

# 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2012 年 4 月 25 日证监许可〔2012〕549 号文核准的《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议》，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金”。自 2012 年 5 月 12 日起，由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动而波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资有风险，投资人申购本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。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净

值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2013 年 5 月 12 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

重要提示 .....	2
目 录 .....	4
一、绪言 .....	5
二、释义 .....	6
三、基金管理人 .....	13
四、基金托管人 .....	22
五、相关服务机构 .....	26
六、基金的历史沿革 .....	44
七、基金的存续 .....	45
八、分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则 .....	46
九、基金份额的上市交易 .....	50
十、长盛同庆份额的申购与赎回 .....	52
十一、基金份额的配对转换 .....	64
十二、基金的非交易过户、登记、转托管、冻结与质押 .....	66
十三、基金的投资 .....	68
十四、基金的业绩 .....	80
十五、基金的财产 .....	82
十六、基金资产的估值 .....	83
十七、基金的收益和分配 .....	90
十八、基金的费用与税收 .....	92
十九、基金的会计与审计 .....	94
二十、分级运作期内基金份额的折算 .....	95
二十一、分级运作期到期后基金份额的转换 .....	105
二十二、基金的信息披露 .....	109
二十三、风险揭示 .....	114
二十四、基金合同的变更、终止和基金财产的清算 .....	120
二十五、基金合同内容摘要 .....	123
二十六、基金托管协议的内容摘要 .....	139
二十七、对基金份额持有人的服务 .....	150
二十八、其他应披露的事项 .....	152
二十九、招募说明书存放及查阅方式 .....	154
三十、备查文件 .....	155

## 一、绪言

《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(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》”)等有关法律法规以及《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“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当事人之间权利、义务的法律文件。本基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和基金合同当事人,其持有本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。基金投资人欲了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金
2. 原长盛同庆基金：指长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金，在基金合同生效后封闭三年，封闭期内不开放申购、赎回业务。封闭期到期后，转换为本基金
3. 原长盛同庆份额：指原长盛同庆可分离交易证券投资基金之基础份额
4. 原同庆 A 份额：指原长盛同庆可分离交易证券投资基金分拆的稳健收益类基金份额
5. 原同庆 B 份额：指原长盛同庆可分离交易证券投资基金分拆的积极收益类基金份额
6. 长盛同庆份额：指分级运作期内的本基金之基础份额，以及分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后本基金的基金份额
7. 同庆 A 份额：指本基金之基础份额分拆的稳健收益类基金份额，场内简称：同庆 800A，代码：150098
8. 同庆 B 份额：指本基金之基础份额分拆的积极收益类基金份额，场内简称：同庆 800B，代码：150099
9. 基金管理人或本基金管理人：指长盛基金管理有限公司
10. 基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
11. 基金合同：指《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》及其不时有效修订和补充，基金合同由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》修订而成
12. 托管协议：指《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金托管协议》及其不时有效修订和补充，托管协议由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金托管协议》修订而成
13. 招募说明书或本招募说明书：指《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
14. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章

及规范性文件等

15. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会议第五次通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

16. 《销售办法》：指 2011 年 6 月 9 日由中国证监会公布并于 2011 年 10 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订

17. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

18. 《运作办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

19. 《上市规则》：指《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》

20. 《上市交易公告书》：分级运作期内，指《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 A 份额和同庆 B 份额上市交易公告书》；分级运作期到期后，指《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）上市交易公告书》

21. 中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

22. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

23. 银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

24. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

25. 个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

26. 机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

27. 合格境外机构投资者：指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

28. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

29. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资

人

30. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

31. 销售机构：指直销机构和代销机构

32. 直销机构：指长盛基金管理有限公司

33. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

34. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

35. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

36. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为长盛基金管理有限公司或接受长盛基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

37. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

38. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

39. 基金转型：指对原长盛同庆基金在封闭期到期后变更运作方式、投资目标、范围和策略，更名为“长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金”，并相应修订基金合同等一系列事项的统称

40. 基金合同生效日：指《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效起始日。基金合同自原长盛同庆基金封闭期到期日次日起生效，即自 2012 年 5 月 12 日起生效，原《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》自同一日起失效

41. 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核准或备案后终止基金合同的日期

42. 基金存续期：指《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》生效日至《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限

43. 日/天：指公历日

44. 月：指公历月

45. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

46. T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

47. T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

48. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

49. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

50. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

51. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

52. 定期定额投资计划：指投资人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投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

53. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%

54. 场外：指通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构进行基金份额申购和赎回的销售机构和场所

55. 场内：指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位进行基金份额申购、赎回和上市交易的深圳证券交易所会员单位和场所

56. 注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

57. 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

58. 上市交易：在本基金分级运作期内，指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖同庆 A 份额和同庆 B 份额的行为；本基金分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后，指投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖长盛同庆份额的行为

59. 转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

60. 系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位或交易单元）之间进行转托管的行为

61. 跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为

62. 封闭期到期后基金份额的转换：指原长盛同庆基金封闭期到期后，原同庆 A 份额和原同庆 B 份额按照基金合同规定的转换规则，采用份额比例折算的方式以各自份额的净值转换成长盛同庆份额的行为

63. 赎回限定期：指在基金合同生效后，为原长盛同庆基金封闭期到期转换后得到的长盛同庆份额所设定的赎回期间。赎回限定期为 5 个工作日，自原长盛同庆基金封闭期到期后基金份额转换并完成份额登记后第一个工作日开始。赎回限定期内，长盛同庆份额开放申购赎回业务

64. 赎回限定期申购：指投资者在本基金赎回限定期内申请申购长盛同庆份额的行为

65. 赎回限定期赎回：指投资者在本基金赎回限定期内申请赎回长盛同庆份额的行为

66. 分级运作期：指为本基金基金份额分级运作所设定的期限。本基金的分级运作期为三年，自赎回限定期到期后第一个工作日开始，至满三年的对应日结束，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。在分级运作期开始后，本基金管理人在完成长盛同庆份额的折算后，完成对场内初始长盛同庆份额的分拆

67. 长盛同庆份额的自动分离：指分级运作期开始后，长盛同庆份额折算完成后，本基金将场内初始长盛同庆份额照 4:6 的比例自动分离成预期收益与风

险不同的两类基金份额，即同庆 A 份额和同庆 B 份额的行为

68. 配对转换：指本基金的长盛同庆份额与同庆 A 份额、同庆 B 份额之间按约定的转换规则进行转换的行为，包括分拆和合并

69. 场内份额的分拆：根据基金合同约定，基金份额持有人将其所持有的场内长盛同庆份额按照 4:6 的比例申请转换成同庆 A 份额与同庆 B 份额的行为

70. 场内份额的合并：根据基金合同约定，场内基金份额持有人将其持有的同庆 A 份额与同庆 B 份额按 4:6 的比例申请转换成场内长盛同庆份额的行为

71. 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和满两年的对应日（若该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日），本基金将进行基金份额的定期折算：同庆 A 份额的约定应得收益，即定期折算基准日同庆 A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 A 份额持有人；同庆 B 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 B 份额持有人（若同庆 B 份额参考净值小于等于 1.000 元，则不进行折算）；长盛同庆份额持有人持有的每 10 份长盛同庆份额将按持有 4 份同庆 A 份额和 6 份同庆 B 份额获得新增长盛同庆份额的分配

72. 不定期折算：在分级运作期内，当同庆 B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下，本基金还将进行不定期份额折算，份额折算后同庆 A 份额和同庆 B 份额的比例始终保持为 4:6，长盛同庆份额的净值以及同庆 A 份额和同庆 B 份额的参考净值均调整为 1.000 元

73. 基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

74. 元：指人民币元

75. 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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

76. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

77. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

78. 长盛同庆份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

79. 同庆 A/同庆 B 份额参考净值：指本基金分级运作期内，在 T 日长盛同庆份额净值计算的基础上，按照基金合同约定的参考净值计算规则计算得到的 T 日同庆 A 份额/同庆 B 份额估算价值

80. 同庆 A 份额的本金：除非基金合同文义另有所指，对于同庆 A 份额而言，指 1.00 元

81. 同庆 A 份额约定年收益率  $R_A$  为：“一年期同期银行定期存款利率（税后）+3.5%”。分级运作期内， $R_A$  每年确定一次，确定日分别为分级运作期起始日和基金份额定期折算基准日。其中，“一年期同期银行定期存款利率”以  $R_A$  确定日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。约定年收益均以 1.000 元为基准进行计算。基金管理人并不承诺或保证同庆 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，同庆 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

82. 同庆 A 份额累计约定应得收益：同庆 A 份额依据约定年基准收益率及基金合同约定的截至计算日的实际天数计算的累计收益

83. 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净值的过程

84. 分级运作期到期基金份额的转换：指本基金分级运作期到期后，同庆 A 份额和同庆 B 份额按照约定的转换规则，采用份额比例折算的方式以各自份额的参考净值转换成上市开放式基金（LOF）份额的行为

85. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

86. 不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 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：凤良志

电话：(010) 82019988

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金字[1999]6 号文件批准，于 1999 年 3 月 26 日成立，注册资本为人民币 15000 万元。截至目前，基金管理人股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%；新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。截至 2013 年 5 月 12 日，基金管理人共管理两只封闭式基金、二十六只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

凤良志先生，董事长，管理学博士，经济学硕士，高级经济师。曾任安徽省政府办公厅二办副主任，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，香港黄山有限公司董事长、总经理，安徽国元控股（集团）有限责任公司董事长、党委书记，安徽国元信托投资有限责任公司董事长，国元证券股份有限公司董事长。现任国元证券股份有限公司董事、党委书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任公司党委书记。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任，安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理，安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理，香港黄山有限公司总经理助理，国元证券股份有限公司总裁。现任国元证券股份

有限公司董事长、党委副书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任公司党委委员、国元证券（香港）有限公司董事长。

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。现任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。曾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控股有限公司董事长、党委书记。

陈淑珊女士，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括 ING 霸菱证券公司、花旗银行、摩根士丹利。现任星展银行有限公司私人银行业务部董事总经理兼主管。

葛甘牛先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括所罗门兄弟公司、瑞士信贷第一波士顿银行（香港）有限公司、美林集团、德意志银行、荷兰银行、中银国际控股有限公司、瑞士信贷银行股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司。现任星展银行（中国）有限公司董事、行长/行政总裁。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。曾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。2004 年 10 月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理。

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，博士，金融学讲座教授。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、上海复旦大学顾问教授、香港城市大学讲座教授。现任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。2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，学士，教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、校学术委员会委员、政治经济学博士点学科带头人、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，中国科技大学兼职教授，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，安徽省经济学会副会长。

陈华平先生，独立董事，博士，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、管理学院商务智能实验室主任。

## 2、监事会成员

沈和付先生，监事，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。现任国元证券股份有限公司合规总监。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计，太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司主管会计，历任长盛基金管理有限公司业务运营部总监、财务会计部总监。现任长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

邓永明先生，监事，学士。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005 年 7 月底加入长盛基金管理有限公司，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任长盛基金管理有限公司权益投资部副总监，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

