

长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资 基金基金合同的内容摘要

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

一、前言

(一) 订立本基金合同的目的、依据和原则

1. 订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益,明确基金合同当事人的权利义务,规范基金运作。

2. 订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《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》”)和其他有关法律法规。

3. 订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

(二) 基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与基金合同有冲突,均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。

(三) 长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称

“中国证监会”)核准。

中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对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。

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,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(四)基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息,其内容涉及界定本基金合同当事人之间权利义务关系的,如与本基金合同有冲突,以本基金合同为准。

二、基金合同当事人的权利、义务

(一)基金管理人

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：北京海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

邮政编码：100088

法定代表人：凤良志

成立时间：1999 年 3 月 26 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[1999]6 号

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币壹亿伍仟万元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；及中国证监会许可的其他业务。

(二)基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年9月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

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

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

(三) 基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书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。

在本基金分级运作期内，长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额、长盛同辉深 100 等权重份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。但本基金依据基金合同第四部分“分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则”之规定对长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额进行参考净值计算时，持有长盛同辉深 100 等权重份额的基金份额持有人将被视作其同时持有按 1:1 的比例分拆的长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额，并将分别按分拆后的长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额数享有并行使份额折算的权利。

分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后，每份长盛同辉深 100 等权重份额具有同等的合法权益。

(四) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

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. 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
3. 发售基金份额;
4. 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
5. 在符合有关法律法规的前提下,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,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;
6. 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当事人的利益;
7. 在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
8. 在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;
9. 自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
10. 选择、更换代销机构,并依据基金销售服务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;
11. 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
12. 在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
13. 依法召集基金份额持有人大会;
14. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(五)基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:

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

2. 办理基金备案手续；
3. 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5. 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；
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、参考净值，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. 编制中期和年度基金报告；
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. 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；

24. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

25. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26. 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(六) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1. 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

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，依法保管基金资产；

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，对基金资产、其他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资料；

8. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

(七) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

1. 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. 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；
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、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；
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；
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、参考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. 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. 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. 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和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21. 执行生效的基金份额持有人大会决议；

22. 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23. 建立并保存基金份额持有人名册；

24. 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(八) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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. 依法申请赎回其持有的基金份额；

4. 按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7. 监督基金管理人的投资运作；

8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

(九) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2. 交纳基金认购、申购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. 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
 7. 法律法规和基金合同规定的其他义务。
- (十) 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

三、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

1. 在分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额持有人独立进行表决。长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

2. 本基金分级运作期到期，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人将按其所持上市开放式基金的每一基金份额享有相应的投票权。

(二) 召开事由

1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%及以上（在分级运作期内，指单独或合计持有长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额 10%及以上）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式，但本基金封闭分级运作期到期后转为上市开放式基金（LOF）除外；

- (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)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (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)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发生重大变化；
- (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)标的指数更名或调整指数编制方法；
- (7)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。

(三)召集人和召集方式

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

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

3.代表基金份额 10%及以上（在分级运作期内，指单独或合计持有长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额 10%及以上）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 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%及以上（在分级运作期内，指单独或合计持有长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额 10%及以上）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%及以上（在分级运作期内，指单独或合计持有长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额 10%及以上）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%及以上（在分级运作期内，指单独或合计持有长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额 10%及以上）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。

(四)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 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1)会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2)会议拟审议的主要事项；
- (3)会议形式；

- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6) 代理投票的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、书面表决意见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。

(五) 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和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,如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)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，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%及以上(在分级运作期内，指全部有效凭证所对应的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额应分别占权益登记日长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额的 50%及以上)；

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

(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)召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3)召集人在监督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，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4)本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%及以上(在分级运作期内，指全部有效凭证所对应的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额应分别占权益登记日长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额的 50%及以上)；

5)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、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。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(六) 议事内容与程序

1. 议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合计持有权益登记日本基金总份额 10% 及以上（在分级运作期内，指单独或合计持有权益登记日长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额 10% 及以上）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。

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

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。

(4) 单独或合计持有权益登记日基金总份额 10% 及以上（在分级运作期内，指单独或合计持有权益登记日长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自基金份额 10% 及以上）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,应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。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。

