

# 长盛中证100指数证券投资基金 招募说明书（更新）

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 重要提示

本基金由基金管理人经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2006年8月28日证监基金字[2006]172号文核准募集。

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

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金的基金合同已根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）及其它有关规定进行修订。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2009年11月22日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年9月30日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、 绪言.....	1
二、 释义 .....	1
三、 基金管理人 .....	4
四、 基金托管人 .....	12
五、 相关服务机构 .....	16
六、 基金的募集 .....	28
七、 基金合同的生效 .....	28
八、 基金份额的申购与赎回 .....	29
九、 基金份额的非交易过户和基金间转换 .....	36
十、 基金的投资 .....	37
十一、 基金的业绩 .....	47
十二、 基金的融资 .....	48
十三、 基金的财产 .....	48
十四、 基金资产的估值 .....	49
十五、 基金的收益与分配 .....	55
十六、 基金的费用与税收 .....	56
十七、 基金的会计与审计 .....	59
十八、 基金的信息披露 .....	60
十九、 风险揭示 .....	63
二十、 基金的终止与基金财产的清算 .....	66
二十一、 基金合同的内容摘要 .....	67
二十二、 基金托管协议的内容摘要 .....	80
二十三、 对基金份额持有人的服务 .....	89
二十四、 其他应披露的事项 .....	91
二十五、 招募说明书的存放及查阅方式 .....	92
二十六、 备查文件 .....	93

## 一、 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法规以及《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“本基金合同”）编写。

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

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

## 二、 释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指依据《基金合同》所设立的长盛中证100指数证券投资基金
- 2、基金合同、本基金合同：指《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
- 3、招募说明书：指《长盛中证100指数证券投资基金招募说明书》及根据法律法规规定定期所作的更新
- 4、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《长盛中证100

指数证券投资基金基金托管协议》

- 5、份额发售公告：指《长盛中证 100 指数证券投资基金份额发售公告》
- 6、《证券法》：指2005年10月27日第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议修订，并于2006年1月1日正式实施的《中华人民共和国证券法》
- 7、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》
- 8、《运作办法》：指《证券投资基金运作管理办法》
- 9、《信息披露办法》：指《证券投资基金信息披露管理办法》
- 10、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》
- 11、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 12、中国银监会：指中国银行业监督管理委员会
- 13、基金合同当事人：指受基金合同约定，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体
- 14、基金管理人：指长盛基金管理有限公司
- 15、基金托管人：指中国农业银行股份有限公司
- 16、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
- 17、基金注册登记机构：指接受基金管理人委托代为办理本基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
- 18、个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律、法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人
- 19、机构投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的法人、社会团体、其它组织或投资主体
- 20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法募集的开放式证券投资基金的中国境外的机构投资者（包括但不限于中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构）
- 21、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
- 22、《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

23、《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》规定的程序并经中国证监会批准终止《基金合同》的日期

24、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在本基金的发售公告中列明

25、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

26、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

27、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

28、T 日：指日常申购、赎回或其它交易的申请日

29、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日

30、元：指人民币元

31、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

32、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

33、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

34、销售场所：指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内；

35、场外：指通过上海证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所；

36、场内：指通过上海证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、上市交易的场所；

37、场外认购、申购和赎回：指基金投资者通过场外销售机构申请认购、申购和赎回本基金份额的行为

38、场内认购、申购和赎回：指基金投资者通过交易所场内会员单位申请认购、申购和赎回本基金份额的行为

39、基金资产总值：指基金所购买各类证券价值、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

40、基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值

41、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额资产净值的过程

42、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入

43、上证基金通：指上海证券交易所开放式基金销售系统，可为开放式基金的认购、申购、赎回等相关业务提供高效、自动、一体化的技术支持。

44、不可抗力：指任何无法预见、无法避免和无法克服的事件或因素，包括但不限于地震、洪水等自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、没收，相关法律、法规的变更，突发停电或其他突发事件、证券交易场所暂停或停止交易

45、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网网站，包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

46、转托管：指基金份额持有人按照基金合同或届时有效的业务规则将其持有的部分或全部本基金份额在场外不同销售机构之间进行转托管以及在场内和场外之间进行跨市场转托管的行为

47、定期定额计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在指定银行在账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

48、会员单位：指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：陈平

电话：(010) 82255818

传真：(010) 82255988

联系人：叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）占注册资本的41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省信用担保集团有限公司（原安徽省创新投资有限公司）占注册资本的13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截至2009年11月22日，基金管理人共管理两只封闭式基金、十只开放式基金和六只社保基金委托资产，公募基金管理资产规模约460.18亿元。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员：

陈平先生，董事长，硕士。曾任教于合肥工业大学管理系，历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理、国元证券有限责任公司副总裁。2004年10月始任长盛基金管理有限公司董事。

凤良志先生，董事，博士，高级经济师。历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、安徽省国际信托投资公司副总经理、安徽省证券管理办公室主任、安徽省政府驻香港窗口公司（黄山有限公司）董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理（主持工作）、安徽国元控股（集团）有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长。现为国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）董事长。

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

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

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国（塞班）分公司任财务经理，历

任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司（黄山有限公司）总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理。现为国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）董事、总裁。

何玉珠女士，董事，学士。历任 JP 摩根证券（亚洲）有限公司副总裁、瑞银集团董事总经理。现为星展资金管理有限公司首席执行官、新加坡财富管理学院资深顾问。

吴积民先生，董事，工商管理硕士，特许财务分析师。有逾二十年投资银行及资产管理经验，曾任职多个主要财务机构，包括汇丰银行及 JP 摩根。现为星展资金管理（香港）有限公司董事总经理。

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

张仁良先生，独立董事，经济及金融学教授。曾任香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人，太平洋经济合作理事会（PECC）属下公司管制研究小组主席，上海交通大学管理学院兼职教授及上海复旦大学顾问教授，香港城市大学讲座教授。现为香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署辖下的《伙伴倡自强》小区协作计划主席、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席、以及香港特区政府策略发展委员会委员。2007 年被委任为太平绅士。

荣兆梓先生，独立董事，经济学学士，教授；兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学院副主编。现为安徽大学经济学院院长，校学术委员会委员，产业经济学和工商管理硕士点学科带头人；武汉大学商学院博士生导师，安徽省政府特邀咨询员；全国马经史学会常务理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会常务理事。

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

## 2、基金管理人监事会成员：

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

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

钱进先生，监事，硕士研究生。曾任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理。现为安徽省投资集团有限责任公司总经济师。

林良友先生，监事，学士。曾在花旗银行、瑞信出任要职。现为星展银行（香港）有限公司私人银行部业务主管。

肖强先生，监事，学士。曾任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理，中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师，中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理、基金同智基金经理，投资管理部副总监，现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

### 3、基金管理人高级管理人员

陈平先生，董事长，硕士。同上。

陈礼华先生，硕士，高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员，华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理，南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监，长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

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

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

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

#### 4、本基金基金经理

白仲光先生，1969 年 8 月出生。天津大学博士。1991 年至 1997 年在石家庄经济学院任教，2003 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任研究员、高级金融工程师、基金经理等职务，现任金融工程部总监，自 2009 年 3 月 11 日起任长盛中证 100 指数证券投资基金（本基金）基金经理。

历任基金经理情况：白仲光先生，2006 年 11 月 22 日—2008 年 1 月 3 日任本基金基金经理；黄瑞庆先生，2007 年 9 月 17 日—2009 年 3 月 11 日任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

陈礼华先生，硕士，总经理，同上。

詹凌蔚先生，经济学硕士，曾历任融通基金管理有限公司研究部研究员，研究部副总监，基金经理助理，基金经理，投资总监，总经理助理；博时基金管理有限公司基金经理职务。现任长盛基金管理有限公司总经理助理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

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

侯继雄先生，博士。曾任国泰君安证券股份有限公司企业融资业务经理、研究所行业研究员和策略经理等职务；于 2007 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，现任同盛证券投资基金基金经理。

