北京市西城区金融街 3 号 A 座

邮政编码:100808

法定代表人:刘安东

成立时间:2007 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号:中国银监会银监复【2006】484 号

基金托管业务批准文号:证监许可【2009】673 号

组织形式:有限责任公司

注册资金:410 亿元人民币

存续期间:持续经营

经营范围:吸收本外币储蓄存款;办理汇兑;从事银行卡(借记卡)业务;代理收付款项,包括代发工资和社会保障基金、代理各项公用事业收费和代收税款等;代理发行、兑付政府债券;代理买卖外汇;代理政策性银行、商业银行及其他金融机构特定业务;办理政策性银行、中资商业银行和农村信用社大额协议存款;买卖政府债券、金融债券和中央银行票据;承销政府债券和政策性金融债券;提供个人存款证明服务;提供保险箱服务;办理网上银行业务;以非牵头行身份参与政策性银行、国有商业银行及股份制商业银行牵头组织的银团贷款业务;邮政储蓄定期存单小额质押贷款业务;开放式证券投资基金代销业务;吸收对公存款;办理国内外结算;办理票据贴现;发行金融债券;从事同行业拆借;买卖、代理买卖外汇;经银监会批准的其他业务。

(二)基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。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关于证券选择标准的约定进行监督,对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

本基金为股票型基金,基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 60%-95%,债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 0%~40%,其中权证占基金资产净值的 0%~3%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后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%,其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

当法律法规或中国证监会的相关规定变更时,本基金在履行相关程序后可对上述资产配置比例进行适当调整,不需召开基金份额持有人大会。

基金托管人严格根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资范围、投资对象进行监督。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程,基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资范围、投资对象造成基金财产损失的,由基金管理人承担责任,基金托管人不承担任何责任。

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、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督:

(1)本基金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)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(3)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%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;债券回购最长期限为 1 年,到期后不得展期;

(6)本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%,债券、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 0%~40%;

(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;

(8)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%;

(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(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%;

(11)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)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;

(12)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的总资产,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;

(13)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(14) 任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后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%;

(15)本基金持有的所有流通受限证券,应符合法律法规的相关规定;

(16)本基金对于股指期货投资比例的限制,将遵从中国证监会、中国金融期货交易所的相关规定;

(17)本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

(18)法律法规或监管部门规定的其他限制。

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。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本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例,基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕,以符合上述比例限定。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

如果法律法规对基金合同约定的组合限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制。

以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种,投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。基金托管人严格依照监督程序对基金投资、融资、融券比例进行监督。

如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程,基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资、融资、融券比例限制造成基金财产损失的,由基金管理人承担责任,基金托管人不承担任何责任。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督。

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,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。

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

基金托管人履行了监督职责,基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资禁止行为而造成基金财产损失的,由基金管理人承担责任,基金托管人不承担任何责任。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新,加盖公章并书面提交,并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单,并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人,基金托管人于 2 个工作日内进行向基金管理人电话确认已知名单的变更。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程,基金管理人仍违规进行关联交易,并造成基金资产损失的,由基金管理人承担责任,基金托管人不承担任何责任,法律法规另有规定的除外。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时,基金托管人应及时提醒并协助基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生,若基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时,基金托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易,基金托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算,同时向中国证监会报告。

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。

基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话确认收到该名单。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新,如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单,应向基金托管人说明理由,在与交易对手发生交易前 2 个工作日内与基金托管人确认,基金托管人于 1 个工作日内向基金管理人电话确认,新名单自基金托管人确认当日生效。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。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易,应及时提醒基金管理人撤销交易,经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的,基金托管人不承担责任,发生此种情形时,托管人有权报告中国证监会,法律法规另有规定的除外。

(2)基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人负责对交易对手的资信控制和交易方式进行控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人撤销交易,基金管理人仍不撤销的,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任,法律法规另有规定的除外。因交易对手不履行合同造成的基金财产的损失,基金托管人不承担责任,但有权报告中国证监会,法律法规另有规定的除外。

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时,需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的有利于信用风险控制的交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式。基金管理人仍不重新确定交易方式的,基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任,法律法规另有规定的除外。

6、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金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,以确保基金财产的安全,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《基金法》、《运作办法》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 个工作日内纠正或拒绝结算,若基金管理人拒不执行造成基金财产的损失,基金托管人不承担任何责任,法律法规另有规定的除外。

7、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金投资流通受限证券进行监督。

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

(3)在投资流通受限证券之前,基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应根据本基金的投资风格和流动性的需要,合理控制基金投资非公开发行证券等流通受限证券的比例,并在风险控制制度中明确具体比例,避免出现流动性风险。投资流程及风险控制制度需经董事会授权,其中投资非公开发行股票,基金管理人董事会还应批准相关流动性风险处置预案,一旦因投资非公开发行股票出现流动性风险,由基金管理人按照相关制度、预案处置并承担该风险,具体规定依据相关法律法规执行。上述规章制度经董事会通过之后,基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

(4)基金管理人管理的基金在投资流通受限证券前,应按照审慎的风险控制原则,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资格证明、发行证券数量、定价依据、募集资金投向、承销商、发行期限、流通受限期限,管理人管理的基金拟认购的数量、价格、占基金资产净值的比例、划付账号、划付款项、划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并至少于拟执行投资指令的前两日将上述信息书面发至托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5)基金托管人如对基金管理人的投资运作存在疑义,基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,并就基金托管人的疑义进行解释或举证,如投资运作行为违反相关规定的,基金管理人应及时改正或补救。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。