## 3、管理层成员

凤良志先生，董事长，管理学博士，经济学硕士，高级经济师。同上。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

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）。2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司，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。曾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。2004 年 10 月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

王超先生，1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士，金融风险管理师(FRM)。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员，从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。自 2011 年 12 月 6 日起任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，自 2012 年 7 月 20 日起兼任长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金（本基金）基金经理，自 2013 年 1 月 5 日起兼任长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：黄瑞庆先生，2009 年 5 月 12 日—2011 年 1 月 11 日任本基金（转型前）基金经理；王宁先生，2009 年 5 月 12 日—2012 年 5 月 11 日任本基金（转型前）基金经理，2012 年 5 月 12 日—2013 年 3 月 14 日任本基金基金经理。（本招募说明书基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。）

#### 5、投资决策委员会成员

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

王宁先生，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005 年 8 月加盟长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理，权益投资部总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

侯继雄先生，清华大学博士。历任国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，现任公司总经理助理，研究部总监，同盛证券投资基金基金经理。

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，历任星展珊顿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，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。现任国际业务部总监，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。

蔡宾先生，中央财经大学硕士，美国特许金融分析师 CFA。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理、投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务。现任固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

刘斌先生，清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006 年 5 月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深 300 指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部总监，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。

邓永明先生，监事，学士。同上。

李庆林先生，硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究发展部副总监，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任社保组合组合经理。

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，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。

2. 办理基金备案手续。
3. 对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资。
4. 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益。
5. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。
6. 编制基金季度报告、中期和年度基金报告。
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它职责。

#### （四）基金管理人承诺

1. 基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
2. 基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
  - （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
  - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - （5）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。
3. 基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。
4. 基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责。
5. 基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。
6. 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) 不得以任何形式为其他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、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。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、书面化的内部控制指引，使内部控制制度和各项控制措施能够得以有效实施；

(2) 建立了一套严格检验程序，以检验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。上述文书同时抄报总经理和公司督察长，以保证多重检查复核。

(3) 建立了一套报告制度。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

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间。监察稽核部总监负责公司的日常监察稽核工作，定期向总经理出具工作报告。

#### 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) 基金托管人情况

#### 1. 基本情况

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

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2012 年 12 月 31 日，中国建设银行资产总额 139,728.28 亿元，较上年末增长 13.77%。2012 年，中国建设银行实现净利润 1,936.02 亿元，较上年同期增长 14.26%。年化资产回报率为 1.47%，年化加权净资产收益率为 21.98%。利息净收入 3532.02 亿元，较上年同期增长 15.97%。净利差为 2.58%，净利息收

益率为 2.75%，均较上年同期提高 0.01 个百分点。手续费及佣金净收入 962.18 亿元，较上年同期增长 7.51%。

中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球 13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行 26 家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012 年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的 30 多个重要奖项。在英国《银行家》杂志联合 Brand Finance 发布的“世界银行品牌 500 强”以及 Interbrand 发布的“2012 年度中国最佳品牌”中，位列中国银行业首位；在美国《财富》杂志“世界 500 强排名”中列第 77 位，较上年上升 31 位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 210 人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2. 主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中

国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3. 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2012 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 285 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在 2005 年及自 2009 年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在 2007 年及 2008 年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网 2011 年度和 2012 年度中国“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012 年度“最佳基金托管银行”奖。

#### （二）基金托管人的内部控制制度

##### 1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立

行使监督稽核工作职权和能力。

### 3. 内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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。

#### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

##### 2. 监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

#### 1. 场外直销机构

名称：长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

邮政编码：100088

电话：(010) 82019799、82019795

传真：(010) 82255981、82255982

联系人：张莹、张晓丽

#### 2. 场外代销机构

##### (1) 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

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：王嘉朔

电话：010-67596220

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

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

##### (2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

行长：李礼辉

联系人：宋府

电话：010-66594904

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 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：蒋超良  
联系人：高阳  
电话：010-85108206  
传真：010-85109219  
客服电话：95599  
公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

(4) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号  
办公地址：北京市西城区金融大街 3 号  
法定代表人：李国华  
联系人：陈春林  
电话：010-68858117  
传真：010-68858117  
客户服务电话：95580  
公司网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

(5) 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  
联系人：张作伟  
电话：021-58781234  
传真：021-58408842  
客户服务电话：95559  
公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(6) 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：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：0755—83077278

传真：0755—83195050

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(7) 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8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

联系人：赵树林

电话：010-65556960

传真：010-65550981

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

(8) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

电话：021—52629999

传真：021--62569070

客户服务电话：95561

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

(9) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：虞谷云

电话：021—61616206

传真：021—63604199

客户服务电话：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（10）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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-57092851

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

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

（11）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：祝丽萍

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）2272100

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

（12）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：（010）65182261

客服电话：400-8888-108

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

(13) 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

联系人：李笑鸣

联系电话：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客服电话：400-8888-001、(021) 962503

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

(14) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(15) 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

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943237

客户服务热线：95565、4008888111、(0755) 26951111

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

(16) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

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

（17）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：储晓明

电话：021-33389888 或 021-54033888

传真：021-54038844

客户服务电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

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

（18）第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 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、26 层

法定代表人：刘学民

联系人：崔国良

电话：(0755) 25832852

传真：(0755) 25831718

客户服务电话：4008881888

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

（19）中国银河证券股份有限公司

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：陈有安

联系人：田薇

电话：（010）66568430

传真：（010）66568536

客服电话：400-888-8888

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

（20）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：万建华

联系人：芮敏祺

电话：（021）62580818-213

传真：（021）62569400

客服电话：95521

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

（21）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：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

客户服务热线：4008888788、10108998

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

（22）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

开放式基金咨询电话：4006000686

开放式基金业务传真：（0431）85096795

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

(23) 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

法定代表人：刘弘

联系人：牟冲

电话：010-5832-8112

客户服务热线：400-887-8827

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

(24) 中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

客户服务热线：400-8866-567

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

(25) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 47-49 楼

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客服电话：40018-40028

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

(26) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

开放式基金业务传真：0755-82400862

客服电话：95511—8

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

（27）齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531—68889155

传真：0531—68889752

客户服务电话：95538

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

（28）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

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

（29）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：高国泽

电话：0871-3577946

客户服务电话:0871-3577930

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

(30) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 高冠江

联系人: 唐静

电话: 010-63081000

传真: 010-63080978

客服电话: 400-800-8899

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

(31) 东方证券股份有限公司

注册地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人: 潘鑫军

联系人: 吴宇

电话: 021-63325888

传真: 021-63326173

客户服务热线: 95503

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

(32) 中国国际金融有限公司

住所: 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人: 李剑阁

联系人: 罗春蓉, 武明明

联系电话: 010-65051166 或直接联系各营业部

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

(33) 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

联系人: 程高峰

电话: 025-84457777-893

传真:025-84579763

客户咨询电话: 95597

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

(34) 中信证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人: 王东明

联系人: 张于爱

电话: 010-84864818

传真: 010-84865560

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

(35) 中信万通证券有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 (1507-1510 室)

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

(266061)

法定代表人: 杨宝林

联系人: 吴忠超

电话: 0532-85022326

传真: 0532-85022605

客户咨询电话: 0532-96577

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

(36) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福州市湖东路268号

办公地址: 浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

法定代表人: 兰荣

联系人: 谢高得

电话: 021-38565785

传真: 021-38565955

客服服务热线: 95562

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

(37) 中信证券（浙江）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)

(38) 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

办公地址：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：李春芳

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000 400-6666-888

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

(39) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

统一客服电话：4008001001

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

(40) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

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

（41）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：岳献春

客服热线：4006 19 8888

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

（42）中国中投证券有限责任公司

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-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话 400 600 8008

公司网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（43）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：雷波

联系人姓名：王丹

联系人电话：028-86690125

联系人传真：028-86690126

客服电话：028-95105111

公司网址：www.gjzq.com.cn

（44）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客户服务电话：4006898888、96668

公司网址：www.hlzqgs.com

（45）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（46）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：洪家新

联系人姓名：陈敏

联系人电话：021-64339000

联系人传真：021-64333051

客户服务电话：021-32109999、029-68918888

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

(47) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三、五层

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三、五层

法定代表人：宋德清

联系人：陶颖

电话：010-58568040

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

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

(48) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客户服务电话：95563

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

(49) 财通证券有限责任公司

注册地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：0571-87822359

传真：0571-97918329

客户服务电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

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

(50) 山西证券股份有限公司

办公（注册）地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：0351—8686659

传真：0351—8686619

客服电话：400-666-1618、95573

公司网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(51) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-6655

客服电话：4008888993

公司网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

(52) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩萍

联系电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网站：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(53) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

联系电话：021-38509636

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

### 3. 场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员可办理本基金的场内申购、赎回业务。具体名单如下：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）

#### （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：(010) 59378888

传真：(010) 66210938

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：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

(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

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办注册会计师：汪棣、张晓艺

## 六、基金的历史沿革

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而成。

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金遵照《基金法》于 2009 年 03 月 06 日获中国证监会证监行政许可【2009】209 号文批准募集。

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。基金管理人于 2009 年 5 月 12 日获得中国证监会书面确认，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同生效，基金规模达 146.86 亿份基金份额。长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同生效后，封闭期为三年，自基金合同生效之日起至三年后对应日止，封闭期到期后将进行基金转型。

2012 年 4 月 10 日长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金份额持有人大会以现场方式召开，大会讨论长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型议案，内容包括长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金在封闭期到期后变更运作方式、投资目标、范围和策略，基金更名和修订基金合同等。依据中国证监会证监许可（2012）549 号文核准，持有人大会决议生效。长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期于 2012 年 5 月 11 日到期，2012 年 5 月 12 日起《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》失效且《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效。基金转型为开放式基金后，存续期为不定期，基金运作方式、投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金”。

根据本基金基金份额持有人大会决议以及基金合同的相关规定，基金管理人以 2012 年 5 月 11 日为份额转换基准日，对原长盛同庆基金之原同庆 A 份额和原同庆 B 份额进行了封闭期到期转换。原同庆 A 份额和原同庆 B 份额的基金份额转换比例分别为 1.327179991 和 0.781880002，分别转换为本基金之基础份额长盛同庆份额 77.97 亿份和 68.90 亿份。

## 七、基金的存续

### （一）基金份额的变更登记

自原长盛同庆基金合同失效后2个工作日内，基金管理人将向中国证券登记结算有限责任公司申请办理基金份额的变更登记。基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司取得原长盛同庆基金封闭期到期日登记在册的基金份额持有人名册之后，将进行基金份额更名以及必要的信息变更，中国证券登记结算有限责任公司将根据基金管理人、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的明细数据进行投资者持有基金份额的初始登记。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，如连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。

## 八、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三年，自赎回限定期到期后第一个工作日（2012 年 5 月 22 日（周二））开始，至满三年的对应日（2015 年 5 月 21 日（周四））结束。

分级运作期开始后，本基金管理人在完成长盛同庆份额折算后的第一个工作日，对场内初始长盛同庆份额进行分拆。分级运作期的具体起讫日期，基金管理人将在赎回限定期到期前按照相关规定公告。