潘九岩先生，硕士。曾任博时基金管理公司交易部任中央交易员，2002 年起至今在长盛基金管理有限公司任职，先后担任交易主管、同智基金经理助理、交易部副总监，现在担任交易部总监。

白仲光先生，金融工程专业工学博士，2003 年加入长盛基金管理有限公司，历任研究员、高级金融工程师、基金经理等职务。现任金融工程部总监，长盛中证 100 指数基金基金经理。

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

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值、基金份额净值、基金份额累计净值确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

#### （四）基金管理人承诺

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

2、基金管理人承诺防止下列禁止行为的发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

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

#### 3、基金经理承诺

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

（2）不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

（4）不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### （五）基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的原则

本基金管理人的内部控制遵循以下原则：

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

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

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

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

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

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

## 2、完备严密的内部控制体系

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

## 3、内部控制制度的内容

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

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

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

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

定，其制定和实施需报经公司总经理办公会批准。

公司的内部控制制度会随着市场的发展和金融创新来进行相关调整。一般而言，当市场有变化或主管部门有新的规章制度时，相关制度会相应更改。公司各部门对规章制度的调整与更新情况由监察稽核部负责监督。

#### 4、内部控制实施

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

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

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

#### 5、基金管理人关于内部控制的声明

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

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立日期：2009 年 1 月 15 日

注册资本：2600 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68424199

传真：010-68424181

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## （二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 130 名，其中高级会计师、高级经济师、

高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

### （三）基金托管业务经营情况

截止 2009 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 72 只，包括长盛中证 100 指数证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资

资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)。

#### （四）基金托管人的内部风险控制制度说明

##### 1、内部控制目标

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

##### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

##### 3、内部控制制度及措施

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

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理

人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）长盛基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 9 层

电话：(010) 82255818 转 263、288

传真：(010) 82255981、82255982

联系人：银晓莉

客户服务电话：(010) 62350088、400-888-2666

##### （2）长盛基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1601 室

电话：(021) 6888 9056、(021) 6888 9206

传真：(021) 6888 9156

联系人：冯岩

##### （3）长盛基金管理有限公司华南营销中心

地址：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心 8 层 GH 单元

电话：(0755) 88267980

传真：(0755) 82022118

联系人：梁琪

## 2、代销机构

### （1）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

传真：(010) 85109219

联系人：滕涛

客户服务电话：95599

网址：[www.95599.cn](http://www.95599.cn)

### （2）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：金蕾

电话：010-65557013

传真：010-65550827

网址：<http://bank.ecitic.com>

### （3）中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

联系人：靳晓杰

传真：(010) 66594946

客户服务电话：95566

银行网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### （4）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

电话：010-67597114

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

电话：0755 - 83077024

传真：0755 - 83195049

联系人：徐彪

客户服务电话：95555

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

（6）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：(010) 66107900

传真：(010) 66107914

联系人：王隼

客户服务电话：95588

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

（7）广东发展银行股份有限公司：

注册地址：广州市农林下路 83 号

法定代表人：李若虹

客户服务电话：020-38322222

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

（8）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

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

（9）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：倪苏云、虞谷云

客户服务热线：95528

网站：www.spdb.com.cn

（10）交通银行股份有限公司：

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（11）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

联系人：刘丰

电话：(010) 85238421

传真：(010) 85238680

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

（12）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

开放式基金业务传真：( 0551 ) 2634400-3612

联系人：李蔡

( 13 ) 国联证券有限责任公司

住所：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：范炎

开放式基金咨询电话：( 0510 ) 82831662 , ( 0510 ) 82588168

开放式基金业务传真：( 0510 ) 82831589

联系人：袁丽萍

电话：( 0510 ) 82831662

公司网站：www.glscc.com.cn

( 14 ) 广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系电话：( 020 ) 87555888

传真：( 020 ) 87557985

联系人：肖中梅

公司网站：www.gf.com.cn

( 15 ) 中国银河证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：胡长生

电话：( 010 ) 66568047

传真：( 010 ) 66568536

联系人：李洋

( 16 ) 广发华福证券有限责任公司

住所：福州市新天地大厦 8 层

办公地址：福州市新天地大厦 8 层

法定代表人：黄金琳

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

联系人：张腾

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(17) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝内大街188号

法定代表人：张佑军

电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

联系人：权唐

(18) 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼

办公地址：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼

法定代表人：马昭明

电话：(0755) 82492000

传真：(0755) 82492062

联系人：盛宗凌

客户服务电话：400-8888-555, (0755) 25125666

公司网站：www.lhzq.com

(19) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54035333

联系人：李清怡

公司网址：www.sw2000.com.cn

（20）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943237

联系人：黄健

客户服务热线：4008888111、(0755) 26951111

（21）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

联系人：芮敏祺

（22）新时代证券有限责任公司

住所：北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 15 层

办公地址：北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 15 层

法定代表人：马金声

开放式基金咨询电话：(010) 68084591

开放式基金业务传真：(010) 68084986

联系人：戴荻

（23）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

联系电话：021-50818887-281

客户咨询电话：021-68823685

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

（24）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

电话：(021) 53594566

联系人：金芸

客服电话：400-8888-001、(021) 962503

（25）东北证券股份有限公司

住所：长春市人民大街 138 - 1 号

办公地址：长春市人民大街 138 - 1 号

法定代表人：李树

开放式基金咨询电话：(0431) 96688-0、(0431) 5096733

开放式基金业务传真：(0431) 5680032

联系人：潘锴

公司网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

（26）恒泰证券有限责任公司

住所：内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路 111 号

办公地址：上海浦东松林路 357 号通贸大厦 20 楼

法定代表人：刘汝军

电话：021-68405273

传真：021-68405181

联系人：张同亮

公司网址：<http://www.cnht.com.cn>

（27）第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人：刘学民

开放式基金咨询电话：(0755) 25832686

开放式基金业务传真：（0755）25831718

联系人：杨柳

（28）华西证券有限责任公司

住所：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

法定代表人：张慎修

电话：（0755）83025430

传真：（0755）83025991

联系人：杨玲

（29）中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

联系人：王勤

联系电话：0571-85783750

客户咨询电话：0571-96598

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

（30）渤海证券有限责任公司

住所：天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

客户服务热线：（022）28455588 或城市营业网点咨询电话

电话：（022）28451883

联系人：王兆权

（31）中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区香港东路 316 号

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

联系电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

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

客户咨询电话：0532-96577

（32）国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层

法定代表人：王少华

电话：800-810-8809

传真：010-64482090

联系人：黄静

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

（33）齐鲁证券有限公司

地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283728

传真：0531-81283735

联系人：傅咏梅

（34）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-893

传真：025-84579763

联系人：程高峰

（35）安信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

联系人：余江

(36) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

客户服务热线：0755-33680000 400 6666 888

长城证券网站：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(37) 红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

联系人：王敏

电话：0871-3577011

客户服务电话：0871-3577930

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

(38) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层，100140

法定代表人：刘弘

联系人：谢亚凡、田文健

电话：010-59226788

网站：[www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com)

(39) 中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

法定代表人：杨小阳

联系人：刘权

电话：0755-82026521

传真：0755-82026539

（40）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代理人：陈林

联系人：楼斯佳

联系电话：021-50122107

客户咨询电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

（41）江南证券有限责任公司

注册地址：南昌市抚河北路 291 号

法定代理人：姚江涛

联系人：戴蕾

电话：0791-6768763

客户服务热线：400-8866-567

网址：www.scstock.com

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：陈耀先

电话：(010) 58598839

传真：(010) 58598907

联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：国浩律师集团（北京）事务所

注册地址：北京市东城区贡院六号E座9层

办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层

法定代表人：王卫东

电话：(010) 65890699

传真：（010）65176800

经办律师：李永飞、王卫东

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区沈家弄325号

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：Kent Watson

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

经办注册会计师：薛竞、陈宇

## 六、基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会2006年8月28日证监基金字[2006]172号文批准募集。募集期为2006年10月26日至2006年11月16日。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，设立募集期共募集4,031,424,938.24 份基金份额，有效认购户数为116,378户。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金合同于2006年11月22日生效。

