（上接A21版）

77.标的指数：深证100等权重指数

78.不可抗力：指本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

第三部分 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：北京市海淀区北大平庄路18号城建大厦A座21层

法定代表人：风良志

电话：010-82019998

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［999］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，本公司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%；安徽省投资集团有限责任公司 现名称为安徽省投资集团控股有限公司）占注册资本的13%。截至2012年8月16日，基金管理人共管理两只封闭式基金、十九只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理多只专户理财产品。

二、 主要人员情况

1.基金管理人董事会成员：

风良志先生，董事长，博士，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。现任国元证券股份有限公司董事长。

钱正光先生，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有限责任公司 现名称为安徽省投资集团控股有限公司党委书记、董事长。

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。现任国元证券股份有限公司董事、总裁。

陈淑珊女士，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括ING新资证券公司、花旗银行、摩根士丹利。现任星展银行有限公司亚太区人力资源主管。

张在荣先生，董事，学士。曾任职多个金融机构，包括法国东方汇理银行、美洲银行、渣打银行、星展银行有限公司。现任星展银行 中国）有限公司执行董事兼行政总裁。

周兵先生，董事，总经理，硕士，经济师。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。

李怖强先生，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，金融学泽座教授，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 秋伴倡自强）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。

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

钱进先生，监事，硕士研究生。曾任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理，安徽省投资集团有限责任公司董事监察部经理、总经理助理、总经济师。现任安徽省投资集团有限责任公司 现名称为安徽省投资集团控股有限公司）党委委员、副总经理。

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。

3.管理层成员

风良志先生，董事长，博士，高级经济师。同上。

周兵先生，董事、总经理，硕士，经济师。同上。

杨思乐先生，美国籍，拥有北京大学学士学位与美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务部经理，安徽省信托投资公司财务部副经理，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.基金业务部门

刘斌先生，1979年6月出生。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执行总监，自2009年11月25日起任长盛量化红利策略股票型证券投资基金（本基金）基金经理，自2012年7月20日起兼任长盛价值证券投资基金基金经理。

（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

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，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可动态分析策略股票型证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理，投资管理部总监，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理、长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

侯继维先生，清华大学博士。历任国泰君安证券研究所任研员、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，研究发展部总监，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，新加坡华盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛环球点亮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等职务。现任固定收益部总监，社保组合经理，长盛动鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同裕信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫一号保本混合型证券投资基金基金经理。

刘斌先生，工学博士，金融工程与量化投资部执行总监，同上。

邓永明先生，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。现任投资管理部副总监，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。

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。现任社保组合组合经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、 基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，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、法律法规、中国证监会规定的其他职责。

四、 基金管理人的承诺

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。

五、 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，尚未依法予以披露的信息内容、基金投资计划等信息；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、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—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、制度执行及遵规守法进行监察稽核；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，并通过全面稽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。

《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提，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。

《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。

《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，对制度中存在的不合理情况，监察稽核部有权提请相关部门修改。同时报告总经理和公司督察长，以保证多重检查复核。

③建立了一套报告制度。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，定期向督察长出具检查报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

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

第四部分 基金托管人

一、基金托管人情况

（一）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：或什么但总拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆什元

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［998]12号

联系人：尹 东

联系电话：010）6759 5003

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，中国建设银行以“东方第一家H股公司首发但生涯数，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250,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2011 年9月30日，中国建设银行资产总额117,723.30亿元，较上年末增长8.90%。截至2011年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,39207亿元，较上年同期增长25.82%。年化平均资产回报率为1.64%，年化加权平均净资产收益率为24.82%。利息净收入2,230.10亿元，较上年同期增长22.41%。净利息差为2.56%，净利息收益率为2.68%，分别较上年同期提高 021 和 023 个百分点。手续费及佣金净收入68792亿元，较上年同期增长41.31%。

中国建设银行在中国内地设有1,3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在英斯科、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33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。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011 年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的50 多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011 年 世界银行品牌500 强”中位列第10,较去年上升3 位；在美国《财富》世界500 强中排名第108 位，较去年上升8 位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理杂志颁发的 亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的 中国最佳银行”、 中国内地最佳银行”与 中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队，涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海各份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），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。

（三）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2011年12月31日，中国建设银行已托管224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。2011年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为2011年度 中国最佳托管银行”；并获和讯网2011年中国 卓越资产托管银行”奖。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）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。

（二）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。投资托管服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。

（三）内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、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、非复核人员分离的制度，授权、行权、行实行集中控制，业务印章按规保管、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，业务手册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

（一）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。

（二）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。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

1.直销机构

名称：长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市海淀区北大平庄路18号城建大厦A座20层

电话：010-82019799,82019795

传真：010-82255981,82255982

联系人：张莹、张晓丽

2.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：何奕

电话：010-67596093

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

②其他代销机构详见基金份额发售公告或其它增加代销机构的公告。

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：中国北京西城区太平桥大街17号

办公地址：中国北京西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：010-59378888

传真：010-66210938

三、出具法律意见书的律师事务所

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：汪建、庄贤

第六部分 分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则

一、分级运作期的界定

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

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

二、分级运作期内基金份额结构

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

三、场内基金份额的分拆规则

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

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

投资者可在场内申购和赎回长盛同辉深100等权重份额。投资者可选择将其场内申购的同辉份额按1:1的比例分拆成长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额，投资者亦可按1:1的配比将其持有的长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额中请合并为长盛同辉深100等权重份额，可以适当延迟计算或公告。

