长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金之长盛中证全指证券公司份额、长盛中证全指证券公司A份额与长盛中证全指证券公司B份额上市交易公告书

基金管理人：长盛基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：上海证券交易所
上市时间：2015年8月24日
公告日期：2015年8月19日

一、重要声明与提示

长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之长盛中证全指证券公司份额、长盛中证全指证券公司A份额与长盛中证全指证券公司B份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号＜上市交易公告书的内容与格式＞》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国农业银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、上海证券交易所（以下简称“上交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2015年7月10日《中国证券报》和上海证券交易所网站（www.sse.cn）以及长盛基金管理有限公司网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“本合同”）和《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称：长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金
2、基金类型：股票型
3、基金运作方式：契约型开放式
4、本基金采取分级方式运作，本基金的基金份额包括长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额（即“长盛中证全指证券公司份额”）、长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“长盛中证全指证券公司A份额”），与长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金之积极收益类份额（即“长盛中证全指证券公司B份额”）。此三类基金份额分配不同的基金代码，所代表的基金资产合并运作。其中，长盛中证全指证券公司A份额、长盛中证全指证券公司B份额在存续期内始终保持1：1的份额配比不变。
5、本基金的存续期为不定期。
6、长盛中证全指证券公司份额的申购与赎回：投资者可通过场外或场内两种方式对长盛中证全指证券公司份额进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合上海证券交易所风险控制要求的上海证券交易所会员单位，具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。长盛中证全指证券公司A份额、长盛中证全指证券公司B份额将不接受投资者的申购与赎回。
7、长盛中证全指证券公司份额的跨系统转托管：通过场内、场外方式认购/申购本基金的长盛中证全指证券公司份额持有人可以通过认购/申购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。
8、份额配对转换：份额配对转换是指本基金的场内长盛中证全指证券公司份额与长盛中证全指证券公司A份额、长盛中证全指证券公司B份额之间的配对转换，包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的长盛中证全指证券公司份额的场内份额按1：1的比例申请转换成长盛中证全指证券公司A份额与长盛中证全指证券公司B份额的行为；合并指场内基金份额持有人将其持有的长盛中证全指证券公司A份额与长盛中证全指证券公司B份额按1：1的比例申请转换成场内长盛中证全指证券公司份额的行为。

本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并，场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。
9、定期份额折算

本基金存续期内，每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外）11月份的最后一个交易日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。在折算基准日，本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，长盛中证全指证券公司A份额和长盛中证全指证券公司B份额的份额配比保持1：1，长盛中证全指证券公司A份额参考净值调整为1.000元。长盛中证全指证券公司份额和长盛中证全指证券公司A份额按照基金合同规定的份额参考净值计算规则进行计算；对于长盛中证全指证券公司A份额参考净值超出1.000元部分，将折算为场内长盛中证全指证券公司份额。每两份长盛中证全指证券公司份额将按一份长盛中证全指证券公司A份额获得新增长盛中证全指证券公司份额的分配，场内长盛中证全指证券公司份额持有人折算后获得新增场内长盛中证全指证券公司份额，场外长盛中证全指证券公司份额持有人折算后获得新增场外长盛中证全指证券公司份额。