### （二）基金存续期内基金份额持有人数量和资产规模限制

本基金合同生效后的存续期间内，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。法律、法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）日常申购与赎回的场所

#### 1、场外申购与赎回

投资者可以通过长盛基金管理公司北京、上海直销中心和中国农业银行等销售代理机构办理开放式基金业务的网点申购与赎回本基金份额。

#### 2、场内申购与赎回

投资者可以通过上海证券交易所开通上证基金通业务的各会员单位的网点申购与赎回本基金份额。

### （二）申购与赎回的开放日及开放时间

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）。

申购开始日：2006年1月16日

赎回开始日：2006年2月12日

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日，开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

基金管理人如果对申购、赎回时间进行调整，应报中国证监会备案，并在实施前3个工作日在至少一种指定媒体上公告。

### （三）申购与赎回的限制

#### 1、申购与赎回的数额限制

（1）本基金场外申购的最低申购金额为 1000 元人民币。

（2）本基金场内申购的最低申购金额为 1000 元人民币，同时每笔申购金额必须是 100 的整数倍，并且每笔申购最大不超过 99,999,900 元。

（3）本基金不设最低赎回份额。场内单笔赎回的基金份额申报必须是整数份额，且最多不能超过 99,999,999 份基金份额。

（4）根据市场情况，基金管理人可以调整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体上刊登公告并报中国证监会备案。

## 2、单个账户持有本基金份额的限制

本基金暂无单个账户基金份额最低持有余额限制，根据市场情况，基金管理人可以调整单个账户持有本基金份额的限制，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体上刊登公告并报中国证监会备案。

本基金对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规、中国证监会另有规定的除外。

### （四）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购、赎回申请可以在当日交易时间结束以前撤销（但场内申请已被确认或场外申报已被受理的除外），在当日的交易时间结束以后不得撤销。

4、投资者提交赎回申请时，由系统自动识别先前认购/申购基金份额的时间，按每笔交易的具体时间来计算持有期限，系统会采取先进先出法，即先认购/申购的基金份额会先赎回，按不同的持有期限分别计算收取赎回费。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前三个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

### （五）申购、赎回的程序

1、申请方式：书面申请或基金销售机构规定的其他方式。

2、基金投资者必须根据基金销售机构规定的手续，向基金销售机构提出申购、赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回申请时，账户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效而不予成交。

### 3、申购、赎回申请的确认

T日提交的有效申请，投资者可在T+2日后到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

### 4、申购、赎回的款项支付

基金申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项通常在T+7日内划往赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回或延期支付的情形时，款项的支付办法参照本基金合同和招募说明书的有关条款办理。

5、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### （六）申购份额、赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额及余额的处理方式

场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用（若有）后，以申请当日的基金份额净值为基准计算，四舍五入法保留两位小数，由此引起的差额计入基金财产。

场内申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用（若有）后，以申请当日的基金份额净值为基准计算，保留到整数位，剩余部分折回金额返回投资者。

##### 2、基金申购份额的计算

基金申购费率适用比例费率时，基金申购份额的计算方法如下：

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购份额 = 净申购金额 / 当日基金份额净值

基金申购费用为固定金额时，基金申购份额的计算方法如下：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份数 = 净申购金额 / T 日基金份额净值

例：某投资人投资100,000元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为1.0160元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	100,000元
基金份额净值（NAV）	1.0160元
净申购金额	$100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17$ 元

申购费用	$100,000 - 98,522.17 = 1,477.83$ 元
申购份额	$98,522.17 / 1.0160 = 96,970.64$ 份

### 3、赎回金额的处理方式：

本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用，赎回金额保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此引起的差额计入基金资产。

本基金不设最低赎回份额。场内单笔赎回的基金份额申报必须是整数份额，且最多不能超过99,999,999份基金份额。

### 4、基金赎回金额的计算

赎回费 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回当日基金份额净值 × 赎回份额 - 赎回费

例：某投资人赎回10,000份本基金，假设赎回当日的基金份额净值为1.0560元，持有期不足一年，则其可得到的赎回金额为：

赎回份额	10,000份
基金份额净值（NAV）	1.0560元
赎回费用	$10,000 \times 1.0560 \times 0.5\% = 52.80$ 元
赎回金额	$10,000 \times 1.0560 - 52.80 = 10,507.20$ 元

### 5、基金份额净值的计算

本基金每个工作日公告基金份额净值，当日基金份额净值在当天收市后计算，并在下一工作日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

当日基金份额净值 = 当日基金资产净值 / 当日基金份额数

#### （七）申购费率和赎回费率

##### 1、申购费率：

本基金的申购费率不高于1.5%，随申购金额的增加而递减，可适用以下收费费率标准：

申购金额（M，含申购费）	申购费率
M < 50万	1.5%
50万 ≤ M < 200万	1.2%

200万 M < 500万	1.0%
M ≥ 500万	按笔收取，1000元/笔

2、本基金的赎回费率不高于0.5%，随着持有期限的增加而递减：

持有期限	赎回费率
持有期 < 一年	0.5%
一年 持有期 < 两年	0.25%
持有期 ≥ 两年	0

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可按中国证监会规定的程序调整申购费率、赎回费率，并在更新的《招募说明书》中进行公告。基金管理人调整申购费率、赎回费率应最迟在实施前3个工作日在至少一种指定媒体和网站公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在取得有关监管机构核准之后，对促销期间的基金申购费等实行优惠。

#### （八）赎回费的归属和申购费、赎回费的用途

本基金赎回费的25%归入基金财产所有。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。

#### （九）申购、赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记人在T+1日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续。

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

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种指定媒体和网站上刊登公告。

#### （十）拒绝或暂停接受申购的情形及处理

本基金出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2、证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算

当日基金资产净值；

3、基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；

4、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

5、基金场内交易停牌时；

6、法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。

发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告。

#### （十一）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形和处理

本基金发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、不可抗力；

2、证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金场内交易停牌时；

4、连续2个开放日以上发生巨额赎回；

5、法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告并应在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。已确认的赎回申请，基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回份额。投资者在申请赎回时可以选择将当日未获受理部分予以撤销。

如果连续2个开放日以上发生巨额赎回，对于已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过支付时间20个工作日，并在中国证监会指定的媒体上公告。

发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停赎回或延缓支付赎回款项的，应当报中国证监会批准；经批准后，

基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停赎回或延缓支付赎回款项的公告。在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并按时支付赎回款项。

## （十二）巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

巨额赎回指在单个开放日内，本基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）超过上一开放日基金总份额10%的情形。

### 2、巨额赎回的处理

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为基金兑付投资者的全部赎回申请有困难，或认为为实现投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占基金赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回优先权并将以该开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回申请为止。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内在至少一种指定媒体上公告，并说明有关处理办法。

### （3）巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在2日内在至少一种指定媒体上公告，并说明有关处理办法。

### 3、连续巨额赎回的情形及处理方式

基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间后的20个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

## （十三）与暂停申购和暂停赎回或延缓支付赎回款项相关的公告

发生上述暂停申购和暂停赎回或延缓支付赎回款项情况的，基金管理人应在

当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

若发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近1个开放日的基金份额净值。

若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2个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近1个开放日的基金份额净值。

若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体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

## 九、基金份额的非交易过户和基金间转换

### （一）基金份额的非交易过户

基金注册登记人只受理继承、捐赠、司法执行情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”只受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法执行”是指司法机关依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供相关资料。

### （二）基金间的份额转换

在条件允许的情况下，本基金也可与本公司其他开放式基金转换，具体业务办理时间在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换开始前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上公告。

### （三）转托管

#### 1、基金份额的登记

本基金通过场外和场内认购或申购买入的基金份额都登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下。

## 2、系统内转托管

系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构之间进行转托管的行为。

## 3、跨系统转托管

投资人可将上证所场内基金份额申请转托管至场外基金管理人或其代销机构处，也可将场外基金份额申请转托管至上证所场内证券经营机构处。

该类转托管只限于在上证所场内证券账户和场外以其为基金注册的开放式基金账户之间进行。

## （四）冻结与解冻

基金登记注册人只受理司法机构依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金登记注册人的相关规定办理。