大会由召集人授权代表主持。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以所持表决权的 50%及以上(在分级运作期内,指出席大会的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额的基金份额持有人和代理人以其在各自基金份额类别内所持表决权的 50%及以上)多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、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后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(七) 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。在分级运作期内,基金份额持有人大会的审议事项应分别由长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额持有人独立进行表决,且长

盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额在其份额类别内拥有同等的投票权。

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

一般决议须经出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 及以上（在分级运作期内，指出席大会的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自的基金份额持有人和代理人在其各自基金份额类别内所持表决权的 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

特别决议须经出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的三分之二及以上（在分级运作期内，指出席大会的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自的基金份额持有人和代理人在其各自基金份额类别内所持表决权的三分之二及以上）通过方为有效；涉及更换基金管理人、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。

(八) 计票

1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持

有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会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，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(九) 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决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十) 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。

四、分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则

（一）分级运作期的界定

本基金的分级运作期为五年，自基金合同生效日开始，至满五年的对应日结束，如该对应日为非工作日，则该分级运作期到期日顺延至下一个工作日。分级运作期开始后，场内的初始长盛同辉深 100 等权重份额将按照 1:1 的比例自动分离为长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额。

在分级运作期内，场内长盛同辉深 100 等权重份额可以按照 1:1 的比例分拆为长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额在深圳证券交易所上市交易；场内与场外长盛同辉深 100 等权重份额开放申购、赎回业务；场内的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额开放配对转换业务。分级运作期到期后，本基金将转换为上市开放式基金（LOF）。

（二）分级运作期内基金份额结构

本基金的基金份额包括长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额。其中，长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

（三）场内基金份额的分拆规则

基金发售结束后，投资者场内认购的全部长盛同辉深 100 等权重份额将按 1:1 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额，两类基金份额的基金资产合并运作。

本基金合同生效后，长盛同辉深 100 等权重份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易；长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额两类基金份额将同时在深圳证券交易所不同的交易代码分别上市交易，但不可单独进行申购或赎回。

投资者可在场内申购和赎回长盛同辉深 100 等权重份额。投资者可选择将其场内申购的同辉份额按 1:1 的比例分拆成长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额，投资者亦可按 1:1 的配比将其持有的长盛同辉深 100

等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额申请合并为长盛同辉深 100 等权重份额后赎回。

投资者在场外认购和申购的长盛同辉深 100 等权重份额不进行分拆 ;通过跨系统转托管至场内并申请分拆后 ,其持有的长盛同辉深 100 等权重份额将按 1:1 的比例分拆为长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额。投资者可按 1:1 的比例将其持有的长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额合并为长盛同辉深 100 等权重份额后赎回。

(四)分级运作期内长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值计算规则

本基金份额所分拆的长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额在分级运作期内具有不同的参考净值计算规则 ,长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额的风险和收益特性不同。

在分级运作期内 ,本基金净资产优先分配予长盛同辉深 100 等权重 A 份额的本金及约定应得收益 ,则长盛同辉深 100 等权重 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额 ;本基金在优先分配长盛同辉深 100 等权重 A 份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产分配予长盛同辉深 100 等权重 B 份额 ,则长盛同辉深 100 等权重 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。

长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值计算规则如下 :

(1) 长盛同辉深 100 等权重 A 份额约定年收益率 R_A 为 :“ 7.0% ”。

(2) 分级运作期内每个工作日计算长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值。在进行长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自的份额参考净值计算时 ,本基金净资产优先确保长盛同辉深 100 等权重 A 份额的本金及长盛同辉深 100 等权重 A 份额的累计约定日应得收益 ,之后的剩余净资产计为长盛同辉深 100 等权重 B 份额的净资产。长盛同辉深 100 等权重 A 份额累计约定日应得收益按依据长盛同辉深 100 等权重 A 份额约定年收益率计算的每日收益率和截至计算日长盛同辉深 100 等权重 A 份额应计收益的天数确定。

(3) 在基金份额首次折算之前 ,长盛同辉深 100 等权重 A 份额在参考净值

计算日应计收益的天数按分级运作期起始日至计算日的实际天数计算；基金份额首次折算之后，长盛同辉深 100 等权重 A 份额在参考净值计算日应计收益的天数按最近一次基金份额折算基准日（包括定期折算和不定期折算，详见本基金合同“二十二、分级运作期内基金份额的折算”）至计算日的实际天数计算。