有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。
10、不定期份额折算

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况下进行不定期份额折算，即：当长盛中证全指证券公司份额的基金份额净值大于或等于1.500元时；当长盛中证全指证券公司B份额的基金份额参考净值达到或跌破0.250元时。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。
11、基金份额总额：截至2015年8月17日，本基金的基金份额总额为262,850,224.93份，其中，长盛中证全指证券公司份额199,433,452.93份，长盛中证全指证券公司A份额31,708,386.00份，长盛中证全指证券公司B份额31,708,386.00份。
12、长盛中证全指证券公司份额净值为：1.000元（截至2015年8月17日）
13、长盛中证全指证券公司A份额参考净值：1.001元（截至2015年8月17日）
14、长盛中证全指证券公司B份额参考净值：0.999元（截至2015年8月17日）
15、基金管理人：长盛基金管理有限公司
16、基金托管人：中国农业银行股份有限公司
17、基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况
1、本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕1127号
2、发售日期：2015年7月13日至2015年8月7日
3、发售价格：1.000元人民币
4、发售方式：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上海证券交易所场内和场外代销机构同时募集。
5、发售机构：
（1）场内代销机构
场内代销机构是指具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位（具体名单详见上海证券交易所网站）
（2）场外代销机构
场外将通过基金管理人的直销机构及基金代销机构办理公开发售。代销机构包括中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华龙证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、联讯证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、太平洋证券股份有限公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券股份有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、上海联泰资产管理有限公司、北京增财基金销售有限公司（排名不分先后）。
6、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
7、认购资金总额及入账情况：
本次募集期间净认购金额262,766,967.55元人民币，该资金已于2015年8月12日全额划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户；认购资金的银行利息共计83,257.38元，已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户。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262,850,224.93份。募集期间基金管理人的从业人员认购的基金份额共计0.00份，占基金总份额比例占0.00%，募集期间基金管理人用固有资金认购本基金的基金份额总额为0.00份，占本基金总份额的比例为0.00%。
8、基金备案情况
本基金已于2015年8月12日验资完毕，当日向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续，并于2015年8月13日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。
9、基金合同生效日：2015年8月13日。
10、基金合同生效日的基金总份额：262,850,224.93份。
（二）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书【2015】338号
2、上市交易日期：2015年8月24日
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
4、本次上市的基金份额简称和交易代码：
基础份额简称：券商分级；交易代码：502053
稳健收益类份额简称：券商A；交易代码：502054
积极收益类份额简称：券商B；交易代码：502055
5、基金场内申购、赎回简称：券商分级
6、场内申购、赎回代码：502053
投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更销售机构，并予以公告。
7、本次上市交易份额：
长盛中证全指证券公司份额：15,854,193.00份；长盛中证全指证券公司A份额：31,708,386.00份；长盛中证全指证券公司B份额：31,708,386.00份（截至2015年8月17日）
8、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布长盛中证全指证券公司份额净值和长盛中证全指证券公司A份额和长盛中证全指证券公司B份额的参考净值，并在基金上市交易时间进行净值揭示。
9、未上市交易份额的流通规定：
本基金包括场内份额与场外份额，本次上市的基金份额全部为场内份额。
未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统持有人上海证券账户下后，在上海证券交易所上市交易。跨系统转托管业务将于2015年8月24日开通。
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况
（一）持有人户数
截至2015年8月17日，本基金份额持有人户数为2766户，平均每户持有的基金份额为95,029.00份；其中，场内基础份额持有户数为209户，平均每户持有的基金份额为75,857.38份。券商A份额为209户，平均每户持有的基金份额为151,714.77份；券商B份额为209户，平均每户持有的基金份额为151,714.77份。
（二）持有人结构
截至2015年8月17日，场内机构投资者持有的本次上市交易的券商A份额21,686,852.00份，占比68.39%；场内个人投资者持有的本次上市交易的场内券商A份额10,021,534.00份，占比31.61%。
截至2015年8月17日，场内机构投资者持有的本次上市交易的券商B份额21,686,852.00份，占比68.39%；场内个人投资者持有的本次上市交易的场内券商B份额10,021,534.00份，占比31.61%。
（三）前十名基金份额持有人的情况
截至2015年8月17日，基础份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人姓名/名称（全称）	持有场内基础份额（份）	占场内基础份额比例
1	鹏华资产－工商银行－以太十号资产管理计划	8,001,960.00	50.47%
2	方正证券股份有限公司	1,399,926.00	8.83%
3	光大证券股份有限公司	1,399,926.00	8.83%
4	娄金霞	999,845.00	6.31%
5	李菁	398,839.00	2.52%
6	顾海英	121,991.00	0.77%
7	唐俊娟	118,899.00	0.75%
8	徐逊伟	79,265.00	0.50%
9	许世兰	79,261.00	0.50%
10	刘德安	59,449.00	0.37%

截至2015年8月17日，券商A份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人姓名/名称（全称）	持有券商A份额（份）	占券商A份额比例
1	鹏华资产－工商银行－以太十号资产管理计划	16,003,920.00	50.47%
2	方正证券股份有限公司	2,799,852.00	8.83%
3	光大证券股份有限公司	2,799,852.00	8.83%
4	娄金霞	1,999,690.00	6.31%
5	李菁	797,679.00	2.52%
6	顾海英	243,982.00	0.77%
7	唐俊娟	237,796.00	0.75%
8	徐逊伟	158,531.00	0.50%
9	许世兰	158,524.00	0.50%
10	刘德安	118,898.00	0.37%