(6)基金托管人对于基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例的情况进行监督。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险,基金托管人应承担连带责任。如果基金托管人切实履行了监督职责,则不承担任何责任,法律法规另有规定的除外。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则基金托管人对此不承担任何责任,并将在发现后立即报告中国证监会,法律法规另有规定的除外。

9、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提示或书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日内及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在上述规定期限内纠正的,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。

10、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事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

11、基金托管人发现基金管理人有重大违法、违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

(三)基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

(1)基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2)基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。如果基金财产(包括实物证券)在基金托管人保管期间损坏、灭失的,应由该基金托管人承担赔偿责任。

(3)基金托管人按照规定开设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与独立。

(5)基金托管人根据基金管理人的指令,按照法律法规的规定、基金合同和本协议的约定保管基金财产。

(6)对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、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,到账日基金财产没有到达基金账户的,基金托管人应及时通知并有义务配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的,基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失,基金托管人对此不承担任何责任。

(7)除依据法律法规和基金合同的规定外,基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金募集期间及募集资金的验资

(1)本基金募集期届满之日前,投资者的认购款项只能存入基金管理人在托管行开立的"基金募集账户"。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折合成基金份额,归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以注册登记机构的记录为准。

(2)基金募集期满或基金提前结束募集时,募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后,基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户,基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件,基金管理人在规定时间内,聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资,出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3)若基金募集期限届满,未能达到基金合同生效的条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜,基金托管人应提供充分协助。

3、基金银行账户的开立和管理

(1)基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2)基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户,并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。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)基金银行账户的开立和使用,限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户;亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(4)基金银行账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

(5)在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金银行账户办理基金资产的支付。

4、基金证券交收账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

(3)基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作,基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议生效日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开设、使用的,按有关规定开设、使用并管理;若无相关规定,则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

5、债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户并报中国人民银行备案,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时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。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易,由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

6、其他账户的开立和管理

(1)因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2)法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管,保管凭证由基金托管人持有,其中实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库,应与非本基金的其他实物证券分开保管;也可存入登记结算机构的代保管库。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。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对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。

8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管,相关业务程序另有限制除外。除协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人,并在 10 个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。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。

(四)基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数。基金份额净值的计算,精确到 0.001 元,小数点后第四位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的,从其规定。

基金管理人每工作日计算基金资产净值及基金份额净值,经基金托管人复核无误后,按规定公告。

2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

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

(五)基金份额持有人名册的登记与保管

本基金的基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册,包括基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制,由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册,基金管理人应及时提供,不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交;基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册,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。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册,应按有关法规规定各自承担相应的责任。

(六)争议解决方式

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

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(七)托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

2、基金托管协议终止的情形

(1)基金合同终止;

(2)基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;

(3)基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;

(4)发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

第二十部分 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。基金管理人有权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及内容。主要服务内容如下:

(一)公开信息披露服务

1、披露公司(基金管理人)信息;

2、披露基金信息;

3、其他信息的披露。

(二)交易对账单寄送服务

一般情况下,基金管理人通过书面或电子形式向投资者提供定期或不定期对账单。基金管理人提供的对帐单邮寄服务原则上采取邮政平信邮寄方式,基金管理人不对邮寄材料的送达做出承诺和保证;也不对因邮寄资料出现遗漏、泄露而导致的任何直接或间接损害承担任何赔偿责任。

(三)客户服务中心电话服务

基金管理人客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。人工座席每个交易日 9:00-11:30,13:00-17:00 为投资人提供服务,投资人可以通过该热线获得业务咨询,信息查询,服务投诉,信息定制,资料修改等专项服务。

客户服务热线:400-820-9688(免长途费),021-20329688

传真电话:021-20329899

(四)网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱,投资人可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息,同时提供网上交易、基金账户查询、交易明细查询、修改查询密码等服务。

公司网址:www.changanfunds.com

电子信箱:service@changanfunds.com

(五)资讯定制服务

在技术条件成熟时,基金管理人将为投资人提供各类资讯服务,包括基金净值、交易确认、公司最新公告、市场资讯,旗下基金信息等。投资人可以通过基金管理人网站、客户服务热线提交定制申请,基金管理人通过手机短信和 E-MAIL 方式发送定制信息。

除了上述信息之外,基金管理人也会不定期向留有手机和 EMAIL 地址的客户发送节日及生日问候、产品推广等信息。

(六)客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的客户服务热线、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。

基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉,以"及时回复"为处理原则,对于不能及时回复的投诉,基金管理人承诺将充分与投资人做好沟通,协商确定回复时间。

(七)定期定额投资计划

在技术条件成熟时,基金管理人将利用直销或代销机构的网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划,投资者可以通过固定的渠道、定期定额申购基金份额。具体实施时间和业务规则另行公告。

第二十一部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构的办公场所,投资者可在营业时间免费查阅。投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资者还可以直接登录基金管理人网站上进行查阅和下载。

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。投资者按上述方式所获得的文件及其复印件,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。

第二十二部分 备查文件

(一)中国证监会核准长安宏观策略股票型证券投资基金募集的文件

(二)《长安宏观策略股票型证券投资基金基金合同》

(三)《长安宏观策略股票型证券投资基金托管协议》

(四)关于申请募集长安宏观策略股票型证券投资基金之法律意见书

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照

(六)基金托管人业务资格批件、营业执照

(七)中国证监会要求的其他文件

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处;基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资者可在营业时间到存放地点免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长安基金管理有限公司

2012 年 1 月 30 日