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

四、分级运作期内场内份额的申购、赎回及其他相关规则

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

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

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

①长盛同辉深100等权重A份额约定年收益率RA为：7.0%”。

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

③在基金份额首次拆算之前，长盛同辉深100等权重A份额在参考净值计算日应计收益的天数按分级运作期起始日至计算日的实际天数计算；基金份额首次拆算之后，长盛同辉深100等权重A份额在参考净值计算日应计收益的天数按最近一次基金份额拆算基准日（包括定期拆算和不定期拆算，详见本招募说明书 第十八部分、分级运作期内基金份额拆分、赎回、合并的规则”的次日至计算日的实际天数计算。

④分级运作期到期，对投资者将有到期的每一份长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额，按照基金合同所约定的参考净值计算规则分别计算长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额分别应计算的参考净值计算规则，并按照各自的份额参考净值转换为上市型开放式基金（LOF）份额。分级运作期到期长盛同辉深100等权重份额基金转换规则详见本招募说明书 第十九部分 分级运作期到期后基金份额的转换”。

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

五、T日长盛同辉深100等权重份额净值的计算

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

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

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

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

长盛同辉深100等权重A份额参考净值计算公式为：

$NAV_{A日}=1+RA\%\times d$；

$NAV_{B日}=2\times NAV_{合并日}-NAV_{A日}$

其中：

$NAV_{合并日}$为T日长盛同辉深100等权重份额净值；

$NAV_{A日}$为T日长盛同辉深100等权重A份额参考净值；

$NAV_{B日}$为T日长盛同辉深100等权重B份额参考净值；

R_A为长盛同辉深100等权重A份额约定年收益率；

N为计算长盛同辉深100等权重A份额收益率的除数，分级运作期内每年确定一次，①当分级运作期起始日≤T日≤第一次定期拆算基准日时，N为分级运作期起始日至第一次定期拆算基准日的实际天数值；②当第一次定期拆算基准日<T日≤第二次定期拆算基准日时，N为第一次定期拆算基准日次日至第二次定期拆算基准日的实际天数值；③当第二次定期拆算基准日<T日≤第三次定期拆算基准日时，N为第二次定期拆算基准日次日至第三次定期拆算基准日的实际天数值；④当第三次定期拆算基准日<T日≤第四次定期拆算基准日时，N为第三次定期拆算基准日次日至第四次定期拆算基准日的实际天数值；⑤当第四次定期拆算基准日<T日≤分级运作期到期日时，N为第四次定期拆算基准日次日至分级运作期到期日的实际天数值。关于定期拆算基准日的约定，详见本招募说明书 第十九部分 分级运作期到期后基金份额的拆算”；

t_N为长盛同辉深100等权重A份额在参考净值计算日应计收益的天数，t_{min} 份级运作期起始日至T日，最近一次拆算基准日次日至T日）。

长盛同辉深100等权重A份额与长盛同辉深100等权重B份额参考净值在当天收市后计算，并在下一日内公告。长盛同辉深100等权重份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

七、分级运作期内长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额参考净值的计算

①长盛同辉深100等权重A份额约定年收益率RA为：7.0%”。

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

③在基金份额首次拆算之前，长盛同辉深100等权重A份额在参考净值计算日应计收益的天数按分级运作期起始日至计算日的实际天数计算；基金份额首次拆算之后，长盛同辉深100等权重A份额在参考净值计算日应计收益的天数按最近一次基金份额拆算基准日（包括定期拆算和不定期拆算，详见本招募说明书 第十八部分、分级运作期内基金份额拆分、赎回、合并的规则”的次日至计算日的实际天数计算。

④分级运作期到期，对投资者将有到期的每一份长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额，按照基金合同所约定的参考净值计算规则分别计算长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额分别应计算的参考净值计算规则，并按照各自的份额参考净值转换为上市型开放式基金（LOF）份额。分级运作期到期长盛同辉深100等权重份额基金转换规则详见本招募说明书 第十九部分 分级运作期到期后基金份额的转换”。

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

八、T日长盛同辉深100等权重份额净值的计算

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

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

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

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

$NAV_{A日}=1+R_A\%\times d$；

$NAV_{B日}=2\times NAV_{合并日}-NAV_{A日}$

其中：

$NAV_{合并日}$为T日长盛同辉深100等权重份额净值；

$NAV_{A日}$为T日长盛同辉深100等权重A份额参考净值；

$NAV_{B日}$为T日长盛同辉深100等权重B份额参考净值；

R_A为长盛同辉深100等权重A份额约定年收益率；

N为计算长盛同辉深100等权重A份额收益率的除数，分级运作期内每年确定一次，①当分级运作期起始日≤T日≤第一次定期拆算基准日时，N为分级运作期起始日至第一次定期拆算基准日的实际天数值；②当第一次定期拆算基准日<T日≤第二次定期拆算基准日时，N为第一次定期拆算基准日次日至第二次定期拆算基准日的实际天数值；③当第二次定期拆算基准日<T日≤第三次定期拆算基准日时，N为第二次定期拆算基准日次日至第三次定期拆算基准日的实际天数值；④当第三次定期拆算基准日<T日≤第四次定期拆算基准日时，N为第三次定期拆算基准日次日至第四次定期拆算基准日的实际天数值；⑤当第四次定期拆算基准日<T日≤分级运作期到期日时，N为第四次定期拆算基准日次日至分级运作期到期日的实际天数值。关于定期拆算基准日的约定，详见本招募说明书 第十九部分 分级运作期到期后基金份额的拆算”；

t_N为长盛同辉深100等权重A份额在参考净值计算日应计收益的天数，t_{min} 份级运作期起始日至T日，最近一次拆算基准日次日至T日）。

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

九、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。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1.差错类型

本基金运作过程中，如果由于基