# 十、基金的投资

## （一）投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在 4%以下，以实现对基准指数的有效跟踪。

## （二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证100指数成份股、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。

## （三）基准指数与业绩衡量基准

### 1、基准指数

本基金股票资产的基准指数为中证 100 指数。

如果中证 100 指数被停止编制及发布，或中证 100 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证 100 指数不宜继续作为基准指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则变更本基金的基准指数；并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的基准指数。

根据市场变化，从基金份额持有人利益出发，依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，本基金可能转换成为 ETF 基金。

本基金由于上述原因变更基准指数或转换成为 ETF 基金，需经中国证监会核准，并在正式实施前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

## 2、业绩衡量基准

中证 100 指数收益率  $\times$  95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后） $\times$  5%

### （四）投资理念

本基金认为，我国经济增长将保持持续稳定的发展态势，为指数投资获取长期稳定收益奠定了良好的宏观经济基础。本基金选择了以市值代表性强、流动性高、大盘蓝筹为特色的中证 100 指数为股票组合的跟踪基准，力求通过被动指数化、分散化的投资方式，通过买入并持有的长期投资策略，获取中国资本市场长期增长的稳定收益，以使投资者能够分享中国经济增长的长期收益。

### （五）投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。

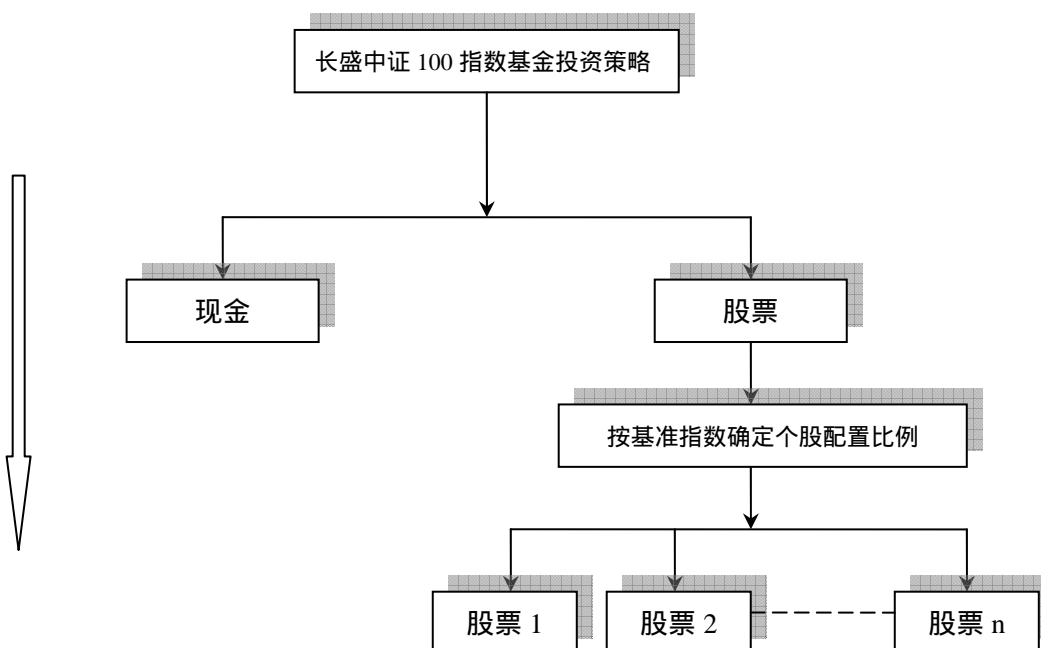
当预期成份股发生调整和成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如股权分置改革等）导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到基金合同相关规定。

## 1、资产配置

本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨,采用自上而下的两层次资产配置策略,首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例,再进一步以复制基准指数的方法,确定不同股票之间的配置比例。

图 3 长盛中证 100 指数基金投资策略体系



## 2、股票组合构建

### (1) 股票组合构建原则

本基金原则上采用复制基准指数的方法,按照个股在基准指数中的基准权重构建指数化股票投资组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

### (2) 股票组合构建方法

本基金原则上将采取复制基准指数的方法,按照个股在基准指数中证 100 指数中的基准权重进行指数化投资组合构建。复制方法将使用下列模型:

$$Amount_{i,t} = \omega_{i,t} \times netvalue_t$$

$$Volume_{i,t} = Amount_{i,t} / P_{i,t}$$

这里,  $\omega_{i,t}$ : 中证 100 指数中第 i 个成份股 t 时刻在指数中所占的权重

$Amount_{i,t}$ ：本基金对中证 100 指数中第  $i$  个成份股  $t$  时刻的投资额度

$Volume_{i,t}$ ：本基金对中证 100 指数中所有成份股在  $t$  时刻购买的股票数量

$Netvalue_t$ ：本基金在  $t$  时刻投资在股票上的总资金

$P_{i,t}$ ：中证 100 指数中第  $i$  个成份股在  $t$  时刻的市场价格

### 3、股票组合调整

#### （1）组合调整原则

本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### （2）投资组合调整方法

##### 对基准指数的跟踪调整

##### A、定期季度调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的中证 100 指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

中证指数委员会每过半年召开审核会议，根据指数编制规则，使用最后一个交易日收盘后的资料进行成份股审核，决定成份股审核结果（指数成份股及其权重）。本基金将按照中证 100 指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

##### B、不定期调整

根据指数编制规则，当中证 100 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

调整期间原则上定为：中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

##### 限制性调整

##### A、大额赎回调整

由于本基金开放式基金的特点，当发生大额赎回超过现金保有比例时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

#### B、流动性调整

如果因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素，使得基金管理人无法依照基准指数权重购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。

替代股票的选取主要依照行业、规模相似的前提下，计算需替代的基准指数成分股票和替代股票历史收益率之间的相关系数，原则上要求最近一年的日收益率相关系数达到 0.8 以上，相关系数的计算方法如下

$$\rho = \frac{COV(r_{\text{成份股}}, r_{\text{替代股票}})}{\sqrt{VAR(r_{\text{成份股}})VAR(r_{\text{替代股票}})}}$$

这里 COV 函数表示样本协方差，VAR 函数表示样本方差。

C、如果预期指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视情况对基金资产进行前瞻性的调整，以更好地跟踪基准指数。

D、针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

E、为使得基金收益率尽可能地贴近所跟踪基准指数的收益率，本基金可能使用投资金融衍生产品，以对冲某些成分股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

F、在其他影响指数复制的情况下，本基金管理人可以根据市场情况，在跟踪误差最小化的条件下，对基金资产进行适当的调整。

### （六）投资决策

#### 1、投资决策依据

- （1）国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。
- （2）宏观经济发展环境、微观企业经济运行态势和证券市场走势。

#### 2、投资决策机制

本基金的投资决策机制为，实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

（1）投资决策委员会

负责制定基金投资方面的整体战略和原则；审定基金季度投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

（2）基金经理

负责资产配置与投资组合构建的日常管理。

3、投资决策程序

（1）金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算，并提供数量化风险分析报告；研究部对基准指数成份股中基本面恶化的企业情况提供及时的风险分析报告；市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告，供基金经理决策参考。

（2）投资决策委员会定期召开会议，依据上述报告对资产配置提出指导性意见；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

（3）基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告，在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下，采取适当的方法，控制与指数的偏差风险、流动性风险，降低交易成本。

（4）交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖。

（5）风险控制委员会根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议；风险管理小组对投资组合的偏离度风险进行实时跟踪和评估，并对风险隐患提出预警；监察稽核部对指数化投资组合的执行过程进行实时风险监控；基金经理依据基金申购和赎回的情况控制指数化投资组合的流动性风险。

4、投资评价

在正常市场情况下，本基金净值收益率与业绩衡量基准之间年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（七）风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金，风险中等，将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过

严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

#### （八）投资限制

##### 1、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）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动；

##### 2、本基金投资组合比例将符合以下限制

- （1）基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （2）股票、债券和现金的投资比例不得违反本基金合同有关投资范围、投资策略、投资比例等内容的约定；
- （3）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。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起 3 个月内达到规定的标准。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例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。

