(上接A21版)

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

四)投资策略

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

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%，其中投资于深证100等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中，权证资产占基金资产净值的比例为0-3%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。

2.股票投资组合构建

①组合构建原则

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

②组合构建方法

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

③组合调整

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

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

①定期调整

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

②临时调整

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

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

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

③其他调整

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

4.投资绩效评估

在正常市场情况下，本基金力争年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

5.债券投资策略

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

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

4.权证投资策略

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

①权证比较基准

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

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

②风险收益特征

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

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

七)投资管理程序

1.投资决策依据

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

2.投资管理体制

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

3.投资管理程序

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

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

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

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

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

⑤投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，并撰写相关的绩效评估报告，确认基金组合是否实现了投资预期，投资策略是否成功，并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。

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

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

八)投资限制

1.组合限制

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

①本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

②基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

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

⑤本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不超过基金资产净值的10%；

⑥本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

⑦本基金持有的同一指同一信用级别资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

⑧本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

⑨本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

⑩准持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

如果法律法规对本基金合同的定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

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

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

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

①承销证券；

②向他人贷款或者提供担保；

③从事承担无限责任的投资；

④买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

⑤向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

⑥买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

⑦从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

⑧依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

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

九.基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法：

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

2.不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3.有利于基金财产的安全与增值；

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

十.基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十一.本基金分级运作期到期转换为上市开放式基金（LOF）后的投资策略

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

九、基金资产净值的计算方式和公告

（一）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（二）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

基金合同生效后，本基金分级运作期内，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、长盛同辉深100等权重份额净值和长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额参考净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过基金管理人网站、代销机构以及其他媒介，披露开放日的长盛同辉深100等权重份额净值、长盛同辉深100等权重份额累计净值和长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额参考净值。

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

十、分级运作期内基金份额的折算

（一）基金份额的定期折算

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

1.基金份额折算基准日

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

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

2.基金份额折算对象

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

3.基金份额折算方式

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

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

1)长盛同辉深100等权重A份额

[illegible]

2)长盛同辉深100等权重B份额

长盛同辉深100等权重B份额参考净值及份额数不进行定期折算。

3)长盛同辉深100等权重份额

[illegible]

定期份额折算后长盛同辉深100等权重份额的份额数

= 定期份额折算前长盛同辉深100等权重份额的份额数

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

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

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

（二）基金份额的不定期折算

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

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

①基金份额折算基准日

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

②基金份额折算对象

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

③基金份额折算频率

不定期。

④基金份额折算方式

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

1)长盛同辉深100等权重A份额

份额折算原则：

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

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

[illegible]

2)长盛同辉深100等权重B份额

份额折算原则：

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

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

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

[illegible]

3)长盛同辉深100等权重份额

份额折算原则：

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

[illegible]

不定期份额折算后长盛同辉深100等权重份额的份额数

= 不定期份额折算前长盛同辉深100等权重份额的份额数

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

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

+ 长盛同辉深100等权重份额持有场内长盛同辉深100等权重份额的份额数

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

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

①基金份额折算基准日

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

②基金份额折算对象

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

③基金份额折算频率

不定期。

④基金份额折算方式

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

1)长盛同辉深100等权重B份额

份额折算原则：

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

[illegible]

2)长盛同辉深100等权重A份额

份额折算原则：

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

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

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

[illegible]

3)长盛同辉深100等权重份额

份额折算原则：

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

[illegible]

不定期份额折算后长盛同辉深100等权重份额的份额数

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

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

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

十一、分级运作期到期后基金份额的转换

（一）分级运作期到期后基金的存续形式

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

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

（二）分级运作期到期后的份额转换规则

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

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

1)转换基准日确定

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

2)转换方式及份额计算

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

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

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

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

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

（三）基金转换后申购与赎回的计算

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

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

四)基金转换后T日长盛同辉深100等权重份额净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

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

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

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

(五)分级运作期到期后基金的投资管理

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

(六)分级运作期到期的公告

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

②在分级运作期到期前三十个工作日，基金管理人还将进行提示性公告。

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

十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

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

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

②变更基金类别；

③变更基金投资目标、投资范围或投资策略；

④变更基金份额持有人大会程序；

⑤更换基金管理人、基金托管人；

⑥提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

⑦本基金与其他基金的合并；

⑧对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

⑨法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

①调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

②在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

③因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

④对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

⑤基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

⑥标的指数更名或调整指数编制方法；

⑦按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

（二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

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

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

4.中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1.基金财产清算组

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

②基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

2.基金财产清算程序

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

①基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

②基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

③对基金财产进行清理和确认；

④对基金财产进行估价和变现；

⑤聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

⑥聘请律师事务所出具法律意见书；

⑦将基金财产清算结果报告中国证监会；

⑧参加与基金财产有关的民事诉讼；

⑨公布基金财产清算结果；

⑩对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

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

4.基金财产按下列顺序清偿：

①支付清算费用；

②交纳所欠税款；

③清偿基金债务；

④按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）-（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

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

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

十三、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同受中国法律管辖。

十四、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

（一）基金合同正本一式八份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外，基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

（二）本基金合同可印刷成册，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。

(上接A21版)