在分级运作期内，场内长盛同庆份额按照 4:6 的比例分拆所得的同庆 A 份额和同庆 B 份额在深圳证券交易所上市交易；场内与场外长盛同庆份额开放申购、赎回业务；场内的长盛同庆份额、同庆 A 份额和同庆 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

分级运作期内，本基金的基金份额包括长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“长盛同庆份额”）、稳健收益类份额（简称“同庆 A 份额”）与积极收益类份额（简称“同庆 B 份额”）。其中，同庆 A 份额、同庆 B 份额的基金份额配比始终保持 4:6 的比例不变。

### （三）分级运作期内基金份额的分拆规则

分级运作期开始后，长盛同庆份额折算完成后，本基金将场内初始长盛同庆份额照 4:6 的比例自动分离成预期收益与风险不同的两类基金份额，即同庆 A 份额和同庆 B 份额。

根据本基金分级运作期初始基金份额的分拆规则，同庆 A 份额在场内初始基金总份额中的份额占比为 40%，同庆 B 份额在场内初始基金总份额中的份额占比为 60%，且两类基金份额与场外的长盛同庆份额的基金资产合并运作。

在本基金分级运作期内，同庆 A 份额与同庆 B 份额在深圳证券交易所上市和交易。基金份额持有人或二级市场投资者可以在市场内单独交易同庆 A 份额或者同庆 B 份额，但不可单独申购或赎回同庆 A 份额或者同庆 B 份额。长盛同庆份额沿用原长盛同庆份额的基金代码，可以进行场内与场外的申购与赎回，

但不上市交易。

#### （四）分级运作期内同庆 A 份额和同庆 B 份额的参考净值计算规则

本基金份额所分拆的同庆 A 份额和同庆 B 份额在分级运作期内具有不同的参考净值计算规则，同庆 A 份额和同庆 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同庆 A 份额的本金及约定应得收益，则同庆 A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先分配同庆 A 份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产分配予同庆 B 份额，则同庆 B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。

同庆 A 份额和同庆 B 份额的参考净值计算规则如下：

（1）同庆 A 份额约定年收益率  $R_A$  为：“一年期同期银行定期存款利率（税后）+3.5%”。分级运作期内， $R_A$  每年确定一次，确定日分别为分级运作期起始日和基金份额定期折算基准日。其中，“一年期同期银行定期存款利率”以  $R_A$  确定日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率为准。约定年收益均以 1.000 元为基准进行计算。

（2）分级运作期内每个工作日计算同庆 A 份额和同庆 B 份额参考净值。在进行同庆 A 份额和同庆 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同庆 A 份额的本金及同庆 A 份额的累计约定日应得收益，之后的剩余净资产计为同庆 B 份额的净资产。同庆 A 份额累计约定日应得收益按依据同庆 A 份额约定年收益率计算的每日收益率和截至计算日同庆 A 份额应计收益的天数确定。

（3）在同庆 A 份额首次定期折算之前，同庆 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；同庆 A 份额首次定期折算之后，同庆 A 份额在参考净值计算日应计收益的天数按最近一次同庆 A 份额折算基准日（包括定期折算和不定期折算，详见本招募说明书“二十一、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同庆 A 份额和同庆 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同庆 A 份额和同庆 B 份额分级运作期期末参考净值，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庆份额基金转换规则详见本“二

## 十一、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同庆 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，同庆 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 日长盛同庆份额净值的计算

T 日长盛同庆份额净值=T 日闭市后的基金资产净值 / 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庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额的余额数量之和。

长盛同庆份额净值的计算，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 日的长盛同庆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 日同庆 A 份额和同庆 B 份额参考净值的计算

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

$$NAV_B = (NAV - 0.4 \times NAV_A) / 0.6;$$

其中：

NAV 为 T 日长盛同庆份额净值；

NAV<sub>A</sub> 为 T 日同庆 A 份额参考净值；

NAV<sub>B</sub> 为 T 日同庆 B 份额参考净值；

R<sub>A</sub> 为同庆 A 份额约定年收益率，在分级运作期起始日或定期折算基准日确定；

N 为计算同庆 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 ≤ 分级运作期到期日时，N 为第二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，详见本招募说明书“二十一、分级运作期内基金

份额的折算”；

$t$  为同庆 A 份额在参考净值计算日应计收益的天数， $t=\min\{\text{分级运作期起始日至 T 日的实际天数, 最近一次同庆 A 份额折算基准日次日至 T 日的实际天数}\}$ 。

同庆 A 份额与同庆 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。同庆 A 份额和同庆 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庆份额净值一同公告。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。

同庆 A 份额和同庆 B 份额参考净值举例：

例如，本基金分级运作期起始日为 2012 年 5 月 22 日（周二），分级运作期到期日为 2015 年 5 月 21 日（周四），第一次定期折算基准日为 2013 年 5 月 21 日（周二），第二次定期折算基准日为 2014 年 5 月 21 日（周三）。

假设 T 日为 2012 年 6 月 5 日（周二），长盛同庆份额的净值为 1.100 元； $R_A$  为 7%；N 为 365；分级运作期起始日至 T 日的实际天数为 15 天，且同庆 A 份额尚未发生过折算，此时无需考虑“最近一次同庆 A 份额折算基准日次日至 T 日的实际天数”，故， $t=\min\{15 \text{ 天}\}=15$  天。由此，T 日同庆 A 份额和同庆 B 份额参考净值为：

$$NAV_A=1+(R_A/N) \times t=1+(7\%/365) \times 15=1.003 \text{ 元}$$

$$NAV_B=(NAV-0.4 \times NAV_A)/0.6=(1.100-0.4 \times 1.003)/0.6=1.165 \text{ 元}$$

又如，假设本基金触发不定期折算条件，不定期折算基准日为 2013 年 12 月 4 日（周二）。则若 T 日为 2013 年 12 月 16 日（周一），并假设长盛同庆份额的净值为 1.200 元； $R_A$  为 6%；N 为 365；分级运作期起始日至 T 日的实际天数为 574 天，最近一次同庆 A 份额折算基准日次日（2013 年 12 月 5 日）至 T 日的实际天数为 12 天， $t=\min\{573 \text{ 天}, 12 \text{ 天}\}=12$  天。因此，T 日同庆 A 份额和同庆 B 份额参考净值为：

$$NAV_A=1+(R_A/N) \times t=1+(6\%/365) \times 12=1.002 \text{ 元}$$

$$NAV_B=(NAV-0.4 \times NAV_A)/0.6=(1.200-0.4 \times 1.002)/0.6=1.332 \text{ 元}$$

## 九、基金份额的上市交易

### （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，同庆 A 份额与同庆 B 份额将向深圳证券交易所申请上市与交易。

本基金分级运作期到期后，同庆 A 份额与同庆 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。场内的长盛同庆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；场外的长盛同庆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

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同庆 A 份额和同庆 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庆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同庆 A 份额和同庆 B 份额后，同庆 A 份额和同庆 B 份额方可上市交易。

本基金分级运作期到期后，同庆 A 份额与同庆 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）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

分级运作期内同庆 A 份额、同庆 B 份额的上市交易起始日为 2012 年 5 月 31 日。

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基金份额上市交易公告书。

#### （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《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定，包括但不限于：

1. 本基金分级运作期内，同庆 A 份额与同庆 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

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

#### （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，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 十、长盛同庆份额的申购与赎回

在本基金基金合同存续期间，长盛同庆份额开放申购与赎回业务。具体如下：

### （一）申购和赎回的场所

投资者可通过直销机构和场内、场外代销机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按直销机构和场内、场外代销机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。场内代销机构为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。

具体的销售网点将由基金管理人在本招募说明书、基金份额发售公告或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回，具体办法由基金管理人另行公告。

### （二）申购和赎回的对象

中华人民共和国境内的自然人、法人及其他组织（法律法规禁止购买证券投资基金者除外），合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （三）申购和赎回办理的开放日及时间

#### （1）开放日及开放时间

基金合同生效后，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

#### （2）申购、赎回开始日及业务办理时间

##### ① 赎回限定期开放申购赎回

首次开放为赎回限定期申购赎回。赎回限定期，是为原长盛同庆基金封闭期到期转换后得到的长盛同庆份额所设定的申购赎回期间。赎回限定期设定为 5 个工作日，自原长盛同庆基金封闭期到期后基金份额转换并完成份额登记后第一个工作日（即 2012 年 5 月 15 日）开始，到 2012 年 5 月 21 日结束。

## ② 进入分级运作期后恢复申购赎回

本基金自 2012 年 5 月 22 日起进入分级运作期，为保证份额折算和分拆期间的平稳运作，本基金暂停办理长盛同庆份额的申购、赎回、定期定额投资和跨系统转托管业务。

恢复申购日为：2012 年 5 月 31 日。

恢复赎回日为：2012 年 5 月 31 日。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日办理基金份额申购、赎回或转换业务的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （四）申购和赎回的数额限制

1. 分级运作期内，本基金单笔申购基金份额的最低金额为 50,000 元；分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金单笔申购基金份额的最低金额为 1,000 元；

2. 基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可以根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人调整上述限制，最迟应于调整日前 2 日在指定媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

### （五）场内申购和赎回

#### 1. 开放日及开放时间

本基金为投资者办理长盛同庆份额的场内申购与赎回等基金业务的时间即开放日为深圳证券交易所工作日，业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购或赎回时除外。

#### 2. 申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即长盛同庆份额的申购与赎回价格以受理申请当日

收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

(2) “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。申购和赎回申报单位以深圳证券交易所的规定为准；

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

(4) 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理长盛同庆份额的申购、赎回；

基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质权益的情况下调整上述原则，但最迟应于新原则实施前 2 日在指定媒体上予以公告。

### 3. 申购和赎回的程序

#### (1) 申购和赎回的申请方式

基金投资者需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回申请。投资者在申购长盛同庆份额时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资者在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的长盛同庆份额余额，否则赎回申请无效。

#### (2) 申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日后（包括该日）到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。

#### (3) 申购和赎回的款项支付

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，申购款项本金将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

### 4. 场内申购费率、赎回费率

	金额 (M)	费率 (%)
场内申购费率	M < 50 万元	1.20%
	50 万元 ≤ M < 200 万元	0.80%
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%
	M ≥ 500 万元	按笔收取, 每笔 1000 元
场内赎回费率	场内赎回费率统一为 0.50%	

## 5. 申购、赎回的价格、费用及其用途

### (1) 长盛同庆份额申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

(申购金额在 500 万元 (含) 以上的适用固定金额的申购费, 即净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费金额。)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / T 日长盛同庆份额净值

申购份额保留到整数位, 计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例如: 某投资者投资 5 万元在场内申购长盛同庆份额, 对应费率为 1.20%, 假设申购当日长盛同庆份额净值为 1.016 元, 则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