#### （九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全和增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；

4、基金管理人按照有关规定代表基金行使股东权利。

#### （十）基金投资组合报告

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

本基金的托管人——中国农业银行根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2009年9月30日，本报告财务资料未经会计师事务所审计。

#### 1、2009年9月30日基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	1,500,592,759.34	93.72
	其中：股票	1,500,592,759.34	93.72
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	86,966,510.34	5.43
6	其他资产	13,593,974.73	0.85
7	资产合计	1,601,153,244.41	100.00

#### 2、2009年9月30日按行业分类的股票投资组合

##### （1）指数投资部分

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,854,612.09	0.24
B	采掘业	175,210,295.02	11.04
C	制造业	300,046,992.76	18.91
C0	食品、饮料	57,114,333.12	3.60
C1	纺织、服装、皮毛	6,337,823.10	0.40
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	21,877,403.06	1.38
C5	电子	-	0.00

C6	金属、非金属	95,472,227.75	6.02
C7	机械、设备、仪表	119,245,205.73	7.52
C8	医药、生物制品	-	0.00
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	64,974,983.46	4.09
E	建筑业	24,941,223.48	1.57
F	交通运输、仓储业	75,812,321.28	4.78
G	信息技术业	48,172,991.46	3.04
H	批发和零售贸易	20,955,909.81	1.32
I	金融、保险业	688,296,941.77	43.38
J	房地产业	76,844,554.02	4.84
K	社会服务业	14,760,140.54	0.93
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	6,721,793.65	0.42
	合计	1,500,592,759.34	94.57

## (2) 积极投资部分

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	-	0.00
C0	食品、饮料	-	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	0.00
C8	医药、生物制品	-	0.00
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	-	0.00
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	-	0.00
J	房地产业	-	0.00
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00

M	综合类	-	0.00
	合计	-	0.00

## 3、2009年9月30日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明

细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	5,222,628	77,190,441.84	4.86
2	601318	中国平安	1,407,851	71,378,045.70	4.50
3	601328	交通银行	8,350,052	69,555,933.16	4.38
4	600016	民生银行	8,661,257	58,376,872.18	3.68
5	601166	兴业银行	1,609,982	54,401,291.78	3.43
6	600030	中信证券	2,131,445	53,307,439.45	3.36
7	600000	浦发银行	2,550,723	50,121,706.95	3.16
8	000002	万科 A	4,453,394	46,404,365.48	2.92
9	601088	中国神华	1,514,647	45,984,682.92	2.90
10	601169	北京银行	2,000,278	34,464,789.94	2.17

## 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	0.00

## 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	5,222,628	77,190,441.84	4.86
2	601318	中国平安	1,407,851	71,378,045.70	4.50
3	601328	交通银行	8,350,052	69,555,933.16	4.38
4	600016	民生银行	8,661,257	58,376,872.18	3.68
5	601166	兴业银行	1,609,982	54,401,291.78	3.43

## 4、2009年9月30日按券种分类的债券投资组合：

本基金报告期末未持有债券。

## 5、2009年9月30日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券

明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 6、2009年9月30日基金持有的资产支持证券明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 7、2009年9月30日本基金投资权证明细

本基金报告期末未持有投资权证。

## 8、投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

（2）基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

（3）2009年9月30日其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	9,031,639.07
3	应收股利	1,149,025.79
4	应收利息	20,705.82
5	应收申购款	2,342,604.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,593,974.73

## 9、2009年9月30日基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

10、2009年9月30日基金持有的积极投资和指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资和指数投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 十一、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

	基金份额净值 增长率	同期业绩比较基准收益率	超额收益率
2006 年度	9.45%	27.88%	-18.43%
2007 年度	115.49%	135.95%	-20.46%
2008 年度	-62.78%	-64.33%	1.55%
2009.1.1 至 2009.9.30	58.69%	56.99%	1.70%
自基金合同生效起至今	39.31%	68.95%	-29.64%

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

## 十二、基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

## 十三、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。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （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

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法：

（1）上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值：

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；

非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

#### （3）所持长期停牌股票的估值方法：指数收益法。

（4）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）-（3）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管

理人认为按本项第（1）-（3）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

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

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值办法：

（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

（3）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

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

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

## 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销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，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，如果因基金管理人的行为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，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付；

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，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。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有

权向其他当事人追偿。

（2）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

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

由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

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

（4）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （七）暂停估值的情形

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

投资者的利益，已决定延迟估值；

4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。

基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人。

基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。

国家另有规定的，从其规定。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项或权证估值方法的第（4）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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十五、基金的收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、银行存款利息；

- 4、因运用基金财产带来的成本或费用的节约；
- 5、已实现的其他合法收入。

## （二）基金净收益

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

## （三）基金收益分配原则

- 1、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 2、场外投资者可以选择现金分红或红利再投资，本基金分红的默认方式为现金分红；
- 3、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 4、基金当期收益应先弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配；
- 5、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配四次。全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的50%，但若基金合同生效不满3个月则不进行收益分配；
- 6、每一基金份额享有同等分配权。

## （四）基金收益分配方案

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

## （五）基金收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，按《信息披露办法》有关规定公告并报中国证监会备案。

## （六）收益分配中发生的费用

- 1、收益分配中采用红利再投资方式的免收再投资的费用；
- 2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 十六、基金的费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

- 1、与基金运作有关的费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 销售服务费，具体计提办法按中国证监会的规定执行；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、与基金运作有关的费用的费率、计提方法、计提标准、收取方式和使用方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金管理费年费率为0.75%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率，计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金托管费年费率为0.15%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率，计算方法如下：

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

H：为每日应支付的基金托管费；

E：为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(3) 上述（一）基金费用第（3） - （8）项费用，除上款规定的费用外，

由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，从当期基金财产中支付。

（4）基金首次发售中所发生的律师费和会计师费等费用自基金认购费用中列支，不另从基金财产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关规定列支；若本基金发售失败，发售费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

### 3、不列入基金费用的项目

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

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费

本基金的申购费率不高于1.5%，随申购金额的增加而递减：

申购金额（M，含申购费）	申购费率
M < 50万	1.5%
50万 M < 200万	1.2%
200万 M < 500万	1.0%
M ≥ 500万	按笔收取，1000元/笔

### 2、赎回费

#### （1）费率：

本基金的赎回费率不高于0.5%：

持有期限	赎回费率
持有期 < 一年	0.5%
一年 持有期 < 两年	0.25%
持有期 ≥ 两年	0

（2）本基金收取的赎回费中25%的部分归入基金财产。

### 3、转换费

本基金将在未来开放与基金管理人管理的其他基金之间的基金份额的转换，届时基金管理人将会同基金托管人制定基金的转换费收取水平并予公告。

#### （三）其他费用

本基金运作和销售过程中发生的其他费用，以及因故与本基金有关的其他费用，将依照国家法律法规的规定，予以收取和使用。

（四）本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方，基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务；

2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则计算：若基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关的会计制度；

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会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

1、本基金管理人聘请具有证券业从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表进行审计。会计师事务所及其注册会计师须与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，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，须经基金托管人（或基金管理人）同意，在两日内编制更换会计师事务所报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 十八、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《业务规则》、基金合同及其他有关规定。本基金信息披露事项应当在中国证监会规定时间内，通过指定报刊和网站等媒介披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

### （二）基金份额发售公告

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

### （三）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。

### （四）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

### （五）基金资产净值、基金份额净值

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

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

基金管理人应当在半年度和年度最后一个市场交易日的次日，将前日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

#### （六）基金份额申购、赎回价格

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

#### （七）基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

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报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

《基金法》及其他有关法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （八）临时报告

基金发生重大事件，即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，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。重大事件包括：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；

- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

#### （九）基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前三十日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### （十）澄清公告