（4）分级运作期到期，对投资者持有到期的每一份长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额，按照基金合同所约定的参考净值计算规则分别计算长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额分级运作期末参考净值，并按照各自的份额参考净值转换为上市型开放式基金（LOF）份额。分级运作期到期，长盛同辉深 100 等权重份额基金转换规则详见本基金合同“二十三、分级运作期到期后基金份额的转换”。

基金管理人并不承诺或保证长盛同辉深 100 等权重 A 份额的基金份额持有人的约定应得收益，如在某一会计年度内本基金资产出现极端损失情况下，长盛同辉深 100 等权重 A 份额的基金份额持有人可能会面临无法取得约定应得收益甚至损失本金的风险。

（五）T 日长盛同辉深 100 等权重份额净值的计算

T 日长盛同辉深 100 等权重份额净值 = T 日本基金的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的余额数量

其中，基金资产净值为基金资产总值减去负债后的价值；本基金基金份额的余额数量为长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额的余额数量之和。

长盛同辉深 100 等权重份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。T 日的长盛同辉深 100 等权重份额净值在当天收市后计算，并在下一日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（六）分级运作期内 T 日长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值的计算

$$NAV_A = 1 + (R_A / N) \times t ;$$

$$NAV_B = 2 \times NAV_{同辉} - NAV_A ;$$

其中：

$NAV_{\text{同辉}}$ 为 T 日长盛同辉深 100 等权重份额净值；

NAV_A 为 T 日长盛同辉深 100 等权重 A 份额参考净值；

NAV_B 为 T 日长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值；

R_A 为长盛同辉深 100 等权重 A 份额约定年收益率，即 7.0%；

N 为计算长盛同辉深 100 等权重 A 份额收益率的除数，分级运作期内每年确定一次，(1) 当分级运作期起始日=T 日=第一次定期折算基准日时， N 为分级运作期起始日至第一次定期折算基准日的实际天数；(2) 当第一次定期折算基准日 < T 日=第二次定期折算基准日时， N 为第一次定期折算基准日次日至第二次定期折算基准日的实际天数；(3) 当第二次定期折算基准日 < T 日=第三次定期折算基准日时， N 为第二次定期折算基准日次日至第三次定期折算基准日的实际天数；(4) 当第三次定期折算基准日 < T 日=第四次定期折算基准日时， N 为第三次定期折算基准日次日至第四次定期折算基准日的实际天数；(5) 当第四次定期折算基准日 < T 日=分级运作期到期日时， N 为第四次定期折算基准日次日至分级运作期到期日的实际天数。关于定期折算基准日的约定，详见本基金合同“二十三、分级运作期到期后基金份额的折算”；

t 为长盛同辉深 100 等权重 A 份额在参考净值计算日应计收益的天数， $t = \min\{\text{分级运作期起始日至 T 日，最近一次折算基准日次日至 T 日}\}$ 。

长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值在当天收市后计算，并在下一日内与长盛同辉深 100 等权重份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

五、基金份额的上市与交易

(一) 上市交易的基金份额

本基金分级运作期内，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额将在深圳

证券交易所上市与交易。

本基金分级运作期到期后,长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额将终止在深圳证券交易所上市,并分别按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金(LOF)基金份额,转换后的上市开放式基金(LOF)份额在深圳证券交易所上市与交易。场内的长盛同辉深 100 等权重份额直接转换为上市开放式基金(LOF)份额,并在深圳证券交易所上市交易;场外的长盛同辉深 100 等权重份额跨系统转托管至场内后,方可在深圳证券交易所上市交易。

(二) 上市交易的地点

本基金上市交易地点为深圳证券交易所。

本基金分级运作期内,登记在中国证券登记结算有限公司深圳分公司场内证券登记结算系统中的长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的长盛同辉深 100 等权重份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记结算系统并成功分拆为长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额后,长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额方可上市交易。

本基金分级运作期到期后,长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额将终止在深圳证券交易所上市,并分别按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金(LOF)基金份额,转换后的基金份额可直接在深圳证券交易所上市与交易;登记在中国证券登记结算有限公司注册登记(TA)系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务转至场内证券登记结算系统后,方可上市交易。

