（上接A26版）

[illegible]

不定期份额折算后长盛中证证券公司份额的份额数

=不定期份额折算前持长盛中证证券公司份额持有人不定期折算后持有的长盛中证证券公司份额的份额数+长盛中证证券公司A份额持有人不定期折算后持有的场内长盛中证证券公司份额的份额数

场内的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份额折算后的份额数取整计算（最小单位为1份），不足1份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为1份，直至完成全部折算。

（三）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据上海证券交易所、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中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额与长盛中证证券公司B份额的上市交易和长盛中证证券公司份额的申购或赎回等相关业务，具体见基金管理人届时发布的相关公告。

（四）基金份额折算结果的公告

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

（五）特殊情形的处理

1、基金合同生效不满六个月，基金管理人可以不进行定期份额折算；

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

（六）基金管理人、上海证券交易所、基金注册登记机构有权调整上述规则，本基金基金合同将相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

十八、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额的终止运作

（一）经基金份额持有人大会决议通过，长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额可申请终止运作。

（二）长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额终止运作后的份额折算

长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额将全部转换成场内长盛中证证券公司份额。

1.份额转换基准日

长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额终止运作日（以该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

2.份额转换方式

在份额转换基准日日终，以长盛中证证券公司份额的基金份额净值为基准，长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额按照各自的基金份额参考净值转换成场内长盛中证证券公司份额。长盛中证证券公司A份额（或者长盛中证证券公司B份额）基金份额持有人持有的转换后场内长盛中证证券公司份额取整计算（最小单位为1份），余额计入基金财产。

份额转换计算公式：

长盛中证证券公司A份额（或者长盛中证证券公司B份额）的转换比例＝份额转换基准日长盛中证证券公司A份额（或者长盛中证证券公司B份额）的基金份额参考净值/份额转换基准日长盛中证证券公司份额的基金份额净值

长盛中证证券公司A份额（或者长盛中证证券公司B份额）基金份额持有人持有的转换后场内长盛中证证券公司份额＝长盛中证证券公司A份额（或者长盛中证证券公司B份额）的份额数×长盛中证证券公司A份额（或者长盛中证证券公司B份额）的转换比例

3.份额转换后的基金运作

长盛中证证券公司A份额与长盛中证证券公司B份额全部转换为场内长盛中证证券公司份额后，本基金接受场外与场内申购和赎回。

4.份额转换的公告

长盛中证证券公司A份额与长盛中证证券公司B份额进行份额转换结束后，基金管理人应在至少一家指定媒介和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

十九、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为每日应计提的标的指数使用费

E为前一日的基金资产净值

指数使用费每日计算，逐日累计，每季支付一次，由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年1月、4月、7月、10月的前十个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的指数使用费。基金管理人可根据指数许可使用合同和基金份额持有人的利益，对上述计提方式进行合理变更并公告。

上述“一、基金费用的种类中第4－11项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

在法律、法规和基金合同允许的条件下，基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况协商调整、调低基金管理费和基金托管费，调低基金管理费和基金托管费等相关费率或在不提高费率水平的情况下变更收费方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率或收费模式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（五）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

二十、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金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会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自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、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定的方式确认。

（二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

二十一、基金的信息披露

（一）本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。

（二）信息披露义务人

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。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，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应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

（三）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销售机构；

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。

（四）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。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金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网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日（若遇法定节假日指定报刊休刊，则顺延至法定节假日后首个出报日。下同）在指定报刊和网站上登载《基金合同》生效公告。

4、《上市交易公告书》

基金管理人应当在本基金的基金份额上市交易3个工作日前，将《上市交易公告书》登载在指定媒介上。

5、基金资产净值、基金份额净值（或基金份额参考净值）公告

《基金合同》生效后，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和各级基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）。

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，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的各级基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）。

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和各级基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）。基金管理人应当在前款规定的最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、各级基金份额的基金份额净值（或基金份额参考净值）登载在指定媒介和网站上。

6、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

7、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

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媒介上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

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媒介上。

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媒介上。

《基金合同》生效不足2个月的，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。

基金定期报告在公开披露的第2个工作日，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。报备应当采用电子文本或书面报告方式。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

8、临时报告

基金发生重大事件，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的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指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，包括：

（1）基金份额持有人大会的召开；

（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百分之五十；

（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百分之三十；

（11）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或者仲裁；

（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、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（17）基金份额净值（或基金份额参考净值）估值错误达基金份额净值（或基金份额参考净值）百分之零点五；

（18）基金改聘会计师事务所；

（19）基金变更、增加、减少基金代销机构；

（20）基金更换基金注册登记机构；

（21）基金开始办理申购、赎回；

（22）基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

（23）基金发生巨额赎回并延期办理；

（24）基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

（25）基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

（26）本基金开始办理或暂停接受配对转换申请；

（27）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；

（28）本基金实施基金份额折算；

（29）本基金长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额暂停、恢复、终止上市交易；

（30）长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额的终止运作；

（31）中国证监会规定的其他事项。

9、澄清

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。

10、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。

11、投资股指期货相关公告

基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

12、投资资产支持证券相关公告

在基金年报及半年报中披露基金管理人持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细；在基金季度报告中披露基金管理人持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前十名资产支持证券明细。

13、中国证监会规定的其他信息

（六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒介中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

（七）信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

（八）暂停或延迟信息披露的情形

1、基金投资所涉及的证券期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他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、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

二十二、风险揭示

（一）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，导致基金收益的不确定性。市场风险主要包括：政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