截至2015年8月17日，券商B份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人姓名/名称（全称）	持有券商B份额（份）	占券商B份额比例
1	鹏华资产－工商银行－以太十号资产管理计划	16,003,920.00	50.47%
2	方正证券股份有限公司	2,799,852.00	8.83%
3	光大证券股份有限公司	2,799,852.00	8.83%
4	娄金霞	1,999,690.00	6.31%
5	李菁	797,679.00	2.52%
6	顾海英	243,982.00	0.77%
7	唐俊娟	237,796.00	0.75%
8	徐逊伟	158,531.00	0.50%
9	许世兰	158,524.00	0.50%
10	刘德安	118,898.00	0.37%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、基本信息
名称：长盛基金管理有限公司
住所：深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼10D
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：高新
电话：（010）82019988
传真：（010）82255988
联系人：叶金松
2、经营概况
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18900万元。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2015年8月17日，基金管理人共管理四十一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。
公司目前下设二十三个部门、分公司及营销中心和两个全资子公司，分别是：权益投资部、研究部、交易部、国际业务部、社保业务管理部、固定收益部、专户理财部、产品开发部、市场销售总部、电子商务部、北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司、华南营销中心、业务运营部、信息技术部、财务会计部、人力资源部、总经理办公室、监察稽核部、风险管理部以及长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。
权益投资部主要负责境内公募基金的投资组合管理；研究部主要负责行业与上市公司研究，投资备选库建立、维护与更新；交易部主要负责完成基金经理、组合经理及投资经理下达的交易指令；国际业务部主要负责QDII产品的投资运作管理及QFII投资顾问服务；社保业务管理部主要负责公司社保组合的投资管理工作；固定收益部主要负责公司固定收益产品的投资管理与研究工作；专户理财部主要负责特定资产管理业务的客户营销和服务、产品开发设计和投资管理工作；产品开发部主要负责基金新产品的开发报批及产品维护工作；市场销售总部主要负责基金销售策略及基金销售计划制订、客户服务、销售渠道管理等；电子商务部主要负责制定及实施公司品牌宣传及市场推广计划；北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司和华南营销中心主要负责所辖区域的营销策划与基金销售工作；业务运营部主要负责基金核算与估值、开放式基金注册与登记，以及资金清算等工作；信息技术部主要负责公司信息系统的日常运行与维护，以及相关系统的规划与开发等；财务会计部主要负责公司财务管理工作；人力资源部主要负责公司战略及人力资源管理；总经理办公室主要负责公司行政事务的管理；监察稽核部主要负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；风险管理部主要负责对投资风险的管理与控制。长盛基金（香港）有限公司可开展香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四类（就证券提供意见）和第九类（提供资产管理）牌照所允许的业务；长盛创富资产管理有限公司的业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。
截至2015年7月28日，公司共有员工156人，其中具有硕士及以上学历的员工占62%，具有本科学历的员工占35%。研究员和基金经理全部拥有硕士及以上学历，公司员工平均年龄为35岁，平均金融从业年限9年。公司主要业务部门人员全部具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。
3、本基金基金经理
冯雨生先生，1983年11月出生。北京大学金融学硕士，CFA（特许金融分析师）。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等职务。现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理，长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级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，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理。
（二）基金托管人
1、基本情况
名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座
法定代表人：刘士余
成立日期：2009年1月15日
批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66060069
传真：010-68121816
联系人：林葛
2、基金托管部门及主要人员情况
中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。
3、证券投资基金托管情况
截止2015年3月31日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共254只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（三）基金验资机构
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17 层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17 层01-12室
执行事务合伙人：吴港平
电话：（010）58153000
传真：（010）85188298
经办注册会计师：徐艳、贺耀
联系人：贺耀

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。
（二）基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
（三）基金资产负债表
本基金截至2015年8月17日的资产负债表如下：
单位：元