(三) 上市交易的时间

分级运作期起始后三个月内,长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额开始在深圳证券交易所上市交易。

分级运作期到期转换为上市开放式基金(LOF)后三个月内,上市开放式基金(LOF)基金份额开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后,基金管理人应依据法律法规规定在指定媒体上刊

登《上市交易公告书》。

（四）上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

1. 本基金分级运作期内，长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的参考净值；
2. 本基金分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）基金份额后，上市开放式基金（LOF）基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日的基金份额净值；
3. 本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
4. 本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
5. 本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
6. 本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

（五）上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

（六）上市交易的行情揭示

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

（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

（八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

六、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二)基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(三)收益分配原则

1.在本基金分级运作期内，收益分配应遵循下列原则：

(1)在分级运作期内，本基金（包括长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额和长盛同辉深 100 等权重份额）不进行收益分配；

(2)分级运作期到期后，按照本基金所约定的参考净值计算规则，单独计算出长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额各自的份额参考净值并转换为上市开放式基金（LOF）份额，基金份额持有人可通过赎回上市开放式（LOF）基金份额实现应得收益。

2.本基金分级运作期到期并转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金收益分配应遵循下列原则：

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2)收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3)本基金收益每年最多分配 4 次，每次每份基金份额收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%；

(4)场外申购的，登记在注册登记系统的基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，场外基金份额持有人可以事先选择将所获现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(5)场内申购和上市交易的，登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式只能为现金分红，基金份额持有人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所和中国证券登记结算有限公司的相关规定；

(6)基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的

时间不得超过 15 个工作日；

(7)基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(8)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(四)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、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)收益分配的时间和程序

1.基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案；

2.在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

七、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.基金财产拨划支付的银行费用；
- 4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7.基金的证券交易费用；
- 8.基金的开户费用、账户维护费用；
- 9.在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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，经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、休息日，支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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，经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、休息日，支付日期顺延。

3.除管理费、托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基

金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

八、基金的投资

(一) 投资目标

本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现对于深证 100 等权重指数的有效跟踪。

(二) 投资范围

本基金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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90% - 95%，其中投资于深证 100 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，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%。

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。

(三) 标的指数

本基金的标的指数是深证 100 等权重指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的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标的指数不宜继续作为标的指数，或

证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，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，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，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标的指数。

由于上述原因变更标的指数，基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准，并在指定媒体上公告。

(四) 投资策略

本基金采用完全复制法，按照成份股在深证 100 等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪深证 100 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证 100 等权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1. 资产配置策略

本基金管理人主要按照深证 100 等权重指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90% - 95%，其中投资于深证 100 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中，权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，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 5%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。

2. 股票投资组合构建

(1) 组合构建原则

本基金通过完全复制指数的方法，根据深证 100 等权重指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。

(2) 组合构建方法

本基金采用完全复制法，按照成份股在深证 100 等权重指数中的基准权重构

建股票投资组合。当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证 100 等权重指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

(3) 组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据深证 100 等权重指数成份股组成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和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化,对股票投资组合进行实时调整,以力争实现基金净值增长率与深证 100 等权重指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使本基金的股票投资组合比例符合基金合同的约定。

定期调整

根据深证 100 等权重指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

临时调整

A.当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B.根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪深证 100 等权重指数;

C.根据法律法规的规定,成份股在深证 100 等权重指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

其他调整

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,认购的非成份股将在规定持有期之后的一定时间以内卖出。

(4) 投资绩效评估

在正常市场情况下,本基金力争年跟踪误差不超过 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误差进一步扩大。

3.债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

4.权证投资策略

在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则对权证进行投资,即根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。

(五)业绩比较基准

本基金业绩比较基准: $95\% \times \text{深证 100 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率(税后)}$ 。

本基金认为,该业绩比较基准目前能够有效地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准。本基金变更业绩比较基准应报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒体上及时公告。

(六)风险收益特征

从基金资产整体运作来看,本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,长盛同辉深 100 等权重 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;长盛同辉深 100 等权重 B

份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

(七) 投资管理程序

1. 投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2. 投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策，以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整等决策。