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

#### （十一）中国证监会规定的其他信息。

（十二）本基金在条件成熟的情况下，为了方便投资者交易本基金，可以增加信息披露的范围。

#### （十三）信息披露文件的存放与查阅

本基金《招募说明书》（包括更新的招募说明书）、基金合同、年度报告、半年度报告、季度报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金代销机构的办公场所和营业场所，投资者可在营业时间免费查阅。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。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

投资人也可直接在基金管理人的网站（<http://www.csfunds.com.cn>）或者上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）查阅信息披露文件。

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保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 十九、风险揭示

本基金主要面临的风险有：与基准指数偏离的跟踪误差风险，流动性风险，市场风险（系统风险），操作风险、技术风险及合规性风险等。

#### （一）跟踪误差风险

跟踪误差反映的是投资组合与跟踪基准之间的偏离程度，是控制投资组合与

基准之间相对风险的重要指标，跟踪误差的大小是衡量指数化投资成功与否的关键。本基金的投资目标是将年跟踪误差控制在4%以内。以下原因可能会影响到基金的跟踪误差扩大，与业绩基准产生偏离：

- 1、基准指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；
- 2、基准指数成份股的调整；
- 3、基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击；
- 4、申购、赎回因素带来的跟踪误差；
- 5、新股发行及新股认购带来的跟踪误差；
- 6、基金现金资产的拖累；
- 7、基金的管理费和托管费带来的跟踪误差；
- 8、指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的偏差；
- 9、由于缺少衍生金融工具，基金建仓期间无法实现对指数的有效跟踪所带来的偏差；
- 10、其他因素带来的偏差。

## （二）流动性风险

### 1、成份股的流动性风险

虽然本基金的业绩基准指数中成份股的流动性相对来说都比较高，但仍不排除可能面临交易量不足所引起的流动性风险，进而影响基金管理人把申购资金及时转化为投资组合和将赎回所需的现金直接变现，以及影响到因基准指数成份股的调整而带来的基金投资组合的调整。

### 2、本基金在二级市场的流动性风险

本基金作为上市开放式基金，可以在二级市场挂牌交易，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

## （三）市场风险

市场风险是指证券市场价格因受各种因素（如政策因素、经济周期波动、利率因素、投资者心理等）的影响而引起的波动，对本基金资产产生潜在风险。本基金作为指数基金，基金收益率的变动与基准指数的变动高度一致，当基准指数因市场原因出现大幅下跌时，会造成基金净值相应下跌的风险。

## （四）基金交易价格与份额净值发生偏离的风险

本基金在证券交易所的交易价格可能不同于份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，虽然基金的份额净值反映基金投资组合的资产状况，但是交易价格受到很多因素的影响，比如中国的经济情况、投资人对于中国股市的信心以及本基金的供需情况等。

#### （五）操作风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等风险。

#### （六）技术系统风险

在基金的申购赎回过程中、各种交易行为或者后台运作中，可能因为软件系统和硬件系统故障而影响申购、赎回和交易的正常进行，从而导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、托管银行、注册登记机构、证券交易所等。

#### （七）网络安全风险

指数据在传递过程中，因通讯故障造成的数据丢失，或因非法入侵等网络安全问题引起的数据被篡改等，从而造成不能正常交易、不能正常交收的风险。

#### （八）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### （九）不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

#### （十）投资者认知风险

可能存在由于投资者对本产品缺乏足够的认知和了解而造成的投资偏离预期的风险。

#### （十一）其他风险

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 二十、基金的终止与基金财产的清算

### （一）基金的终止

1、出现下列情况之一的，本基金经中国证监会批准后终止：

（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，须按法律法规和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终止。

### （二）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）基金财产清算小组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

#### 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3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批准后3个工作日公告。

#### 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、基金合同的内容摘要

### （一）基金合同当事人的权利、义务

#### 1、基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）自本基金合同生效之日起，依法并依照基金合同的规定独立运用基金财产；

（3）依据有关法律规定及本基金合同决定基金收益分配方案；

（4）根据基金合同的规定，获取基金管理费及其他约定和法定的收入；

（5）在符合有关法律法规的前提下，并经中国证监会批准后，制订和调整开放式基金业务规则，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

（6）销售基金份额，获取认（申）购费；

（7）选择和更换代销机构，并对其销售代理行为进行必要的监督；

（8）依照有关法律法规，代表基金行使因运营基金财产而产生的股权、债权及其他权利；

（9）担任注册登记人或选择和更换注册登记代理机构，并对其注册登记代

理行为进行必要的监督；

（10）基金合同规定的情形出现时，决定暂停或拒绝受理基金份额的申购、暂停受理基金份额的赎回申请或延缓支付赎回款项；

（11）核查基金托管人，如认为基金托管人违反基金合同或有关法律法规的规定，呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（12）以自身名义，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；

（13）召集基金份额持有人大会；

（14）在更换基金托管人时，提名新任基金托管人；

（15）法律法规及基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）遵守基金合同；

（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）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回及其他业务或委托其他机构代理这些业务；

（6）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册登记工作或委托其他机构代理该项业务；

（7）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和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；

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

（9）依法接受基金托管人的监督；

（10）按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值；

（11）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；

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

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

（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）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（17）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；

（18）编制基金的财务会计报告；保存基金的会计账册、报表、记录15年以上；

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

（20）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；

（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并通知基金托管人；

（22）因违反基金合同导致基金财产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；

（23）因估值错误导致基金份额持有人的损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（24）基金托管人因违反基金合同造成基金财产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

（25）为基金聘请会计师和律师；

- (26) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (27) 以基金管理人名义代表基金份额持有人利益行使诉讼权及其他权力；
- (28) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (29) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金财产；
- (2) 获取基金托管费；
- (3) 监督和核查本基金的投资运作；
- (4) 监督和核查基金管理人，如认为基金管理人违反基金合同或有关法律法规的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (5) 在更换基金管理人时，提名新任基金管理人；
- (6) 提议召开基金份额持有人大会；
- (7) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

### 4、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (3) 设有专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (4) 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，委托其他人托管基金财产；
- (5) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值；
- (6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (7) 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；
- (8) 设立证券账户、银行存款账户等基金财产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；

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

（10）按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国银监会；

（11）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；

（12）按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录、基金份额持有人名册等15年以上；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定支付基金份额持有人的收益和赎回款项；

（15）参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（16）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；

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

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

（19）不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

（20）监督基金管理人的投资运作；

（21）按照规定召集基金份额持有人大会或配合召开基金份额持有人大会；

（22）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（23）建立并保存基金份额持有人名册；

（24）法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 5、基金份额持有人的权利

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

- (4) 按照法律法规和基金合同规定的要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为要求赔偿或依法提起诉讼；
- (9) 获取基金业务及财务状况的公开资料；
- (10) 法律法规及基金合同规定的其他权利。

## 6、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同及相关业务规则；
- (2) 缴纳基金认购、申购、赎回等事宜涉及的款项，及法律法规和基金合同所规定的费用；
- (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、基金份额持有人及其他基金当事人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易中因任何原因，从基金管理人、基金托管人及基金管理人代理人处获得不当得利；
- (7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会

### 1、召开原则

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每一基金份额拥有平等的投票权。

基金份额持有人大会决议须经基金份额持有人大会审议通过。上述通过事项如无需监管部门批准，则即刻生效；需监管部门批准的，在获得相关批准后生效。

### 2、召开事由

在本基金需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

（1）修改基金合同。但本基金合同另有规定或根据法律法规变更做出相应更改的除外；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）决定终止基金合同；

（5）与其他基金合并；

（6）持有本基金百分之十或以上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）提议召开基金份额持有人大会；

（7）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（8）转换基金运作方式；

（9）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；

（10）变更基金类别；

（11）变更基金的投资目标、投资范围；

（12）变更基金份额持有人大会程序；

（13）对基金当事人权利义务产生重大影响事项；

（14）法律、法规或中国证监会规定的其他情形。

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

（1）因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；

（2）调低基金管理费、基金托管费；

（3）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

（4）对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系的变化；

（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）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）在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持