净申购金额 = 50,000 / (1 + 1.20%) = 49,407.11 元

申购费用 = 50,000 - 49,407.11 = 592.89 元

申购份额 = 49,407.11 / 1.016 = 48,629.05 份

因场内基金份额份数保留到整数位, 故投资者申购所得份额为 48,629 份, 不足 1 份额对应的资金返还至投资者资金账户。具体计算公式为:

实际净申购金额 = 48,629 × 1.016 = 49,407.06 元

退款金额 = 50,000 - 49,407.06 - 592.89 = 0.05 元

即: 投资者投资 5 万元从场内申购本基金, 假设申购当日基金份额净值为 1.016 元, 则可得到 48,629 份基金份额, 同时得到退款 0.05 元。

### (2) 长盛同庆份额赎回金额的计算

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日长盛同庆份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益归基金财产所有，产生的损失由基金财产承担。

例：某投资者场内赎回基金 1 万份长盛同庆份额，场内赎回的赎回费率统一为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.016= 10,160.00 元

赎回费=10,160.00×0.5%=50.80 元

净赎回金额=10,160.00-50.80=10,109.20 元

即：投资者赎回基金 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元，则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

(3) T 日长盛同庆份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，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。

(4) 长盛同庆份额基金份额净值的计算公式

T 日长盛同庆份额净值=T 日闭市后的基金资产净值/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庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额的余额数量之和。

基金份额净值保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

(5) 长盛同庆份额的场内申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(6) 长盛同庆份额的场内赎回费用由赎回人承担，赎回费总额的 25%归基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。

(7) 长盛同庆份额场内申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过基金份额赎回总金额的 5%。

(8) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前 2 日在指定媒体上予以公告。

(9) 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动

期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### 6. 申购与赎回的登记结算

长盛同庆份额场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

7. 办理长盛同庆份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

### （六）场外申购和赎回

#### 1. 开放日及开放时间

本基金为投资者办理场外申购与赎回等基金业务的时间，即开放日，为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。各销售机构的具体办理时间详见销售机构发布的公告或通知。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

#### 2. 申购与赎回的原则

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

（2）“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）当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日开放时间结束后不得撤销；

（4）基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回；

基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质权益的情况下调整上述原则，但最迟应于新原则实施前 2 日在至少一种指定媒体上予以公告。

#### 3. 申购和赎回的程序

##### （1）申购和赎回的申请方式

投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回的申请。投资者申购本基金时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的长盛同庆份额余额，否则赎回申请无效。

### （2）申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购、转换或赎回申请的当天作为申购、转换或赎回申请日（T 日），并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

### （3）申购和赎回的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功的款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定划付赎回款项。赎回款项应在自受理投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

基金管理人、基金托管人、注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整并公告。但基金管理人、注册登记机构最迟须于受理申购、赎回申请之日起 3 个工作日内，对申请的有效性进行确认。

## 4. 场外申购费率、赎回费率

	申购金额（M）	申购费率（%）
场外申购费率	M < 50 万	1.20%
	50 万 ≤ M < 200 万	0.80%
	200 万 ≤ M < 500 万	0.40%
	M ≥ 500 万	按笔收取,每笔 1000 元
	持有基金份额期限（P）	赎回费率（%）
场外赎回费率	P < 1 年	0.50%
	1 年 ≤ P < 2 年	0.25%
	P ≥ 2 年	0%

注:1 年指 365 天

## 5. 申购和赎回的价格、费用及其用途

### (1) 长盛同庆份额申购份额的计算

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

(申购金额在500万元(含)以上的适用固定金额的申购费, 即净申购金额=申购金额-固定申购费金额。)

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日长盛同庆份额净值}$$

申购份额、净申购金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位, 由此误差产生的收益归基金财产所有, 产生的损失由基金财产承担。

例如: 某投资者投资 5 万元在场外申购长盛同庆份额, 对应费率为 1.20%, 假设申购当日基金份额净值为 1.016 元, 则其可得到的申购份额为:

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.20\%) = 49,407.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,407.11 = 592.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = (50,000 - 592.89) / 1.016 = 48,629.05 \text{ 份}$$

即: 投资者投资 5 万元申购基金, 假设申购当日基金份额净值为 1.016 元, 则可得到 48,629.05 份基金份额。

### (2) 长盛同庆份额赎回金额的计算

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times T \text{ 日长盛同庆份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位, 由此误差产生的收益归基金财产所有, 产生的损失由基金财产承担。

例如: 某投资者赎回基金 1 万份基金份额, 持有时间为 5 个月, 对应的赎回费率为 0.50%, 假设赎回当日基金份额净值是 1.016 元, 则其可得到的赎回金额为:

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.016 = 10,160.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费} = 10,160.00 \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,160.00 - 50.80 = 10,109.20 \text{ 元}$$

即: 投资者赎回基金 1 万份基金份额, 假设赎回当日基金份额净值是 1.016

元，则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

(3) T 日的长盛同庆份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，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。

(4) 长盛同庆份额基金份额净值的计算公式

$T$  日长盛同庆份额净值 =  $T$  日闭市后基金资产净值 /  $T$  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庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额的余额数量之和。

基金份额净值保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

(5) 长盛同庆份额的场外申购费用由基金申购人承担，不列入基金资产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(6) 长盛同庆份额的场外赎回费用由赎回人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。

(7) 本基金场外申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过基金份额赎回金额的 5%。

(8) 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前 2 日在至少一种指定媒体上予以公告。

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

(七) 拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
3. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

4. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5. 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

6. 本基金分级运作期起始日长盛同庆份额折算的情形。

7. 本基金分级运作期内出现基金份额定期折算或不定期折算的情形。

8. 本基金分级运作期到期后，基金份额转换的情形。

9. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### （八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。

2. 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

3. 在本基金限定赎回期以外的开放日，连续两个开放日发生巨额赎回。

4. 发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

5. 本基金分级运作期起始日长盛同庆份额折算的情形。

6. 本基金分级运作期内出现基金份额定期折算或不定期折算的情形。

7. 本基金分级运作期到期后，基金份额转换的情形。

8. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将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，未支付部分可延期支付。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务

的办理并予以公告。

#### (九) 巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

发生巨额赎回时，场内长盛同庆份额的处理方式按照中国证券登记结算有限公司的规则执行。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：在本基金限定赎回期以外的开放日，连续两个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

#### （十）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在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 个开放日长盛同庆份额净值、同庆 A 份额和同庆 B 份额的参考净值。

## 十一、基金份额的配对转换

本基金基金合同生效后，在分级运作期内，基金管理人将为基金份额持有人办理份额配对转换业务。

### （一）份额配对转换

份额配对转换是指长盛同庆份额与同庆 A 份额、同庆 B 份额之间的配对转换，包括以下两种方式的配对转换：

#### 1. 场内份额的分拆

场内份额的分拆是指基金份额持有人将其所持有的场内长盛同庆份额按照 4:6 的比例申请转换成同庆 A 份额与同庆 B 份额的行为

#### 2. 场内份额的合并

场内份额的合并是指场内基金份额持有人将其持有的同庆 A 份额与同庆 B 份额按 4:6 的比例申请转换成场内长盛同庆份额的行为

投资者可选择将其场内申购的长盛同庆份额按 4:6 的比例分拆成同庆 A 份额和同庆 B 份额；在场外申购的长盛同庆份额不进行分拆，通过跨系统转托管至场内并申请分拆后，其持有的长盛同庆份额将按 4:6 的比例分拆为同庆 A 份额和同庆 B 份额。

投资者可按 4:6 的配比将其持有的同庆 A 份额和同庆 B 份额申请合并为长盛同庆份额后在场内赎回；亦可将场内份额合并得到的长盛同庆份额跨系统转托管至场外后赎回。

### （二）份额配对转换的业务办理机构

份额配对转换的业务办理机构见基金管理人发布的相关公告。

基金投资者应当在份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理份额配对转换。深圳证券交易所、注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

### （三）份额配对转换的业务办理时间

份额配对转换业务开通日：2012 年 5 月 31 日。

份额配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），具体的业务办理时间为上午 9：30-11：30 和下午 1：

00-3:00。在此时间之外不办理份额配对转换业务。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

#### （四）份额配对转换的原则

1. 份额配对转换以份额申请。

2. 申请分拆为同庆 A 份额和同庆 B 份额的长盛同庆份额的场内份额数必须是 5 份或其整数倍。

3. 申请合并为长盛同庆份额的同庆 A 份额与同庆 B 份额必须同时申请配对，且基金份额数必须同为整数且比例为 4:6。

4. 场外长盛同庆份额如需申请进行分拆，须跨系统转托管为场内长盛同庆份额后方可进行。

5. 份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前 2 日在至少一家指定媒体公告。

#### （五）份额配对转换的程序

份额配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

#### （六）暂停份额配对转换的情形

1. 深圳证券交易所、注册登记机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

2. 法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形的，基金管理人应当在至少一家指定媒体刊登暂停份额配对转换业务的公告。

在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在至少一家指定媒体上公告。

#### （七）份额配对转换的业务办理费用

投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

## 十二、基金的非交易过户、登记、转托管、冻结与质押

### （一）基金的非交易过户

指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构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、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

### （二）基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

#### 1. 基金份额的登记

（1）本基金的份额采用分系统登记的原则。场外申购的长盛同庆份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内申购的长盛同庆份额或上市交易买入的同庆 A 份额、同庆 B 份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

（2）登记在证券登记结算系统中的长盛同庆份额可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的同庆 A 份额和同庆 B 份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按 4:6 比例申请合并为长盛同庆份额后再申请场内赎回。

（3）登记在注册登记系统中的长盛同庆份额既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至证券登记结算系统，经过基金份额持有人进行申请按 4:6 比例分拆为同庆 A 份额和同庆 B 份额后在深圳证券交易所上市交易。

#### 2. 系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统

内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理长盛同庆份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有长盛同庆份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理长盛同庆份额场内赎回或同庆 A 份额和同庆 B 份额上市交易的会员单位（交易单元）时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。

### 3. 跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的长盛同庆份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

（2）长盛同庆份额跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

#### （三）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（四）本基金份额的非交易过户、转托管、冻结与质押，依据相关法律法规，并按照中国证券登记结算有限责任公司、深圳证券交易所等相关机构的规定办理。

## 十三、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，以实现了对中证 800 指数的有效跟踪。

### （二）投资理念

中国经济持续稳定的增长为中国证券市场的发展奠定了坚实的基础。本基金以复制、跟踪中证 800 指数为原则，进行指数化长期投资，指数化的投资方式可以获取指数所代表市场的平均收益，并通过充分的分散化投资实现非系统风险的有效降低和流动性的提高，为投资者谋求利益最大化。

### （三）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%，其中投资于中证 800 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。

### （四）标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 800 指数。

中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

如果中证 800 指数被停止编制及发布,或中证 800 指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于有代表性更强、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因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数和投资对象,基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准,并在中国证监会指定的媒体上公告。

#### (五) 投资策略

本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。

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中证800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。本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。

##### 1. 资产配置策略

本基金采用两层资产配置策略,首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例,再进一步以抽样复制基准指数的方法,确定抽样组合中各股票的配置比例。本基金股票资产原则上不低于基金资产净值的90%,在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下,管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后,及时将股票配置比例调整至合理水平。