经确认的长盛同辉深100等权重B份额=100,080−50,040=50,040份

即：投资者认购10万份基金份额，需缴纳101,000.00元，若利息折算的份额为80份，则总共可得到100,080份基金份额。基金发售结束后，投资者经确认的长盛同辉深100等权重A份额50,040份，长盛同辉深100等权重B份额50,040份。

7、场外认购份额计算结果四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。利息折算的份额四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

场内认购时，认购方式为份额认购，认购的份额为整数。利息折算的份额保留至整数位（最小单位为1份），整数位以后部分采取截位法，余额计入基金财产。

二、发售方式及相关规定

（一）销售渠道

本基金通过场内、场外两种方式公开发售。在基金募集阶段，本基金以同一个基金份额认购代码在深圳证券交易所场内和场外代销机构同时募集。

本基金的场外认购通过基金管理人直销机构、代销机构办理基金销售业务的营业场所办理或按基金管理人直销机构、代销机构提供的其他方式办理。销售机构名单和联系方式见附件。基金管理人直销机构、代销机构办理基金认购业务的地区、网点的具体情况和联系方法，请参见附件以及当地销售机构的公告。基金管理人可以根据情况变更或增减基金代销机构，并另行公告。

场内将通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位发售（具体名单请见附件）。本基金认购期结束前获得基金代销业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。尚未取得相应业务资格，但属于深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金上市后，代理投资人通过深圳证券交易所交易系统参与本基金长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额的上市交易。

（二）认购业务办理时间

本基金认购时间：2012年8月20日至2012年9月7日。场内认购具体开放时间为深圳证券交易所交易日交易时间，场外认购具体开放时间以各销售机构的规定为准。

各个销售机构在本基金发售募集期内对于个人投资者或机构投资者的具体业务办理时间可能不同，具体视各销售机构而定。

（三）认购原则

①基金场外认购采用金额认购方式，场内认购采用份额认购方式；

②基金投资者认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款；

③基金投资者在募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。认购一经受理不得撤销；

④募集期间单个基金投资者的累计认购金额没有上限限制；

⑤销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

（四）认购的数额限制

本基金场内认购采用份额认购的方式。通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位进行场内认购时，投资者以份额申请，单笔最低认购份额为50,000份，超过50,000份的应为1,000份的整数倍，且每笔认购份额最大不超过999,999,000份。

本基金场外认购采用金额认购的方式。在本基金代销机构场外认购时，投资者以金额申请，每个基金账户单笔认购的最低金额为人民币50,000元，每笔追加认购的最低金额为50,000元。在此基础上，直销机构或各代销机构对最低认购限额及交易级差有其他规定的，以其业务规定为准。

三、场外认购的开户与认购程序

（一）场外认购的开户、账户使用及转托管说明

1、使用账户说明

投资者通过场外认购本基金应使用中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。

①已有深圳A股账户或证券投资基金账户的投资者，不需重新办理深圳开放式基金账户的开户，可直接对原有账户进行账户注册，即将已有的深圳A股账户或证券投资基金账户注册为深圳开放式基金账户。

②尚无深圳A股账户或证券投资基金账户的投资者，可直接办理深圳开放式基金账户的开户，中国证券登记结算有限责任公司同时为其配发深交所场内基金账户。对于配发的深圳基金账户，投资者可持基金管理人或代理销售机构提供的账户配号凭条，到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构打印深交所场内基金账户卡。

③已通过本基金管理人指定的代理销售机构或直销网点办理过深圳开放式基金账户注册手续的投资者，可在原处直接认购本基金。

④已通过本基金管理人指定的代理销售机构或直销网点办理过深圳开放式基金账户注册手续的投资者，拟通过其他代理销售机构认购本基金的，须用深圳开放式基金账户在新的代理销售机构处办理开放式基金账户注册确认。

2、账户使用注意事项

①投资者已开立的长盛基金管理有限公司自建TA的基金账户不能用于认购长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金。

②拥有多个深圳A股账户或证券投资基金账户的投资者，只能选择其中一个注册为深圳开放式基金账户。为了日后方便办理相关业务，建议投资者通过深交所认购、申购与赎回及买卖上市开放式基金也只使用该注册账户。

③对于通过中国证券登记结算有限责任公司配发深交所场内基金账户的投资者，为了日后方便办理相关业务，建议投资者通过深交所场内认购、申购与赎回及买卖上市开放式基金也只使用配发的基金账户。

3、场外转托管至场内的说明

通过场外直销机构、代销机构认购本基金，登记在注册登记系统（场外）中的基金份额，投资者也可通过办理跨系统转托管业务，从注册登记系统转托管到证券登记结算系统（场内）后，实现基金份额在深交所上市交易。投资者可按以下程序办理：直销机构代销机构转至证券营业部场内：

①在正式申请办理转托管之前，投资者须在拟转入证券营业部办理其深圳开放式基金账户基础账户（即开放式基金账号后十位，为深交所A股账号或场内基金账号）的注册手续，并确定拟转入证券营业部的席位代码。

②T日，投资者在转出方直销机构、代销机构提出跨系统转托管申请，注明转入证券营业部席位代码、开放式基金账户号码、基金代码、转托管数量，其中转托管数量须为整数份。

③自T+2日始，投资者可以在转入方证券营业部进行查询或交易。

（二）通过长盛基金管理有限公司