3. 投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合，构成了本基金的投资管理程序。

(1) 研究。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台，整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果，开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告，定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会会议，对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建。结合研究报告，基金经理主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险。

(4) 交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行，交易部同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，并撰写相关的绩效评估报告，确认基金组合是否实现了投资预期，投资策

略是否成功，并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。

(6) 组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况，结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，根据环境的变化和基金实际投资的需要，有权对上述投资程序做出调整，并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

(八) 投资限制

1. 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 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%；

(2) 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；

(3) 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90% - 95%，其中投资于深证 100 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；

(4) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8)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%；

(9)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；

(10)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。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，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，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，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者与其基金管理人、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)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9)法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

(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.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2.不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3.有利于基金财产的安全与增值；

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(十)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

(十一)本基金分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后的投资策略

本基金分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的名称变更为“长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）”；变更后的上市开放式基金（LOF）的投资策略与转换前本基金的投资策略保持不变。

九、基金资产净值的计算方式和公告

(一)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。

(二)基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

本基金合同生效后，本基金分级运作期内，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、长盛同辉深100等权重份额净值和长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额参考净值。

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，通过基金管理人网站、代销机构以及其他媒介，披露开放日的长盛同辉深

100 等权重份额净值、长盛同辉深 100 等权重份额累计净值和长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、长盛同辉深 100 等权重份额净值和长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、长盛同辉深 100 等权重份额净值、长盛同辉深 100 等权重份额累计净值和长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

十、分级运作期内基金份额的折算

（一）基金份额的定期折算

在分级运作期内，在自分级运作期起始日后满一年、满两年、满三年、满四年的对应日（若该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日），本基金将按照以下规则对长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额进行基金份额的定期折算。

1. 基金份额折算基准日

分级运作期起始日后满一年、满两年、满三年、满四年的对应日，若该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

例如，假设本基金分级运作期起始日为 2012 年 5 月 25 日（周五），根据本基金合同“四、分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则”对“分级运作期”的界定，则该分级运作期到期日为 2017 年 5 月 24 日（周三）。2012 年 5 月 25 日满一年的对应日为 2013 年 5 月 24 日（周五），满两年的对应日为 2014 年 5 月 24 日（周六），满三年的对应日为 2015 年 5 月 24 日（周日），满四年的对应日为 2016 年 5 月 24 日（周二），则根据上述规定本基金的定期折算基准日分别为 2013 年 5 月 24 日（周五）、2014 年 5 月 26 日（周一）、2015 年 5 月 25 日（周一）、2016 年 5 月 24 日（周二）。

2. 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额。

3.基金份额定期折算次数

四次。

4.基金份额折算方式

长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额按照本合同规定的参考净值计算规则进行计算；对于长盛同辉深 100 等权重 A 份额的约定应得收益，即定期折算基准日长盛同辉深 100 等权重 A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同辉深 100 等权重份额分配给长盛同辉深 100 等权重 A 份额持有人；同辉 B 份额的参考净值和份额数不进行折算；长盛同辉深 100 等权重份额持有人持有的每份长盛同辉深 100 等权重份额将按持有 0.5 份长盛同辉深 100 等权重 A 份额获得新增长盛同辉深 100 等权重份额的分配，场外长盛同辉深 100 等权重份额的持有人将按前述折算方式获得新增场外长盛同辉深 100 等权重份额的分配，场内长盛同辉深 100 等权重份额的持有人将按前述折算方式获得新增场内长盛同辉深 100 等权重份额的分配。

经过上述份额折算，长盛同辉深 100 等权重 A 份额参考净值和长盛同辉深 100 等权重份额净值将相应调整。

1) 长盛同辉深 100 等权重 A 份额

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$$

$$NAV_{\text{同辉}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长盛同辉深 100 等权重份额的资产净值} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times 0.5 \times NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}}$$

长盛同辉深 100 等权重 A 份额持有人新增的场内长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{同辉}}^{\text{后}}}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数；

$NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额数；

$NAV_{\text{同辉}}^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重份额的份额净值；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额参考净值。