##### 2. 股票投资组合构建

本基金通过抽样复制指数的方法,在综合考虑个股的自由流通市值规模、个股流动性、行业代表性、波动性以及抽样组合与标的指数的相关性等因素的基础上,采用“分层抽样+优化抽样”的方法,选择标的指数成份股票或被选成份股票构建基金的抽样股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股配置比例。

### （1）股票筛选

本基金在抽样复制指数投资时，首先进行样本成份股初步筛选，通常初步筛选的股票样本为标的指数全部成份股和备选成份股，作为下一步分层抽样的基础。但在特殊情况下，如指数成份股调整、长期停牌或样本个股流动性极差时，则相应调整股票初选股票样本或剔除流动性极差的股票样本。

### （2）分层抽样

在标的指数成份股中初选出样本股票的基础上，首先按照通用的行业分类方法进行类别划分，然后根据每个行业中个股的流通市值权重、所在行业中的权重比例、个股收益波动性和行业收益相关性进行抽样选取，原则上优先抽取收益波动与标的指数高度相关的个股。

在分层抽样中，首先控制约束抽样股票组合中的行业比例及收益风险特征代表性与标的指数一致，且控制抽样组合中的行业内样本个股与行业整体的收益风险特征高度相关。

### （3）优化抽样

对于分层抽样后的股票样本组合，采用进一步优化方法并确定个股的权重，考虑标的指数总体收益和风险的特征情况，基于标的指数的跟踪误差限制为约束指标，通过投资组合优化模型构建基金的股票资产组合。

### （4）最终组合

对于“分层抽样 + 优化抽样”方法得到的股票组合，将被用来构建本基金的最初股票组合。为了能够更好的跟踪标的指数，如果今后由于基准指数成份股结构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告，并阐明变更抽样复制方法的原因。

## 3. 股票组合调整

### （1）组合调整原则

本基金为抽样复制的指数型基金，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、配股增发因素等变化，对基金投资组合

进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

## （2）组合调整方法

### ①跟踪调整

#### A、定期性调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的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。

本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合，将每季度末根据上述抽样复制方法调整股票组合及个股配置比例。

#### B、不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、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，并根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。

#### C、基于流动性及法律法规限制的调整

如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素或法律法规规定的投资限制，使得基金管理人无法顺利购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循“同行业基础上价格相关性”原则，对于需要进行替代的股票，其替代股票将从标的指数样本或被选成份股中选取，具体将在考虑股票流动性等因素的前提下，在同行业范围内，选取相关性较大的股票进行替代。

D、在其他不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，对基金资产组合进行适当的调整。

## 4. 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。

#### 5. 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。

#### （六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准 = 95% × 中证 800 指数收益率 + 5% × 一年期银行定期存款利率（税后）。

中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

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。

#### （七）风险收益特征

本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，由于基金收益分配的安排，同庆 A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；同庆 B 份额则表现出高风险、预期收益相对较高的特征。

#### （八）投资决策程序

##### 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，基金经理主要采取抽样复制法，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。

#### （九）投资限制

##### 1. 组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%。

（2）本基金参与股票发行申购，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）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；

（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%，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%；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，不得超过该基金资产净值的10%；基金管理人管理的全部证券投资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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；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。

（6）本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%—95%，其中投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。

（7）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。

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。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人履行相关程序后可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。法律法规如有变更，从其变更。

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。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自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。

### (十) 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。

#### （十一）基金的融资、融券

如法律法规或监管机构以后允许基金进行融资、融券，本基金管理人在履行适当程序后，可以按照国家的有关法律法规进行融资、融券。

（十二）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“长盛同庆中证 800 指数证券投资基金”；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。

#### （十三）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——中国建设银行股份有限公司根据本基金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取自《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2013 年度第 1 季度报告》，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,546,626,431.73	81.63
	其中：股票	2,546,626,431.73	81.63
2	固定收益投资	8,476,777.60	0.27
	其中：债券	8,476,777.60	0.27
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	163,393,082.25	5.24
6	其他资产	401,130,505.38	12.86
7	合计	3,119,626,796.96	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

## (1) 指数投资部分

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	15,115,150.15	0.49
B	采矿业	178,513,925.37	5.74
C	制造业	1,098,873,693.21	35.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	89,621,264.46	2.88
E	建筑业	66,511,040.93	2.14
F	批发和零售业	89,241,721.22	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	70,673,405.74	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,289,120.31	2.10
J	金融业	644,071,213.97	20.71
K	房地产业	155,225,806.58	4.99
L	租赁和商务服务业	17,707,202.92	0.57
M	科学研究和技术服务业	1,719,656.28	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	16,307,204.70	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,585,020.27	0.28
S	综合	29,171,005.62	0.94
	合计	2,546,626,431.73	81.91

## (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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

### 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### (1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	8,676,255	83,639,098.20	2.69
2	600036	招商银行	4,988,870	63,009,428.10	2.03
3	000002	万科 A	5,040,273	54,233,337.48	1.74
4	601166	兴业银行	2,952,857	51,084,426.10	1.64
5	601318	中国平安	1,161,051	48,497,100.27	1.56
6	600000	浦发银行	4,066,016	41,188,742.08	1.32
7	601398	工商银行	9,428,650	38,186,032.50	1.23
8	600837	海通证券	3,180,580	32,155,663.80	1.03
9	601328	交通银行	6,712,125	31,614,108.75	1.02
10	600030	中信证券	2,450,980	29,828,426.60	0.96

#### (2) 报告期末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

本基金本报告期末未持有积极投资股票

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8,476,777.60	0.27

8	其他	-	-
9	合计	8,476,777.60	0.27

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	80,030	8,476,777.60	0.27

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 投资组合报告附注

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

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。

8.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,070,138.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61,367.09
5	应收申购款	399,999,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	401,130,505.38

9. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 10. 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

## 11. 报告期末积极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前五名股票不存在流通受限情况。

## 12. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十四、基金的业绩

原长盛同庆基金成立以来的业绩如下：

阶段	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
2009年5月12日(原长盛同庆基金基金合同生效日)至2009年12月31日	10.90%	21.63%	-10.73%
2010年度	-4.06%	-7.50%	3.44%
2011年度	-24.06%	-16.47%	-7.59%
2012年1月1日至2012年5月11日	8.91%	9.11%	-0.20%
2009年5月12日(原长盛同庆基金基金合同生效日)至2012年5月11日	-12.00%	2.54%	-14.54%

自基金转型以来的业绩如下：

阶段	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
2012年5月12日(长盛同庆中证800指数分级基金基金合同生效日)至2012年12月31日	-4.26%	-5.70%	1.44%
2013年1月1日至2013年3月31日	0.42%	0.38%	0.04%
2012年5月12日(长盛同庆中证800指数分级基金基金合同生效日)至2013年3月31日	-3.86%	-5.34%	1.48%

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，但不保证基金一定赢利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策之前应仔细阅读本基金的招募说

说明书。

## 十五、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### （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

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，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。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。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十六、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场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。

### （二）估值方法

#### 1. 股票估值方法：

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，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：

1) 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，按成本计量；

2) 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挂牌的同一股票的收盘估值；

3) 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，按交易所上市的同一股票的收盘估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(2)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)－(2)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；

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 2. 债券估值方法：

(1) 证券交易所市场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) 证券交易所市场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) 发行未上市债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；

(4) 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；交易所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) 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；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)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)－(5)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；

(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3. 权证估值方法：

(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；

未上市交易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，按成本计量；

(2)在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应当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)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；

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4.如基金管理人或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，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

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

### (三) 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四) 估值程序

1.基金份额净值是按照每个估值日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2.基金管理人应每个估值日对基金资产估值。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。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。

### （五）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。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时, 视为基金份额净值错误。

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、或投资人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当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿, 承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于: 资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等; 对于因技术原因引起的差错, 若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服, 则属不可抗力, 按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错, 因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任, 但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

#### 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, 由差错责任方对直接损失承担赔偿责任; 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) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责, 不对间接损失负责, 并且仅对差错的有关直接当事人负责, 不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”), 则差错责任方应赔偿受损

方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人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，由责任方承担；但若经诉讼或仲裁的终局裁判，基金财产未获得补偿的部分可列入基金费用项下的相关科目，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出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，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如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，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。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；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。

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，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。

(4) 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。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力或其它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人的利益，已决定延迟估值；

4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### (七) 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开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。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，由基金管理人对基金净值予以公布。

#### (八) 特殊情况的处理

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(6)项或权证估值方法的第(2)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. 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极

采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十七、基金的收益和分配

### （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（即可供分配利润计算截止日）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（包括同庆 A 份额、同庆 B 份额和长盛同庆份额）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，单独计算出同庆 A 份额与同庆 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权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，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 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，但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，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。

#### （六）收益分配中发生的费用

1. 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；
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。

## 十八、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. 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 3 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 3 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. 除管理费和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。

## 十九、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
3. 本基金的会计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. 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务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及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、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时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 二十、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和满两年的对应日（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庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 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和满两年的对应日，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 22 日（周二），根据本招募说明书“九、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 2015 年 5 月 21 日（周四）。2012 年 5 月 22 日满一年的对应日为 2013 年 5 月 21 日（周二），满两年的对应日为 2014 年 5 月 21 日（周三），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 21 日（周二）和 2014 年 5 月 21 日（周三）。

#### 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额。

#### 3. 基金份额定期折算次数

二次。

#### 4. 基金份额折算方式

##### （1）同庆 B 份额折算基准日的参考净值达到 1.000 元以上的情形

若在折算基准日，同庆 B 份额的参考净值达到 1.000 元以上的，本基金将按照以下规则进行基金的折算：同庆 A 份额和同庆 B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算；对于同庆 A 份额的约定应得收益，即定期折算基准日同庆 A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 A 份额持有人；定期折算基准日同庆 B 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 B 份额持有人；场外长盛同庆份额持有人折算后获得新增场外长盛同庆份额，场内长盛同庆份额持有人折算后获得新增场内长盛同庆份额。

折算后同庆 A 份额和同庆 B 份额的比例仍为 4:6，份额折算后长盛同庆份

额的净值以及同庆 A 份额、同庆 B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。

### 1) 同庆 A 份额

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

$$\text{同庆 A 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后同庆 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前同庆 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前同庆 A 份额的参考净值。

### 2) 同庆 B 份额

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

$$\text{同庆 B 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)}{1.000}$$

其中，

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后同庆 B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{前}}$  为折算前同庆 B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$  为折算前同庆 B 份额的参考净值。

### 3) 长盛同庆份额

$$\text{长盛同庆份额持有人定期折算后持有的长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{1.000}$$

定期份额折算后长盛同庆份额的份额数

= 同庆 A 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

+ 同庆 B 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

+ 长盛同庆份额持有人定期份额折算后持有的长盛同庆份额的份额数

其中，

$NAV_{\text{同庆}}^{\text{前}}$  为折算前长盛同庆份额的净值；

$NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}$  为折算前长盛同庆份额的份额数。

场内的长盛同庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额折算成的新增场内长盛同庆份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），场外的长盛同庆份额折算成的