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、国有股减持与流通政策等）和证券市场监管政策发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。股市是国民经济的晴雨表。因此，宏观经济运行的周期性波动将会通过证券市场反映出来，对证券市场的收益水平产生影响，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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于债券和债券回购，其收益水平会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，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。基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而使基金的实际收益下降，影响基金资产的保值增值。

（二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

（三）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人的申购和赎回。如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。

（四）信用风险

基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，都可能导致基金资产损失和收益变化，从而产生风险。

（五）本基金的特定风险

1、长盛中证证券公司A份额的本金及约定收益的风险

基金管理人不承诺也不保证长盛中证证券公司A份额的基金份额持有人获得约定收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，长盛中证证券公司A份额的基金份额持有人的收益可能低于其约定收益，也存在遭受本金损失的风险。

2、指数投资风险

本基金为股票指数型基金，标的指数为中证金指证券公司指数，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

标的指数成份股的价格可能由于政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动。当中证金指证券公司指数下跌时，本基金面临基金净值与中证金指证券公司指数同步下跌的风险。

（2）投资替代风险

因持续情况（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）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数为主题指数，并不代表整个股票市场，标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率存在偏离。

（4）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资过程中存在流动性风险、交易成本和中证金指证券公司指数成份股调整等情况导致基金投资组合回报与标的指数回报存在跟踪偏离风险，主要影响因素可能包括：

1）基金运作过程中发生的费用，包括交易成本、市场中击成本、管理费和托管费等；

2）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；

3）投资人申购、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；

4）在指数化投资过程中，基金管理人对指数基金的管理能力，如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度；本基金将进行被动型的股票投资并通过多项风险控制方式降低跟踪风险。

（5）标的指数变更风险

根据基金合同的规定，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的风险收益特征可能发生变化，投资人还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

3、分级基金特有的运作风险

（1）上市交易风险

本基金在基金合同生效后，长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额在上海证券交易所上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额与长盛中证证券公司B份额产生流动性风险。

（2）杠杆机制风险

本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。长盛中证证券公司A份额的预期风险和预期收益较低；长盛中证证券公司B份额采用了杠杆式的结构，预期风险和预期收益有所放大，将高于普通的股票型基金。

由于长盛中证证券公司B份额内含杠杆机制的设计，其份额参考值的变动幅度将大于长盛中证证券公司份额净值和长盛中证证券公司A份额参考净值的变动幅度，即长盛中证证券公司B份额参考净值变动的波动性要高于其他两类基金份额。并且，随着长盛中证证券公司份额的净值变动，长盛中证证券公司B份额的实际杠杆大小也在发生变化，从而影响着长盛中证证券公司B份额参考净值变动的波动性。

（3）折/溢价交易风险

长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额与长盛中证证券公司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。本基金份额配对转换机制有助于降低折/溢价交易风险，但长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额仍有可能处于折/溢价交易状态。另外，由于份额配对转换机制的存在，长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额的交易价格可能会相互影响。

（4）基金份额风险收益特征变化风险

根据本基金的份额折算的设计，本基金将进行定期份额折算和不定期份额折算，在实施基金份额折算后，长盛中证证券公司A份额持有人或长盛中证证券公司B份额持有人将会获得一定比例的场内长盛中证证券公司份额，因此其所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

在定期份额折算的基金份额折算基准日，本基金将对长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司份额进行定期份额折算，将长盛中证证券公司A份额的基金份额参考净值大于1.000元的部分折算成场内长盛中证证券公司份额分配给长盛中证证券公司A份额持有人，因此，原长盛中证证券公司A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。

在长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额参考净值大于或等于1.500元时以及长盛中证证券公司B份额的基金份额参考净值小于或等于0.25元时，本基金将进行不定期份额折算。原长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额持有人将会获得一定比例的场内长盛中证证券公司份额，因此原长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司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。

当长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额终止运作后，长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额将全部折算成场内长盛中证证券公司份额，因此基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征出现变化的风险。

（5）份额折算风险

场外份额进行份额折算时计算结果采用截位法保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位（最小单位为1份），不足1份的零碎份额，按照投资者零碎份额数量大小顺序排列，零碎份额数量相同的，则随机排列。按照排列顺序，依次均登记为1份，直至完成全部折算。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

（6）份额配对转换业务中存在的风险

基金合同生效后，在长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司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中证证券公司份额与长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司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长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司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，投资人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。

在定期份额折算的基金份额折算基准日，基金管理人将根据基金合同的约定对本基金的长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司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，投资人可通过卖出或赎回折算后新增份额的方式获得投资回报，但是，投资人通过卖出或赎回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，投资人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。

（六）其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如基金在交易时所采用的电脑系统可能因突发性事件或不可抗原因出现故障，由此给基金投资带来风险；

2、因基金业务快速发展，在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面的不完善产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险，如基金经理违反职业操守的道德风险，以及因内幕交易、欺诈等行为产生的违规风险；

4、人才流失风险，公司主要业务人员的离职如基金经理的离职等可能会在一定程度上影响工作的连续性，并可能对基金运作产生影响；

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财产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

二十三、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、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为6个月。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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小组优先从基金财产中支付。

（五）基金财产清算剩余资产的分配

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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）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。

二十四、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人的权利、义务

（一）基金管理人

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

（12）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；

（13）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、融券及转融通业务；

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

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）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、转换和非交易过户的业务规则；

（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基法法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，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、谨慎勤勉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基金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《基法法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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）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，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度、半年度和年度基金报告；

（11）　　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；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

（13）按《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基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）依据《基法法》、《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；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

（17）确保需要向投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）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；

（19）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；

（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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）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实施其他法律行为；

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金托管人

本基金的基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

（2）依《基金合同》约定获