有人大会的开会时间、地点及权益登记日由基金管理人选择确定；

（2）在更换基金管理人或基金管理人未行使召集权的情况下，由基金托管人召集；

（3）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。

基金管理人应当自收到书面提议之日起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。

（4）在基金管理人和基金托管人均未行使召集权的情况下，单独或合计持有权益登记日百分之十或以上份额的基金份额持有人有权自行召集；若就同一事项出现若干个基金份额持有人提案，则由提出该等提案的基金份额持有人共同推选出代表召集基金份额持有人大会。

（5）代表基金份额百分之十或以上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，代表基金份额百分之十或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。

（6）基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以按照《基金法》第七十二条第二款的规定自行召集基金份额持有人大会。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

（7）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、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前至少三十日，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议的议事程序；
- （4）会议的表决方式；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- （6）代理投票授权委托书送达时间和地点；
- （7）会务常设联系人姓名、电话；
- （8）召集人需要通知的其他事项。

若采取通讯等方式开会并进行表决，会议通知中还应说明本次基金份额持有人大会所采取的具体方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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任何基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

#### 5、召开方式

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开，也可以采取通讯等方式召开。会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人的更换、提前终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表百分之五十以上（含百分之五十）基金份额的持有人参加方可召开，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。

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

（2）通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

召集人应按本基金合同规定公告会议通知；

召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

## 6、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

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。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日前三十日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有三十日的间隔期。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额百分之十或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。

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：

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。

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做出决定。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。

单独或合并持有权利登记日基金总份额百分之十以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、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，法律法规另有规定除外。

## （2）议事程序

### 现场开会

大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额百分之五十以上（不含百分之五十）多数选举产生一名基金份额持有人或其代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（八）款规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

### 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前三十日公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 7、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

一般决议，须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上

（不含百分之五十）通过方为有效，除下列 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。

特别决议，须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（不含三分之二）通过方可做出。更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金合同、转换基金运作方式等重大事项必须以特别决议通过方为有效，但法律法规、本基金合同另有约定的除外。

（3）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（4）采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

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

## 8、计票

### （1）现场开会

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

计票人应在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果；

如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人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。

### （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如基金托管人为召集人，则为基金管理人的授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如果基金管理人或基金

托管人经通知拒不派代表监督计票的，不影响表决的效力。

### 9、生效与公告

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起五日内报中国证监会或其他有权机构核准或者备案，自其核准之日或相关核准另行确定的日期或出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对基金管理人、基金托管人和全体基金份额持有人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在至少一种指定媒体公告。在公告基金份额持有人大会决议时，将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。法律法规或监管机关对基金份额持有人大会有关事项另有规定的，从其规定。

#### （三）基金合同的终止和基金财产的清算

1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

（1）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。

#### 3、清算程序

（1）基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；

（2）清算小组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）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。

#### （四）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。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设在北京的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。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

#### （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。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

长盛中证100指数证券投资基金托管协议（以下简称“本托管协议”）是依据《基金法》《运作办法》和《销售办法》等有关法规及《基金合同》由基金管理人和基金托管人订立。

#### （一）托管协议当事人

本基金托管协议当事人基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

#### （二）基金托管人和基金管理人之间的业务核查

##### 1、基金托管人对基金管理人的业务核查

##### （1）基金托管人对基金管理人的投资行为进行监督和核查

基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关技术系统，对基金投资范围、投资对象进行监督，监督内容包括但不限于：投资范围、投资对象是否符合《基金合同》规定的指数化投资风格等。监督标准包括但不限于：基金是否严格投资于《基金合同》规定的指数成分股、备选成分股和新股（一级市场初次发行或增发）等；基金年跟踪误差是否不超过 4%等。监督的程序为：基金托管人每日日终进行核查，如果发现超过限制规定，将通知基金管

理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）。基金托管人应对基金实际投资是否符合《基金合同》进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例、股票申购限制进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

a 本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规另有规定，本基金权证投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五；本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的百分之三；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

b 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。

c 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

监督的程序为：基金托管人定期或不定期对基金投融资进行核查，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，如果发现超过限制规定，将通知基金管理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金的投资禁止行为实施监督。监督内容和标准包括但不限于：基金是否违反了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相互提供与其有控股关系的股东或有重大利害关系的公司名单）；是否从事了承销证券、向他人贷款或者提供担保；是否从事了承担无限责任的投资等。监督的程序为：基金托管人定期或不定期对基金的禁止投资行为等进行监督核查，如果发现基金管理人违规操作，将通知基金管理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证监会。

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，监督内容包括但不限于：基金的银行间市场投资情况；基金对交易对手的资信控制和交易方式的控制等。监督标准包括但不限

于：基金是否严格按照有关法律法规的规定参与银行间债券市场交易；基金是否严格按照有关风险防范制度对交易对手的资信情况和交易方式进行控制等。监督的程序为：基金托管人定期或不定期对基金参与银行间债券市场的交易行为等进行监督核查，如果发现基金管理人违规操作，将通知基金管理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人还可以根据法律法规的规定及《基金合同》的有关约定，对基金投资的其他方面进行监督。

（2）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。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，则托管银行不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（3）基金托管人发现基金管理人的实际投资运作或投资指令违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时的处理方式和程序。

基金托管人发现基金管理人的实际投资运作有违反《基金法》、《基金合同》、本协议和有关法律法规规定的，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，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限期内纠正的，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投资指令违反《基金法》、《基金合同》、本协议和其它有关规定时，可以拒绝执行，但需立即通知基金管理人。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，同时及时向中国证监会报告。

基金托管人有权利行使法律法规、《基金合同》或本协议赋予、给予、规定基金托管人应有的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和《基金合同》当事人的利益。基金管理人因违反《基金合同》及本协议造成基金财产损失的，基金托管人应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿。

（4）基金管理人义务配合和协助基金托管人依照本协议对基金业务执行

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

2、根据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人应对基金托管人的业务进行核查。

（1）基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于：基金托管人是否安全地保管了基金财产、是否正确地开设了基金财产的资金账户和证券账户、是否合规复核了基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否严格根据管理人的指令办理清算交收、是否合规办理了相关信息披露并对基金投资运作进行监督等。

（2）基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查时应当遵循相应的程序，如果基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，出现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄漏基金投资信息或因基金托管人的其它原因而导致基金财产有所灭失、减损、或处于危险状态等情况时，基金管理人应立即以书面方式要求基金托管人限期纠正和采取必要的补救措施；基金管理人有权在限期内随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人有权报告中国证监会。

（3）基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性；收到基金管理人通知后及时核对；在规定时间内以书面形式对基金管理人发出回函并改正。

（4）如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本协议，基金管理人有权呈报相关监管机构，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本协议赋予、给予、规定的基金管理人应有的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和《基金合同》当事人的利益。基金托管人因违反《基金合同》及本协议造成基金财产损失的，基金管理人应为基金份额持有人的利益向基金托管人追偿。

（5）基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使

核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效核查，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理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）基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人须遵守《基金法》、《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、有效持有并保管基金财产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人应安全、完整地保管基金财产；未经基金管理人的合法指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（4）基金托管人应该按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（5）基金托管人保证其托管的不同基金财产之间相互独立；对不同的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，确保基金财产的完整与独立。

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

（7）基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

（8）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定或约定外，基金托管人不得为自己及任何第三方谋取利益；基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取不当利益，其所得利益归于该基金财产；基金托管人不得将基金财产转为其固有财产，不得将固有资产与基金财产进行交易，或将不同基金财产进行相互交易；违背此款规定的，应承担相应的责任，包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任等。

（9）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定或约定外，基金托管

人不得委托第三方托管基金财产。

## 2、基金成立时募集资金的验证

基金募集期限届满，具备基金备案条件，基金管理人应将募集的全部资金及其在募集期产生的利息存入指定的相应验资专户；由基金管理人聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具书面验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

## 3、基金的银行存款账户的开设和管理

（1）基金托管人应负责本基金的银行存款账户的开设和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行存款账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

（3）本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行与本基金相关业务无关的活动。

（4）基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行存款账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《中国人民银行利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

## 4、基金证券账户和结算备付金账户的开设和管理

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

（2）本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行与本基金相关业务无关的活动。

（3）基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的相关基金在交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

