（上接D6版）

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辉深100等权重B份额、长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额的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，则在公证机关监督下形成的决议有效。

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。

（七）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份额持有人独立进行表决，且长盛同辉深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份额的基金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。

（八）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。

（九）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。

（十）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。

第三节 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。分级运作期到期日，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份额申请合并为长盛同辉深100等权重份额后赎回。

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份额合并为长盛同辉深100等权重份额后赎回。

（四）分级运作期内长盛同辉深100等权重A份额参考净值计算规则

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予长盛同辉深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予长盛同辉深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份额各自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份额的累计约定日应得收益，之后的剩余净资产计为长盛同辉深100等权重B份额的净资产。长盛同辉深100等权重A份额累计约定日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，详见本基金合同“二十二、分级运作期内基金份额的拆算”）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份额分级运作期末参考净值，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，长盛同辉深100等权重份额基金转换规则详见本基金合同“二十三、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净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。

（5）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份额的余额数量之和。

长盛同辉深100等权重份额的计算，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）分级运作期基金份额的计算

T日长盛同辉深100等权重A份额=T日本基金的基金资产净值/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份额的余额数量之和。

长盛同辉深100等权重A份额参考净值计算日应计收益的天数，t=min｛分级运作期起始日至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。

第四节 基金份额的上市与交易

（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，长盛同辉深100等权重A份额与长盛同辉深100等权重B份额将在深圳证券交易所上市。

本基金分级运作期到期后，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）上市交易的地点

本基金上市交易地点为深圳证券交易所。

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辉深100等权重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份额方可上市交易。

本基金分级运作期到期后，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，转换后的基金份额可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

分级运作期起始后三个月内，长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额开始在深圳证券交易所上市交易。

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

1.本基金分级运作期内，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

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，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参考净值。

（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，基金合同相应于以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

第五节 基金的收益与分配

（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）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息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，每次每份基金份额收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的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，场外基金份额持有人可以事先未做出选择，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，基金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。

第六节 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.基金财产按划支付的银行费用；

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.基金的开户费用、账户维护费用；

9.在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

10.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×年管理费率÷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5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×年托管费率÷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5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、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。

第七节 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，以实现对深证100等权重指数的有效跟踪。

（二）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。

（三）标的指数

本基金的标的指数是深证100等权重指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、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诸多因素选择确定新的标的指数。

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。

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。

1.资产配置策略

本基金管理人主要按照深证100等权重指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据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。

3.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。

（五）业绩比较基准

本基金业绩比较基准：95%x深证100等权重指数收益率+5%x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。

（六）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成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，不得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）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。

如果法律法规对本基金合同约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。

第八节 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

本基金合同生效后，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。

第九节 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”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.基金份额定期折算次数

四次。

4.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]

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