2) 长盛同辉深 100 等权重 B 份额

长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值及份额数不进行定期折算。

3) 长盛同辉深 100 等权重份额

$$NAV_{\text{同辉}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长盛同辉深 100 等权重份额的资产净值} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times 0.5 \times NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}}$$

长盛同辉深 100 等权重份额持有人新增的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}} \times 0.5 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{同辉}}^{\text{后}}}$$

其中，

$NAV_{\text{同辉}}^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重份额的份额净值；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额参考净值；

$NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额数。

定期份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额的份额数
 = 定期份额折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额数
 + 长盛同辉深 100 等权重 A 份额持有人新增的长盛同辉深 100 等权重份额的份
 额数
 + 长盛同辉深 100 等权重份额持有人新增的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数
 场内的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额折算成
 的新增场内长盛同辉深 100 等权重份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），
 余额计入基金财产。场外的长盛同辉深 100 等权重份额折算成的新增场外长盛同
 辉深 100 等权重份额的份额数四舍五入后保留到小数点后两位，由此产生的误差
 计入基金财产。

（二）基金份额的不定期折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，
 即：当长盛同辉深 100 等权重份额净值达到 2.000 元后（含 2.000 元，下同）和
 当长盛同辉深 100 等权重 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元以下后（不含
 0.250 元，下同）。

1. 当长盛同辉深 100 等权重份额净值达到 2.000 元后，本基金将按照以下
 规则进行基金的不定期折算。

(1) 基金份额折算基准日

长盛同辉深 100 等权重份额的基金份额净值达到 2.000 元，基金管理人即可确定折算基准日。

(2) 基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额。

(3) 基金份额折算频率

不定期。

(4) 基金份额折算方式

当长盛同辉深 100 等权重份额的基金份额净值达到 2.000 元后，本基金将分别对长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额和长盛同辉深 100 等权重份额进行折算，折算后本基金将确保长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额的比例为 1:1，份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额净值以及长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值均调整为 1.000 元。

1) 长盛同辉深 100 等权重 A 份额

份额折算原则：

i) 份额折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数与份额折算后长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数相等；

ii) 长盛同辉深 100 等权重 A 份额持有人份额折算后获得新增的长盛同辉深 100 等权重份额，即参考净值超出 1.000 元以上的部分全部折算为场内长盛同辉深 100 等权重份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_A^{\text{前}}$$

$$\begin{aligned} & \text{长盛同辉深100等权重A份额持有人新增的场内长盛同辉深100等权重份额的份额数} \\ &= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000} \end{aligned}$$

其中， $NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额参考净值。

2) 长盛同辉深 100 等权重 B 份额

份额折算原则：

i) 份额折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额数与份额折算后长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额数相等,且份额折算后长盛同辉深 100 等权重 B 份额与长盛同辉深 100 等权重 A 份额保持 1:1 配比；

ii) 份额折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的资产与份额折算后长盛同辉深 100 等权重 B 份额的资产及其新增场内长盛同辉深 100 等权重份额的资产之和相等；

iii) 份额折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的持有人在份额折算后将持有同辉 B 份额与新增场内长盛同辉深 100 等权重份额。

$$NUM_B^{\text{后}} = NUM_B^{\text{前}}$$

$$\begin{aligned} & \text{长盛同辉深 100 等权重 B 份额持有人新增的场内 长盛同辉深 100 等权重份额的份额数} \\ &= \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)}{1.000} \end{aligned}$$

其中， $NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额参考净值。

3) 长盛同辉深 100 等权重份额

份额折算原则：

场外长盛同辉深 100 等权重份额持有人份额折算后获得新增场外长盛同辉深 100 等权重份额,场内长盛同辉深 100 等权重份额持有人份额折算后获得新增场内长盛同辉深 100 等权重份额。

长盛同辉深100等权重份额持有人新增的长盛同辉深100等权重份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}} \times (NAV_{\text{同辉}}^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中， $NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额数；

$NAV_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额净值。

不定期份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

= 不定期份额折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

+ 长盛同辉深 100 等权重 A 份额持有人新增的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

+ 长盛同辉深 100 等权重 B 份额持有人新增的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

+ 长盛同辉深 100 等权重份额持有人新增的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

场内的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额折算成的新增场内长盛同辉深 100 等权重份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。场外的长盛同辉深 100 等权重份额折算成的新增场外长盛同辉深 100 等权重份额的份额数四舍五入后保留到小数点后第 2 位，由此产生的误差计入基金财产。