新增场外长盛同庆份额的份额数保留到小数点后两位，以循环进位方式分配因运算产生的剩余份额。

例如，假设在分级运作期起始日后满两年的对应日 2014 年 5 月 21 日，即定期份额折算基准日，长盛同庆份额当天折算前资产净值为 4,816,000,000 元，同庆 A 份额折算前资产净值为 2,120,000,000 元，同庆 B 份额折算前资产净值为 3,900,000,000 元。当天场外长盛同庆份额、场内长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额的份额数分别为 30 亿份、10 亿份、20 亿份、30 亿份。折算基准日，折算前长盛同庆份额的净值为 1.20400000 元，同庆 A 份额的参考净值为 1.06000000 元，同庆 B 份额的参考净值为 1.30000000 元，且未进行不定期份额折算。

定期份额折算的对象为折算基准日登记在册的长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额，即 40 亿份（30 亿份+10 亿份）、20 亿份、30 亿份。

1) 同庆 A 份额：

定期份额折算后同庆 A 份额的份额数=定期份额折算前同庆 A 份额的份额数

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

同庆 A 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数

$$\begin{aligned} &= \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{1.000} \\ &= \frac{2,000,000,000 \times (1.06000000 - 1.000)}{1.000} = 120,000,000 \text{份} \end{aligned}$$

同庆 A 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数为 120,000,000 份。

2) 同庆 B 份额：

定期份额折算后同庆 B 份额的份额数=定期份额折算前同庆 B 份额的份额数

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

同庆 B 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数

$$\begin{aligned} &= \frac{NUM_B^{\text{前}} \times (NAV_B^{\text{前}} - 1.000)}{1.000} \\ &= \frac{3,000,000,000 \times (1.30000000 - 1.000)}{1.000} = 900,000,000 \text{份} \end{aligned}$$

同庆 B 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数为 900,000,000 份。

## 3) 长盛同庆份额:

场内长盛同庆份额持有人折算后持有的长盛同庆份额的份额数

$$\begin{aligned} &= \frac{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{1.000} \\ &= \frac{1,000,000,000 \times 1.20400000}{1.000} \\ &= 1,204,000,000 \text{份} \end{aligned}$$

场外长盛同庆份额持有人折算后持有的长盛同庆份额的份额数

$$\begin{aligned} &= \frac{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{1.000} \\ &= \frac{3,000,000,000 \times 1.20400000}{1.000} \\ &= 3,612,000,000.00 \text{份} \end{aligned}$$

场内长盛同庆份额持有人定期折算后持有的长盛同庆份额的份额数为 1,204,000,000 份, 场外长盛同庆份额持有人定期折算后持有的长盛同庆份额的份额数为 3,612,000,000.00 份。

$$\begin{aligned} & \text{定期份额折算后长盛同庆份额的份额数} \\ &= \text{同庆 A 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数} \\ &+ \text{同庆 B 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数} \\ &+ \text{场内长盛同庆份额持有人定期份额折算后持有的长盛同庆份额的份额数} \\ &+ \text{场外长盛同庆份额持有人定期份额折算后持有的长盛同庆份额的份额数} \\ &= 120,000,000 \text{份} + 900,000,000 \text{份} + 1,204,000,000 \text{份} + 3,612,000,000.00 \text{份} \\ &= 5,836,000,000.00 \text{份} \end{aligned}$$

定期份额折算后长盛同庆份额的份额数为 5,836,000,000.00 份。

## (2) 同庆 B 份额折算基准日的参考净值处于 1.000 元及以下的情形

若在折算基准日, 同庆 B 份额的参考净值处于 1.000 元及以下的, 本基金将按照以下规则进行基金的折算: 同庆 A 份额和同庆 B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算; 对于同庆 A 份额的约定应得收益, 即定期折算基准日同庆 A 份额参考净值超出 1.000 元部分, 将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 A 份额持有人; 同庆 B 份额的参考净值和份额数不进行折算; 长盛同庆份额持有人持有的每份长盛同庆份额将按持有 0.4 份同庆 A 份额获得新增长

盛同庆份额的分配，场外长盛同庆份额的持有人将按前述折算方式获得新增场外长盛同庆份额的分配，场内长盛同庆份额的持有人将按前述折算方式获得新增场内长盛同庆份额的分配。

经过上述份额折算，同庆 A 份额的参考净值和长盛同庆份额的净值将相应调整。

### 1) 同庆 A 份额

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

$$NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长盛同庆份额的资产净值} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times 0.4 \times NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}}$$

$$\text{同庆 A 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}}}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后同庆 A 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前同庆 A 份额的份额数；

$NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}$  为折算前长盛同庆份额的份额数；

$NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}}$  为折算后长盛同庆份额的净值；

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前同庆 A 份额的参考净值。

### 2) 同庆 B 份额

当同庆 B 份额折算基准日的参考净值处于 1.000 元及以下时，定期份额折算不改变同庆 B 份额的参考净值及其份额数。

### 3) 长盛同庆份额

$$NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}} = \frac{\text{折算前长盛同庆份额的资产净值} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.000) \times 0.4 \times NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}}$$

$$\text{长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}} \times 0.4 \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{同庆}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后长盛同庆份额的份额数  
 = 定期份额折算前长盛同庆份额的份额数  
 + 同庆 A 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数  
 + 长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

其中，

$NAV_{同庆}^{后}$  为折算后长盛同庆份额的净值；

$NAV_A^{前}$  为折算前同庆 A 份额的参考净值；

$NUM_{同庆}^{前}$  为折算前长盛同庆份额的份额数。

场内的长盛同庆份额、同庆 A 份额折算成的新增场内长盛同庆份额的份额数取整计算（最小单位为 1 份），场外的长盛同庆份额折算成的新增场外长盛同庆份额的份额数保留到小数点后两位，以循环进位方式分配因运算产生的剩余份额。

例如，假设在分级运作期起始日后满两年的对应日 2014 年 5 月 21 日，即定期份额折算基准日，长盛同庆份额当天折算前资产净值为 3,856,000,000 元，同庆 A 份额折算前资产净值为 2,120,000,000 元，同庆 B 份额折算前资产净值为 2,700,000,000 元。当天场外长盛同庆份额、场内长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额的份额数分别为 30 亿份、10 亿份、20 亿份、30 亿份。折算基准日，长盛同庆份额的净值为 0.96400000 元，同庆 A 份额的参考净值为 1.06000000 元，同庆 B 份额的参考净值为 0.90000000 元且未进行不定期份额折算。

定期份额折算的对象为基准日登记在册的同庆 A 份额和长盛同庆份额，即 20 亿份、40 亿份（30 亿份+10 亿份）。（由于本基金采用循环进位的方法分配因小数点运算引起的剩余份额，这样，在实际操作中，份额数计算结果的舍去部分可能直接进位，也可能直接舍去。假设本例中对份额折算的计算结果舍去部分未进行进位。）

1) 同庆 A 份额：

定期份额折算后同庆 A 份额的份额数=定期份额折算前同庆 A 份额的份额数

$$NUM_A^{后} = NUM_A^{前}$$

$$NAV_{同庆}^{后}$$

$$= \frac{\text{折算前长盛同庆份额的资产净值} - (NAV_A^{前} - 1.000) \times 0.4 \times NUM_{同庆}^{前}}{NUM_{同庆}^{前}}$$

$$= \frac{[3,856,000,000 - (1.06000000 - 1.000) \times 0.4 \times 4,000,000,000]}{4,000,000,000}$$

$$= 0.940 \text{元}$$

$$\begin{aligned}
& \text{同庆A份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数} \\
&= \frac{NUM_{A前} \times (NAV_{A前} - 1.000)}{NAV_{同庆后}} \\
&= \frac{2,000,000,000 \times (1.06000000 - 1.000)}{0.940} = 127,659,574.47 \text{份}
\end{aligned}$$

同庆 A 份额持有人新增的长盛同庆份额的场内份额取整计算（最小单位为 1 份），因此新增长盛同庆份额为 127,659,574 份。

2) 同庆 B 份额：

同庆 B 份额折算基准日的参考净值为 0.90000000 元，处于 1.000 元及以下，定期份额折算不改变同庆 B 份额的参考净值及其份额数。

3) 长盛同庆份额：

场内长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

$$\begin{aligned}
&= \frac{NUM_{同庆前} \times 0.4 \times (NAV_{A前} - 1.000)}{NAV_{同庆后}} \\
&= \frac{1,000,000,000 \times 0.4 \times (1.06000000 - 1.000)}{0.940} \\
&= 25,531,914.89 \text{份}
\end{aligned}$$

场内长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数，取整后为 25,531,914 份。

场外长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

$$\begin{aligned}
&= \frac{NUM_{同庆前} \times 0.4 \times (NAV_{A前} - 1.000)}{NAV_{同庆后}} \\
&= \frac{3,000,000,000 \times 0.4 \times (1.06000000 - 1.000)}{0.940} \\
&= 76,595,744.68 \text{份}
\end{aligned}$$

定期份额折算后长盛同庆份额的份额数

$$\begin{aligned}
&= \text{定期份额折算前长盛同庆份额的份额数} \\
&+ \text{同庆 A 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数} \\
&+ \text{长盛同庆份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数} \\
&= 4,000,000,000 \text{份} + 127,659,574 \text{份} + 25,531,914 \text{份} + 76,595,744.68 \text{份} \\
&= 4,229,787,232.68 \text{份}
\end{aligned}$$

5. 基金份额定期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对同庆 A 份额与同庆 B 份额实施停牌并暂停长盛同庆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。

#### 6. 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，并报中国证监会备案。

#### 7. 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。

#### (二) 基金份额的不定期折算

除以上定期份额折算外，在分级运作期内，当同庆 B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下，本基金还将进行不定期份额折算。

##### 1. 基金份额折算基准日

同庆 B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下时，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庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额。

##### 3. 基金份额折算频率

不定期。

##### 4. 基金份额折算方式

当同庆 B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下时，本基金将分别对长盛同庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保同庆 A 份额和同庆 B 份额的比例为 4:6，长盛同庆份额的净值以及同庆 A 份额和同庆 B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。

#### (1) 同庆 B 份额

份额折算原则：

份额折算前同庆 B 份额的资产与份额折算后同庆 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，

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后同庆 B 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{前}}$  为折算前同庆 B 份额的份额数；

$NAV_B^{\text{前}}$  为折算前同庆 B 份额的参考净值。

## (2) 同庆 A 份额

份额折算原则：

i) 份额折算前后同庆 A 份额与同庆 B 份额始终保持 4:6 配比；

ii) 份额折算前同庆 A 份额的持有人在份额折算后将持有同庆 A 份额与新增场内长盛同庆份额；

iii) 份额折算前同庆 A 份额的资产等于份额折算后同庆 A 份额的资产与其新增场内长盛同庆份额的资产之和。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}} \times \frac{4}{6}$$

$$\text{同庆 A 份额持有人新增的场内长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中，

$NUM_A^{\text{后}}$  为折算后同庆 A 份额的份额数；

$NUM_B^{\text{后}}$  为折算后同庆 B 份额的份额数；

$NUM_A^{\text{前}}$  为折算前同庆 A 份额的份额数；

$NAV_A^{\text{前}}$  为折算前同庆 A 份额的参考净值。

## (3) 长盛同庆份额

份额折算原则：

份额折算前长盛同庆份额的资产与份额折算后长盛同庆份额的资产（不含同庆 A 份额折算后新增的长盛同庆份额的资产）相等。

$$\text{长盛同庆份额持有人不定期折算后持有的长盛同庆份额的份额数} = \frac{NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}} \times NAV_{\text{同庆}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中，