（4）基金证券账户和基金托管人结算备付金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理或变更，而限于上述关于账户开设、使用的规定。

（5）在本托管协议订立日之后，本基金被允许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，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、使用的规定或相关法律法规、业务规则之规定办理。

#### 5、债券托管专户的开设和管理

（1）《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入银行间债券市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向银行监管部门进行报备。

（2）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。

#### 6、基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

#### 7、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由基金托管人、基金管理人共同保管；保管期限不少于 15 年；除另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，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。

#### （四）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值总额除以计算日该基金发行在外的基金份额总份数后的数值。

2、当相关法律法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人与基金托管人应当协商确定新的基金估值方法，若双方经协商未能达成一致，则基金管理人有权按照其选择的估值方法对基金进行估值，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。

3、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、

程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，基金管理人与基金托管人应当协商确定新的基金估值方法，若双方经协商未能达成一致，则基金管理人有权按照其选择的估值方法对基金进行估值，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。

4、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。如基金管理人与基金托管人核对净值一致并公告之后发现估值错误，若估值差错在基金资产净值的 0.5% 以下，基金管理人与基金托管人应及时改正；若估值差错超过基金资产净值的 0.5%，则基金管理人需发布临时公告，由此给基金份额持有人造成的损失由基金管理人与基金托管人共同承担。

5、基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的基金资产净值和基金份额净值，并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人。

6、基金管理人和基金托管人在基金资产净值计算方法上意见不一致且协商不成时，基金管理人有权按照其选择的方法计算基金资产净值，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。

7、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

#### （五）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册等，均由基金管理人和基金托管人负责并分别保管，彼此应及时向对方提供相关信息。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金管理人可以担任注册登记机构，也可以授权其他合格机构担任注册登记机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

基金管理人有权利并有义务持续保管基金份额持有人名册。基金管理人授权其他合格机构担任注册登记机构时，可委托该注册登记机构承担基金份额持有人名册的持续保管义务。注册登记机构对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及相关监管机构的要求执行。基金份额持有人名册通常以书面形式提供，双方另行协商的除外。基金份额持有人名册的保管期限不少于 15 年。

基金管理人应当定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。基金管理人向基金托管人提供基金份额持有人名册的频率为一年不超过 1 次。

基金托管人未能妥善保存基金份额持有人名册，造成基金份额持有人名册毁损、灭失、泄漏基金份额持有人的秘密等，因此给基金份额持有人造成损害的，基金份额持有人有权要求基金托管人回复原状，并赔偿基金份额持有人因此遭受的损失。基金托管人只能将基金份额持有人名册用于履行本协议约定的目的，不得为其他任何目的使用基金份额持有人名册。

#### （六）争议解决方式

基金管理人、基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双方当事人应恪守其职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

#### （七）托管协议的变更与终止

1、本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。本协议变更的内容涉及到需要变更《基金合同》的相关内容的，则在按照《基金合同》规定的程序完成《基金合同》的变更后，本协议的相关内容方可变更。变更后的新协议需报中国证监会核准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；
- （3）管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；

(4) 发生《基金法》、《基金合同》及其他法律法规规定的终止事项。

## 二十三、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，以下是主要的服务项目，基金管理人根据基金份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，有权增加、修改服务项目：

### （一）基金份额持有人注册登记服务

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

### （二）红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该基金份额持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转基金份额，且不收取任何申购费用。

### （三）定期定额投资计划

基金管理人适时通过不同代销机构或长盛基金管理有限公司网上直销为基金份额持有人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，基金份额持有人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，该定期定额申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。

### 网上交易服务

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

### （四）主动通知服务

通过邮寄、电子邮件、短信、主动致电等方式为基金份额持有人提供各项主动通知服务，包括邮寄对账单、发送电子对账单、发送净值短信等等；公司公告及重要信息将通过以上方式主动通知基金份额持有人等服务。

#### （五）查询服务

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

#### （七）在线客服

访问我公司网站“[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)”，登陆在线客服，与投资者网上面对面答疑解惑。

#### （八）多元资料索取

为向基金份额持有人提供详细的专业基金投资资料，便于办理各种交易手续，同时方便基金份额持有人索取，基金管理人提供了多元化的资料索取服务，索取途径多样，资料内容丰富详尽。

所有对外公布文件及各种相关历史文件均可向客户服务人员索取，客户服务人员可通过传真、EMAIL 及邮寄形式提供。

同时，公司网站上提供各种资料、业务表单及公告下载。

#### （九）资讯服务定制

为进一步提高基金运作的透明度，提升服务品质，使基金份额持有人及时了解基金投资资讯，基金管理人推出全方位资讯服务定制项目。基金份额持有人可通过客服热线、公司网站、短信定制各种资讯，公司通过传真、EMAIL、短信等多渠道发送资讯定制服务。

#### （十）投资业务咨询

基金管理人拥有一支训练有素、专业知识全面的投资顾问队伍，为更好地与基金份额持有人进行沟通，公司的专业客户服务代表在工作时间内回答客户提出的问题，提供关于基金投资全方位的咨询服务。

同时，还提供网上短信息交流及手机短信息交流。

#### （十一）投诉建议受理

如果对基金管理人提供的各种服务感到不满或有其他需求，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等各种方式随时向基金管理人提出，也可直接与客户服务人员联系，基金管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉；同时，基金份额持有人的合理建议是基金管理人发展的动力与方向。

（十二）语音留言服务

为加强沟通和联系，基金管理人在任何时间均提供语音留言服务，将基金份额持有人疑问或意见保存，客户服务人员将及时进行处理。

（十三）客服互动活动

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

（十四）长盛客户服务中心联系方式

长盛基金管理有限公司客户服务热线：（010）62350088

400-888-2666

长盛基金管理有限公司网址：[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)

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

## 二十四、其他应披露的事项

（一）本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

（二）最近3年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）2009年5月25日本基金管理人发布关于开通招商银行卡网上支付的公告。

（四）2009年6月24日本基金管理人发布长盛中证100指数证券投资基金招募说明书更新全文及其摘要。

（五）2009年7月21日本基金管理人发布长盛中证100指数证券投资基金2009年度第2季度报告。

（六）2009年7月22日本基金管理人发布关于增加华夏银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告。

（七）2009年8月27日本基金管理人发布长盛基金管理有限公司关于调整部分开放式基金分红业务处理规则的公告。

（八）2009年8月27日本基金管理人发布长盛中证100指数证券投资基金2009年半年度报告及其摘要。

（九）2009年8月27日本基金管理人发布关于在安信证券股份有限公司开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告。

（十）2009年9月4日本基金管理人发布关于旗下基金参与中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告。

（十一）2009年9月15日本基金管理人发布长盛基金关于调整停牌股票估值方法的提示性公告。

（十二）2009年9月17日本基金管理人发布关于旗下基金通过中信银行股份有限公司开办定期定额申购业务的公告。

（十三）2009年9月24日本基金管理人发布关于旗下基金拟投资创业板上市证券及其风险提示的公告。

（十四）2009年9月25日本基金管理人发布关于增加华宝证券有限责任公司和江南证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构的公告。

（十五）2009年10月19日本基金管理人发布长盛基金管理有限公司关于开通工商银行卡网上支付的公告。

（十六）2009年10月28日本基金管理人发布长盛中证100指数证券投资基金2009年度第3季度报告。

（十七）2009年10月30日本基金管理人发布关于农业银行系统升级暂停网上银行服务的通知。

## 二十五、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和登记注册人的办公场所和营业场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十六、备查文件

- （一）中国证监会批准长盛中证 100 指数证券投资基金设立的文件
- （二）法律意见书
- （三）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （四）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （五）《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》
- （六）《长盛中证 100 指数证券投资基金登记结算服务协议》
- （七）《长盛中证 100 指数证券投资基金托管协议》
- （八）《长盛中证 100 指数证券投资基金注册登记与登记过户委托代理协议》
- （九）中国证监会规定的其它文件

长盛基金管理有限公司

二〇〇九年十二月二十五日