2. 当长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值跌至 0.250 元以下后，本基金将按照以下规则对基金份额进行不定期折算。

（1）基金份额折算基准日

长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值跌至 0.250 元以下后，基金管理人即可确定折算基准日。

（2）基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额。

（3）基金份额折算频率

不定期。

（4）基金份额折算方式

当长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值跌至 0.250 元以下后，本基金将分别对长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额的比例为 1:1，份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额净值以及长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值均调整为 1.000 元。

1) 长盛同辉深 100 等权重 B 份额

份额折算原则：

份额折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的资产与份额折算后长盛同辉深 100 等权重 B 份额的资产相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NUM_B^{\text{前}} \times NAV_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额参考净值。

2) 长盛同辉深 100 等权重 A 份额

份额折算原则：

i) 份额折算前后长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额始终保持 1:1 配比；

ii) 份额折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的持有人在份额折算后将持有长盛同辉深 100 等权重 A 份额与新增场内长盛同辉深 100 等权重份额；

iii) 份额折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的资产等于份额折算后长盛同辉深 100 等权重 A 份额的资产与其新增场内长盛同辉深 100 等权重份额的资产之和。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$

长盛同辉深100等权重A份额持有人新增的场内长盛同辉深100等权重份额的份额数

$$= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后长盛同辉深 100 等权重 B 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重 A 份额的份额参考净值。

3) 长盛同辉深 100 等权重份额

份额折算原则：

份额折算前长盛同辉深 100 等权重份额的资产与份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额的资产（不含长盛同辉深 100 等权重 A 份额折算后新增的长盛同辉

深 100 等权重份额的资产) 相等。

长盛同辉深100等权重份额持有人不定期折算后持有的长盛同辉深100等权重份额的份额数

$$= \frac{NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{同辉}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额数；

$NAV_{\text{同辉}}^{\text{前}}$ 为折算前长盛同辉深 100 等权重份额的份额净值。

不定期份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

= 不定期份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额持有人持有的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

+ 长盛同辉深 100 等权重 A 份额持有人新增的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数

场内的长盛同辉深 100 等权重份额、长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额折算后的份额数取整计算(最小单位为 1 份), 余额计入基金财产。场外的长盛同辉深 100 等权重份额折算后的份额数四舍五入后保留到小数点后第 2 位, 由此产生的误差计入基金财产。

(三) 基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额的上市交易和同辉份额的申购或赎回等相关业务, 具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(四) 基金份额折算结果的公告

基金份额折算结束后, 基金管理人应按照《信息披露办法》在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告折算结果, 并报中国证监会备案。

(五) 特殊情形的处理

若在定期折算基准日发生基金合同约定的本基金不定期份额折算的情形时, 基金管理人本着维护基金份额持有人利益的原则, 根据具体情况选择按照定期份额折算的规则或者不定期份额折算的规则进行份额折算。

十一、分级运作期到期后基金份额的转换

（一）分级运作期到期后基金的存续形式

本基金分级运作五年后，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF）。

本基金在分级运作期到期后，按照本基金合同参考净值计算规则分别对长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额计算分级运作期到期日基金份额参考净值，并按照各自的份额参考净值转换为上市开放式基金（LOF）份额，转换后的上市开放式基金（LOF）份额在深圳证券交易所上市与交易。场内的长盛同辉深 100 等权重份额直接转换为上市开放式基金（LOF）份额，并在深圳证券交易所上市交易；场外的长盛同辉深 100 等权重份额跨系统转托管至场内后，方可在深圳证券交易所上市交易。

（二）分级运作期到期后的份额转换规则

（1）在本基金分级运作期到期后，对投资者持有每一份长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额，将按照本基金所约定的资产收益分配规则分别计算长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额分级运作期到期日参考净值，以该参考净值作为长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额分级运作期各自的基金份额净值，并按照各自的份额净值转换为同辉基金上市开放式基金（LOF）份额。无论基金份额持有人单独持有或同时持有长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额，均无需支付转换基金份额的费用。