$NUM_{\text{同庆}}^{\text{后}}$  为折算后长盛同庆份额的份额数；

$NUM_{\text{同庆}}^{\text{前}}$  为折算前长盛同庆份额的份额数；

$NAV_{同庆}^{前}$  为折算前长盛同庆份额的净值。

不定期份额折算后长盛同庆份额的份额数  
 = 不定期份额折算后长盛同庆份额持有人持有的长盛同庆份额的份额数  
 + 同庆 A 份额持有人新增的长盛同庆份额的份额数

场内的长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），场外的长盛同庆份额折算后的份额数保留到小数点后第 2 位，以循环进位方式分配因运算产生的剩余份额。

例如，某投资者持有场内长盛同庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额的份额数分别为 10,000 份、20,000 份和 30,000 份，在本基金的不定期份额折算基准日，三类份额的基金份额净值如下表所示，折算后，长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额三类基金份额净值均调整为 1.000 元。

	折算前		折算后	
	基金份额净值 (或参考净值)	基金份额	基金份额净值 (或参考净值)	基金份额
长盛同庆 份额	0.56500000 元	10,000 份	1.000 元	5,650 份长盛同庆份额
同庆 A 份额	1.04500000 元	20,000 份	1.000 元	4,900 份同庆 A 份额 +新增 16,000 份场内长盛同庆份额
同庆 B 份额	0.24500000 元	30,000 份	1.000 元	7,350 份同庆 B 份额

#### 5. 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对同庆 A 份额与同庆 B 份额实施停牌并暂停长盛同庆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。

#### 6. 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。

## 二十一、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

本基金分级运作期到期后，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，按照基金合同参考净值计算规则分别对同庆 A 份额和同庆 B 份额计算分级运作期期末基金份额参考净值，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。场内的长盛同庆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；场外的长盛同庆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同庆 A 份额和同庆 B 份额，将按照本基金所约定的参考净值计算规则分别计算同庆 A 份额和同庆 B 份额分级运作期期末参考净值，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。无论基金份额持有人单独持有或同时持有同庆 A 份额和同庆 B 份额，均无需支付转换基金份额的费用。

#### 2. 同庆 A 份额和同庆 B 份额的分级运作期期末份额转换

##### （1）转换基准日确定

本基金所分拆的同庆 A 份额和同庆 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三年的对应日，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，基金管理人将根据同庆 A 份额和同庆 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，同庆 A 份额和同庆 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同庆 A 份额和同庆 B 份额参考净值计算见

本招募说明书“九、分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则”。

同庆 A 份额和同庆 B 份额转换公式为：

同庆 A 份额转换为长盛同庆份额的份额数 = 转换前同庆 A 份额的份额数 × 转换基准日同庆 A 份额参考净值 / 转换基准日长盛同庆份额净值

同庆 B 份额转换为长盛同庆份额的份额数 = 转换前同庆 B 份额的份额数 × 转换基准日同庆 B 份额参考净值 / 转换基准日长盛同庆份额净值

其中，转换基准日长盛同庆份额净值、同庆 A 份额和同庆 B 份额的参考净值保留到小数点后 8 位，小数点后第 9 位四舍五入；转换后得到的长盛同庆份额的份额数，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。

例如，假设本基金分级运作期到期日为 2015 年 5 月 21 日（周四），即转换基准日为该日，长盛同庆份额净值为 1.25000000 元，同庆 A 份额参考净值为 1.07000000 元，同庆 B 份额参考净值为 1.37000000 元。

某场外基金持有人持有同庆 A 份额 50,000 份，同庆 B 份额 60,000 份。则转换后：

同庆 A 份额转换为长盛同庆份额的份额数  
= 50,000 × 1.07000000 / 1.25000000 = 42,800.00 份

同庆 B 份额转换为长盛同庆份额的份额数  
= 60,000 × 1.37000000 / 1.25000000 = 65,760.00 份

某场内基金持有人持有同庆 A 份额 50,000 份，同庆 B 份额 60,000 份。则转换后，长盛同庆份额的份额数取整为：

同庆 A 份额转换为长盛同庆份额的份额数  
= 50,000 × 1.07000000 / 1.25000000 = 42,800 份

同庆 B 份额转换为长盛同庆份额的份额数  
= 60,000 × 1.37000000 / 1.25000000 = 65,760 份

### （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对同庆 A 份额与同庆 B 份额实施停牌并暂停长盛同庆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同庆 A 份额与同庆 B 份额的上市交易，基金份额净值将在转换基准日长盛同庆份额净值的基础上变动，本基金在转换基准日后不超过 30 天开放长盛同庆份额申购、赎回业务，转换基准日后的长盛同庆份额申购、赎回以申购、赎回当日的长盛同庆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 日长盛同庆份额净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

$T$  日长盛同庆份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日长盛同庆份额的余额数量

长盛同庆份额净值的计算，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“长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（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. 同庆 A 份额和同庆 B 份额基金份额转换结束后，基金管理人将按照相关

规定进行公告。

## 二十二、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### (一) 招募说明书

招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在基金管理人网站上，将更新后的招募说

说明书摘要登载在指定报刊和基金管理人网站上；基金管理人在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

## （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金合同生效日前按有关规定，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## （三）基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前在指定报刊及基金管理人网站上公告。

## （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 3 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## （五）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

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、长盛同庆份额净值和同庆 A 份额、同庆 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庆份额净值、长盛同庆份额累计净值和同庆 A 份额、同庆 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、长盛同庆份额净值和同庆 A 份额、同庆 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、长盛同庆份额净值、长盛同庆份额累计净值和同庆 A 份额、同庆 B 份额参考净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

## （六）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 基金管理人应当在每年结束之日起 90 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。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2. 基金管理人应当在上半年结束之日起 60 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；

3. 基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 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；

4. 基金合同生效不足 2 个月的，本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。

5. 基金定期报告应当按有关规定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。

#### （七）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 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：

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；
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 50%；
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 30%；
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 0.5%;
18. 基金改聘会计师事务所;
19. 基金变更、增加或减少代销机构;
20. 基金更换注册登记机构;
21. 本基金限定赎回期的起讫时间确定;
22. 原长盛同庆基金封闭期到期后基金份额的转换及转换完成;
23. 本基金开始办理申购、赎回;
24. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
25. 本基金发生巨额赎回并延期支付;
26. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
27. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
28. 赎回限定期结束后长盛同庆份额的折算;
29. 分级运作期的起讫时间确定;
30. 分级运作期起始日长盛同庆份额的分拆;
31. 本基金接受或暂停接受份额配对转换申请;
32. 本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务;
33. 本基金实施基金份额折算及折算完成;
34. 原同庆 A 份额、原同庆 B 份额终止上市;
35. 同庆 A 份额、同庆 B 份额上市交易、暂停上市、恢复上市或终止上市;
36. 分级运作期到期基金份额的转换;
37. 分级运作期到期转换为上市开放式基金 (LOF) 的上市交易;
38. 中国证监会或基金合同规定的其他事项。

#### (八) 澄清公告

在基金合同存续期限内,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。

#### (九) 基金份额持有人大会决议

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。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 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）中国证监会规定的其他信息

（十一）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 二十三、风险揭示

### （一）投资于本基金的主要风险

#### 1. 市场风险

本基金主要投资于证券市场，而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险。市场风险主要包括：

（1）政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

（4）上市公司经营风险：上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

（5）购买力风险：基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

#### 2. 信用风险

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

#### 3. 流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回和基金间转换。由于中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回和

基金间转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

#### 4. 管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

(1) 决策风险：指基金投资的投资策略制定和投资决策执行过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

(2) 操作风险：指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

(3) 技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

#### 5. 本基金特定投资策略带来的风险

##### (1) 指数投资风险

本基金为股票型指数基金，投资标的为中证 800 指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

##### ① 系统性风险

本基金为股票型基金，重点投资于中证 800 指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临中证 800 指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

##### ② 投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

##### ③ 标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

##### ④ 跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

A. 基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

B. 指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

C. 当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

D. 投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

E. 在基金进行指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

F. 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

#### ⑤标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场，标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

### (2) 基金运作的特有风险

#### ①上市交易风险

分级运作期内，同庆 A 份额与同庆 B 份额在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖同庆 A 份额与同庆 B 份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致同庆 A 份额与同庆 B 份额产生流动性风险。

分级运作期到期后，长盛同庆份额（LOF）在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖长盛同庆份额（LOF），产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致同庆 A 份额与

同庆 B 份额产生流动性风险。

### ②分级运作期内杠杆机制风险

本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分拆的两类基金份额来看，同庆 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；同庆 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

由于同庆 B 份额内含杠杆机制的设计，同庆 B 份额参考净值的变动幅度将大于长盛同庆份额和同庆 A 份额参考净值的变动幅度，即同庆 B 份额参考净值变动的波动性要高于其他两类份额。

### ③折/溢价交易风险

分级运作期内，同庆 A 份额与同庆 B 份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额参考净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将同庆 A 份额和同庆 B 份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

分级运作期到期后，长盛同庆份额（LOF）上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。

### ④风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在同庆 B 份额参考净值跌到 0.250 元以下后，本基金将进行份额不定期份额折算。原同庆 A 份额持有人将会获得一定比例的长盛同庆份额，且同庆 B 份额持有人持有的份额的杠杆率将大幅变小，因此原同庆 A 份额持有人和同庆 B 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

### ⑤份额折算和转换风险

A. 在基金份额折算或转换过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

场外份额进行份额折算或转换时计算结果保留到小数点后 2 位，场内份额计算结果保留至整数位（最小单位为 1 份），采用循环进位的方法分配因小数点运算引起的剩余份额。因此，在基金份额折算或转换过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

B. 份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

新增份额可能面临无法赎回的风险是指在场内购买同庆 A 份额或同庆 B 份额的一部分投资者可能面临的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金代销资格的证券公司购买同庆 A 份额或同庆 B 份额，在其参与份额折算后，则折算新增的长盛同庆份额并不能被赎回。此风险需要引起投资者注意，投资者可以选择在份额折算前将同庆 A 份额或同庆 B 份额卖出，或者将新增的长盛同庆份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

#### ⑥份额配对转换业务中存在的风险

基金合同生效后，在长盛同庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额的存续期内，基金管理人将根据基金合同的约定办理长盛同庆份额与同庆 A 份额、同庆 B 份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变同庆 A 份额和同庆 B 份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