资　产	期末余额
资 产：	
银行存款	262,766,967.55
结算备付金	－
存出保证金	－
交易性金融资产	－
其中：股票投资	－
债券投资	－
资产支持证券投资	－
基金投资	－
衍生金融资产	－
买入返售金融资产	－
应收证券清算款	－
应收利息	47,298.04
应收股利	－
应收申购款	－
其他资产	83,257.38
资产合计：	262,897,522.97
负债和所有者权益	期末余额
负债：	
短期借款	－
交易性金融负债	－
衍生金融负债	－
卖出回购金融资产款	－
应付证券清算款	－
应付赎回款	－
应付管理人报酬	28,805.68
应付托管费	6,337.26
应付销售服务费	－
应付交易费用	－
应付税费	－
应付利息	－
应付利润	－
其他负债	6,072.57
负债合计	41,215.51
所有者权益：	
实收基金	262,850,224.93
未分配利润	6,082.53
所有者权益合计	262,856,307.46
负债与持有人权益总计：	262,897,522.97

八、基金投资组合

截至2015年8月17日，本基金的投资组合如下：
（一）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	－	－
	其中：股票	－	－
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	银行存款和结算备付金合计	262,766,967.55	99.95
7	其他各项资产	130,555.42	0.05
8	合计	262,897,522.97	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
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
本基金本报告期末未持有股票。
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股票。
（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
（六）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。
（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无股指期货投资。
2、本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期内未投资股指期货。
（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1、本期国债期货投资政策
本基金本报告期内未投资国债期货。
2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货投资。
3、本期国债期货投资评价
本基金本报告期内未投资国债期货。
（十一）投资组合报告附注
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。
本基金本报告期末未进行证券投资。
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。
本基金本报告期末未持有股票。
3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	47,298.04
5	应收申购款	－
6	其他应收款	83,257.38
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	130,555.42

4、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可转换债券。
5、报告期末股票中存在流通受限情况的说明
（1）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
本基金本报告期末未持有股票。
（2）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
本基金本报告期末未持有股票。
6、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。

九、重大事件揭示

无。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）采取措施防止基金的申购费率、调低赎回费率，或在不损害现有基金份额持有人利益的情况下，在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率，或在不损害现有基金份额持有人利益的情况下，变更收费方式、调整基金份额类别的设置；
（4）在法律法规和基金合同规定的范围内，在不提高现有基金份额持有人适用的费率的前提下，设立新的基金份额级别，增加新的收费方式；
（5）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
（6）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
（7）基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；
（8）在不损害现有基金份额持有人利益的情况下，在法律法规和《基金合同》规定的范围内，基金推出新业务或服务；
（9）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。
（二）会议召集人及召集方式
1、除法律法规规定或《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；
2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起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，应当由基金托管人自行召集。
4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，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%以上（含10%）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。
5、代表基金份额10%以上（含10%）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，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。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。
6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式
1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：
（1）会议召开的时间、地点和会议形式；
（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
（4）授权委托证明的内容要求（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；
（5）会务常设联系人姓名及联系电话；
（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
（7）召集人需要通知的其他事项。
2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。
3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对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，不影响表决意见的计票效力。
（四）基金份额持有人出席会议的方式
基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管部门允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。
1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议：
（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；
（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额有效的基金份额不少于本基金在权益登记日各自基金总份额的50%（含50%）。
2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。
在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：
（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；
（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；
（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额的基金份额不小于在权益登记日各自基金总份额的50%（含50%）；
（4）上述第（3）项中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，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；
（5）会议通知公布前报中国证监会备案。
3、在不与法律法规冲突的前提下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中说明。
4、重新召集基金份额持有人大会的条件。基金份额持有人大会应当有代表长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额各自二分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。
参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前述比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额各自三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。
（五）议事内容与程序
议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。
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的决议。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。
（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。
三、基金收益分配原则、执行方式
（一）基金利润的构成
基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。
（二）基金可供分配利润
基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。
（三）基金收益分配原则
在长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额的运作期内，本基金（包括长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额）不进行收益分配。
经基金份额持有人大会决议通过，如果终止长盛中证证券公司A份额与长盛中证证券公司B份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。
四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例
（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、基金的标的指数使用许可费；
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券、期货交易费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、基金的开户费用；
10、基金上市费用及年费；
11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
（二）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
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.0%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.22%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.22%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。
3、标的指数使用许可费
本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率进行计提，且收取下限为每季人民币5万元（即不足5万元部分按照5万元收取），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。
计算方法如下：
H＝E×0.02%÷当年天数
H