（2）长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额的分级运作期期末份额转换

1) 转换基准日确定

本基金所分拆的长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额转换基准日为本基金分级运作期到期日，即分级运作期起始日后满五年的对应日，如该对应日为非工作日，则分级运作期到期日顺延到下一个工作日。转换基准日确定日期，届时见基金管理人公告。

2) 转换方式及份额计算

转换基准日日终，基金管理人将根据长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额的基金份额转换比例对基金份额持有人转换基准日登记在册的基金份额实施转换。转换后，长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额持有人基金份额数按照转换规则将相应增加或减少。本基金分级运作期期末转换基准日的长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值计算见本基金合同“四、分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则”。

长盛同辉深 100 等权重 A 份额基金份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额基金份额转换公式为：

长盛同辉深 100 等权重 A 份额转换为长盛同辉深 100 等权重份额数 = 转换前长盛同辉深 100 等权重 A 份额基金份额数 × T 日长盛同辉深 100 等权重 A 份额基金份额参考净值 / T 日基金份额净值

长盛同辉深 100 等权重 B 份额转换为长盛同辉深 100 等权重份额数 = 转换前长盛同辉深 100 等权重 B 份额基金份额数 × T 日长盛同辉深 100 等权重 B 份额基金份额参考净值 / T 日基金份额净值

转换后得到的长盛同辉深 100 等权重份额的份额数，场外保留到小数点后 2 位，场内保留到整数位，采用循环进位的方法分配因小数点运算引起的剩余份额。

（三）基金转换后申购与赎回的计算

为保证基金份额转换期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额的上市交易和长盛同辉深 100 等权重份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

转换完成后，基金管理人将向深圳证券交易所申请终止长盛同辉深 100 等权重 A 份额与长盛同辉深 100 等权重 B 份额的上市交易，基金份额净值将在转换基准日长盛同辉深 100 等权重份额净值的基础上变动，转换基准日后的长盛同辉深 100 等权重份额申购、赎回以申购、赎回当日的长盛同辉深 100 等权重份额净值计算申购份额、赎回款项。份额转换后的本基金开放份额申购、赎回日期，届时见基金管理人公告。

（四）基金转换后 T 日长盛同辉深 100 等权重份额净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日长盛同辉深 100 等权重份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日长盛同辉深 100 等权重份额的余额数量

长盛同辉深 100 等权重份额净值的计算,保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在下一日内公告。如遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

(五) 分级运作期到期后基金的投资管理

分级运作期到期后,如本基金继续存续,则本基金将按基金合同的约定变更为非分级的指数型基金,基金名称相应变更为“长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金(LOF)”。变更后,本基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围不变;但基金份额的分拆与收益分配以及基金份额的折算等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人协商一致后,可不经基金份额持有人大会决议,在报中国证监会备案后公告,并在更新的招募说明书中予以说明。

(六) 分级运作期到期的公告

(1) 分级运作期到期后,本基金将转换为上市开放式基金(LOF),基金管理人将在临时公告或在更新的招募说明书中公告相关规则。基金管理人可以修改相关规则,并将在临时公告或更新的招募说明书中公告。

(2) 在分级运作期到期前三十个工作日,基金管理人还将进行提示性公告。

(3) 长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额进行份额转换结束后,基金管理人将按照相关规定进行公告。

十二、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. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的,应召开基金份额持有人大会,基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 转换基金运作方式,但本基金分级运作期到期后转为上市开放式基金(LOF)除外;

- (2)变更基金类别；
- (3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (4)变更基金份额持有人大会程序；
- (5)更换基金管理人、基金托管人；
- (6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- (7)本基金与其他基金的合并；
- (8)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (9)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，并报中国证监会备案：

- (1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (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)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发生重大变化；
- (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)标的指数更名或调整指数编制方法；
- (7)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应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

(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.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;

4.中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

2.基金财产清算程序

基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:

- (1)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;
- (2)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;
- (3)对基金财产进行清理和确认;
- (4)对基金财产进行估价和变现;
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- (6)聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9)公布基金财产清算结果;
- (10)对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

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

4.基金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。

5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；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，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

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保存 15 年以上。

十三、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与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，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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。

本基金合同受中国法律管辖。

十四、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

(一)基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份

外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(二)本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。