#### ⑦基金的收益分配

在存续期内，本基金（包括长盛同庆份额、同庆 A 份额和同庆 B 份额）将不进行收益分配。

在定期折算基准日，基金管理人将根据基金合同的约定对本基金长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额实施定期份额折算。基金份额折算后，如果出现新增份额的情形，投资者可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获取投资回报，但是，投资者通过变现折算后的新增份额以获取投资回报的方式并不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

### 6. 其他风险

(1) 随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

(2) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

(3) 因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

- (4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- (5) 因业务竞争压力可能产生的风险；
- (6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- (7) 其他意外导致的风险。

(二) 声明

1. 本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。
2. 除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 二十四、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### （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）在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率；
- （3）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- （4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）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）基金合同的终止

有下列情形之一的，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. 基金财产清算及剩余财产的分配

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、交纳所欠税款并清偿基金债务后进行分配。

本基金在分级运作期提前终止情形时，按照所约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配。如果存在未弥补的同庆 A 份额的份额收益及本金资产的差额，本基金按照上述规定不再弥补。

### 6. 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。

### 7. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十五、基金合同内容摘要

### (一) 基金管理人

基金管理人：长盛基金管理有限公司。

#### 1. 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) 依照本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。

## 2. 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，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)编制半年度和年度基金报告；
- (13)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14)保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (15)按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人

分配收益；

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

(17)保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

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

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

(22)按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23)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。

## (二) 基金托管人

基金托管人：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)。

### 1. 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。

## 2. 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。

### （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，长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 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“七、分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则”之规定对同庆 A 份额和同庆 B 份额进行参考净值计算时，持有长盛同庆份额的基金份额持有人将被视作其同时持有按 4:6 的比例分拆的同庆 A 份额和同庆 B

份额，并将分别按分拆后的同庆 A 份额和同庆 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，每份长盛同庆份额具有同等的合法权益。

#### 1. 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。

#### 2. 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。

#### （四）基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

在本基金分级运作期内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额持有人独立进行表决，长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 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。

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。

##### 1. 召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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，但本基金分级运作期到期后转为上市型开放式（LOF）基金除外；
- （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。

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)在法律法规和基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率；
- (3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4)对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5)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.召集人和召集方式

(1)除法律法规或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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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

庆份额、同庆 A 份额、同庆 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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。

### 3.召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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。

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。

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。

#### 4. 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额应分别占权益登记日长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 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书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

###### 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额应分别占权益登记日长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额各自基金份额 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。

## 5. 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

①议事内容为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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额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，则不影响在公证机关监督下形成的决议的有效性。

(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。

#### 6.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庆份额、同庆 A 份额、同庆 B 份额持有人独立进行表决，且长盛同庆份额、同庆 A 份额、同庆 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)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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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庆份额、同庆 A 份额、同庆 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。

## 7. 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。

## 8. 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。

9.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。

(五) 基金合同的终止和基金财产的清算

1.有下列情形之一的，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。

2.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。

3.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。

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. 基金财产清算及剩余财产的分配

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、交纳所欠税款并清偿基金债务后进行分配。

本基金在分级运作期提前终止情形时，按照所约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配。如果存在未弥补的同庆 A 份额的份额收益及本金资产的差额，本基金按照上述规定不再弥补。

#### (六) 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。

#### (七) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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。

## 二十六、基金托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

本基金基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

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）。

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。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限对基金投资总体进行监督：

（1）本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 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。

（2）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%。

（3）本基金参与股票发行申购，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；

（4）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；

(5) 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%, 基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。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。

(6) 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%; 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, 不得超过该基金资产净值的10%; 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过该基金资产净值的20%; 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。

(7) 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。

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。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形, 而导致证券投资比例低于基金合同约定的, 基金管理人履行相关程序后可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。法律法规如有变更, 从其变更。

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。除投资资产配置比例外, 基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定, 基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性, 并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时, 基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措

施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、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。

6. 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方

式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

7. 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

8. 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1. 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2. 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一个工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定

期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

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

#### （四）基金财产的保管

##### 1. 基金财产保管的原则

(1) 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

(2) 基金托管人应安全保管基金财产。

(3) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

(4) 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

(5) 基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

(6) 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

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

##### 2. 基金募集期间及募集资金的验资

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金由长盛同庆可分离交易股票型证

券投资基金转型而成。长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》及其他有关规定，并经中国证监会 2009 年 03 月 06 日证监许可字[2009]209 号文批准募集。长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金于 2009 年 5 月 6 日起向全社会公开募集，并于 2009 年 5 月 12 日获得中国证监会书面确认，基金合同生效。具体募集情况如下：

(1) 经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集有效认购总户数为 25,524 户，总净缴存金额（不含手续费）人民币 14,685,567,143.82 元，确认份额（不含利息结转份额）14,685,567,143.82 份，利息结转份额 1,166,095.24 份，总确认份额 14,686,733,239.06 份。本基金认购份额计算结果采用四舍五入的方法场内保留至整数位，场外保留小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。上述本基金的净缴存金额已于 2009 年 5 月 12 日划入本基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的资产托管专户。

(2) 本基金按照每份基金份额 1.00 元计算，募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计 14,686,733,239.06 份基金份额，按照约定的基金份额分离规则自动按 4:6 分离为同庆 A 和同庆 B 份额，其中同庆 A 的基金份额为 5,874,693,295.62 份，同庆 B 的基金份额为 8,812,039,943.44 份。

### 3. 基金资金账户的更名和管理

(1) 基金托管人应以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户或依据监管部门批复对原资金账户进行更名，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

### 4. 基金证券账户和结算备付金账户的更名和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公

司依据监管部门批复对原证券账户进行更名。

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

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

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

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

#### 5. 债券托管专户的更名和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司依据监管部门批复对原托管账户与结算账户进行更名，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### 6. 其他账户的开立和管理

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

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保

管责任。

#### 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

#### （五）基金资产净值计算和会计核算

##### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。基金管理人每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

##### 2. 复核程序

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

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

#### （六）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于

15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### （七）托管协议的变更、终止和基金财产的清算

##### 1. 托管协议的变更程序

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

##### 2. 基金托管协议终止出现的情形

- (1) 基金合同终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

##### 3. 基金财产的清算

###### （1）基金财产清算小组

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) 在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4) 基金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) 基金财产清算及剩余财产的分配

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、交纳所欠税款并清偿基金债务后进行分配。

本基金在分级运作期提前终止情形时，按照所约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配。如果存在未弥补的同庆 A 的份额收益及本金的差额，本基金按照上述规定不再弥补。

#### (6) 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。

(7) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 争议解决方式

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

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

本协议受中国法律管辖。

## 二十七、对基金份额持有人的服务

基金管理人为基金份额持有人提供以下一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，增加、修改服务项目：

### （一）基金份额持有人注册登记服务

基金管理人委托或作为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）定期投资计划

在条件成熟时，基金管理人可通过代销机构和网上直销为基金份额持有人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，基金份额持有人可以通过固定的渠道，定期申购基金份额，该定期申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。

### （三）主动通知服务

基金管理人通过邮寄、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，包括邮寄季度交易对账单、发送月度电子对账单、交易确认的电子邮件和短信通知、对账单寄送失败的电子邮件或短信通知、公司公告及重要信息的电子邮件或短信主动通知等服务。

### （四）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 小时自助语音服务、网上查询、短信查询。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。

具体查询内容：

自助语音及网上查询：最新活动公告、各基金介绍、公司介绍等公司信息；基金交易查询、投资现值查询、基金分红查询、对账单查询等账户信息

短信查询：基金净值情况、账户情况  
或可直接致电客户服务热线转人工查询。

#### （五）资料索取服务

为方便份额持有人办理各种交易手续，同时方便客户了解长盛基金，基金管理人提供了资料索取服务。

基金份额持有人可通过客户服务热线转人工索取以下信息：直销业务表格、封闭式及开放式基金公告、任意交易时间段内对账单、个人资产证明及我公司其它对外公布信息。客户服务人员将通过传真、EMAIL 及邮寄形式提供以上索取信息。

同时，公司网站上提供各种资料、业务表单及公告下载。

#### （六）资讯服务定制

为进一步提升服务品质，满足客户个性化需要，基金管理人推出全方位资讯服务定制计划。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 EMAIL、短信等多渠道发送资讯定制服务。

基金管理人会按照基金份额持有人要求定期提供月度电子对账单、电子成交确认单、短信成交通知、持有基金每周净值短信、临时公告短信等。

基金管理人不定期发送不同资讯，内容不仅全方位涵盖了公司全部可披露信息，而且包含市场的最新信息、深度新闻资讯及基金管理人的市场判断、操作等。

另外，基金管理人每季度还为基金份额持有人准备了精美的季刊，使基金份额持有人能深切体会长盛的公司文化、了解公司研究成果。

#### （七）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为客户解答疑问，提供关于基金投资全方位的咨询服务。同时，还提供在线交流及手机短信交流。

#### （八）投诉建议受理

如果基金份额持有人对基金管理人提供的各项服务有疑问，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等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



(四) 2012 年 11 月 27 日本基金管理人发布长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)。

(五) 2012 年 11 月 27 日本基金管理人发布长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要。

(六) 2012 年 12 月 1 日本基金管理人发布关于旗下部分基金参加中国银行网银、手机银行基金申购及基金定投业务费率优惠活动的公告。

(七) 2013 年 1 月 18 日本基金管理人发布关于增加财通证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠的公告。

(八) 2013 年 1 月 19 日本基金管理人发布长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2012 年度第 4 季度报告。

(九) 2013 年 1 月 25 日本基金管理人发布关于增加方正证券为旗下开放式基金代销机构的公告。

(十) 2013 年 1 月 25 日本基金管理人发布关于增加国海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告。

(十一) 2013 年 3 月 15 日本基金管理人发布关于调整长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理的公告。

(十二) 2013 年 3 月 26 日本基金管理人发布长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2012 年年度报告。

(十三) 2013 年 3 月 26 日本基金管理人发布长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2012 年年度报告摘要。

(十四) 2013 年 4 月 12 日本基金管理人发布关于增加东兴证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告。

(十五) 2013 年 4 月 19 日本基金管理人发布长盛基金管理有限公司成都分公司负责人变更的公告。

(十六) 2013 年 4 月 20 日本基金管理人发布长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2013 年度第 1 季度报告。

## 二十九、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人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。投资者还可以直接登录基金管理人的网站(<http://www.csfunds.com.cn>)查阅和下载招募说明书。

### 三十、备查文件

(一) 本基金备查文件包括下列文件:

1. 中国证监会核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件(证监许可〔2012〕549号);
2. 《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议公告》;
3. 《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》;
4. 《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金托管协议》;
5. 法律意见书;
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照;
8. 中国证监会要求的其他文件。

(二) 备查文件的存放地点和投资者查阅方式

1. 存放地点: 基金合同、托管协议存放在基金管理人和基金托管人处; 其余备查文件存放在基金管理人处。
2. 查阅方式: 投资者可在营业时间免费到存放地点查阅, 也可按工本费购买复印件。

长盛基金管理有限公司

二〇一三年六月七日