长盛中证 100 指数证券投资基金招募说明书

（上接 B10 版）

基金合同生效后，基金管理人应当在每六个月结束之日起四十五日内，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。

（二）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。

（三）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

（四）基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

（五）基金资产净值、基金份额净值

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基金份额净值。

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、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在半年度和年度最后一个市场交易日的次日，将前日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（六）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，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

（七）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九十日内，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报刊上。

基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，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报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足两个月的，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。

《基金法》及其他有关法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

（八）临时报告

基金发生重大事件，即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，有关信息披露义务人应当在两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中国证监会派出机构备案。重大事件包括：

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、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

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、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

18、基金改聘会计师事务所；

19、变更基金份额发售机构；

20、基金更换注册登记机构；

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支付；

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、中国证监会规定的其他事项。

（九）基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前三十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。

（十）澄清公告

在基金合同期限内，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、基金上市交易的证券交易所。

（十一）中国证监会规定的其他信息。

（十二）本基金在条件成熟的情况下，为了方便投资者交易本基金，可以增加信息披露的范围。

（十三）信息披露文件的存放与查阅

本基金《招募说明书》（包括更新的招募说明书）、基金合同、年度报告、半年度报告、季度报告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金代销机构的办公场所和营业场所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人的住所和基金上市交易的证券交易所，供公众查阅、复制。

投资人也可直接在基金管理人的网站（http://www.csfunds.com.cn）或者上海证券交易所网站（http://www.sse.com.cn）查阅信息披露文件。

投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十八、风险揭示

本基金主要面临的风险有：与基准指数偏离的跟踪误差风险，流动性风险，市场风险（系统风险），操作风险、技术风险及合规性风险等。

（一）跟踪误差风险

跟踪误差反映的是投资组合与跟踪基准之间的偏离程度，是控制投资组合与基准之间相对风险的重要指标，跟踪误差的大小是衡量指数化投资成功与否的关键。本基金的投资目标是将年跟踪误差控制在4%以内。以下原因可能会影响到基金的跟踪误差扩大，与业绩基准产生偏离：

1、基准指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；

2、基准指数成份股的调整；

3、基金买卖股票时产生的交易成本和交易冲击；

4、申购、赎回因素带来的跟踪误差；

5、新股发行及新股认购带来的跟踪误差；

6、基金现金资产的拖累；

7、基金的管理费和托管费带来的跟踪误差；

8、指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的偏差；

9、由于缺少衍生金融工具，基金建仓期间无法实现对指数的有效跟踪所带来的偏差；

10、其他因素带来的偏差。

（二）流动性风险

1、成份股的流动性风险

虽然本基金的业绩基准指数中成份股的流动性相对来说都比较高，但仍不排除可能面临交易量不足所引起的流动性风险，进而影响基金管理人把申购资金及时转化为投资组合和将赎回所需的现金直接变现，以及影响到因基准指数成份股的调整而带来的基金投资组合的调整。

2、本基金在二级市场的流动性风险

本基金作为上市开放式基金，可以在二级市场挂牌交易，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

（三）市场风险

市场风险是指证券市场价格因受各种因素（如政策因素、经济周期波动、利率因素、投资者心理等）的影响而引起的波动，对本基金资产产生潜在风险。本基金作为指数基金，基金收益率的变动与基准指数的变动高度一致，当基准指数因市场原因出现大幅下跌时，会造成基金净值相应下跌的风险。

（四）基金交易价格与份额净值发生偏离的风险

本基金在证券交易所的交易价格可能不同于份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，虽然基金的份额净值反映基金投资组合的资产状况，但是交易价格受到很多因素的影响，比如中国的经济情况、投资人对于中国股市的信心以及本基金的供需情况等。

（五）操作风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等风险。

（六）技术系统风险

在基金的申购赎回过程中、各种交易行为或者后台运作中，可能因为软件系统和硬件系统故障而影响申购、赎回和交易的正常进行，从而导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、托管银行、注册登记机构、证券交易所等。

（七）网络安全风险

指数据在传递过程中，因通讯故障造成的数据丢失，或因非法人侵等网络安全问题引起的数据被篡改等，从而造成不能正常交易、不能正常交收的风险。

（八）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

（九）不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

（十）投资者认知风险

可能存在由于投资者对本产品缺乏足够的认知和了解而造成的投资偏离预期的风险。

（十一）其他风险

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

十九、基金的终止与基金财产的清算

（一）基金的终止

1、出现下列情况之一的，本基金经中国证监会批准后终止：

（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，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

2、本基金终止后，须按法律法规和基金合同对基金进行清算。清算报告报中国证监会备案并予以公告后本基金终止。

（二）基金财产的清算

1、基金财产清算小组

（1）基金管理人应当自基金合同终止之日起 30 个工作日内组织成立基金财产清算小组。基金财产清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算小组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

2、基金财产的清算程序

（1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算小组对基金财产进行清理和确认；

（3）对基金财产进行评估和变现；

（4）基金财产清算小组做出清算报告；

（5）会计师事务所对清算报告进行审计；

（6）律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（7）将基金财产清算报告报中国证监会备案；

（8）公布基金财产清算公告；

（9）对基金财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金资产中支付。

4、基金财产清算后剩余资产的分配

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后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；

清算报告报中国证监会备案后 3 个工作日内由基金财产清算小组公告；

清算过程中的有关重大事项须及时公告；

基金清算结果由基金财产清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日公告。

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按照国家有关规定保存 15 年以上。

二十、基金合同的内容摘要

（一）前言

本基金合同是规定本基金合同当事人之间权利义务的基本法律文件。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同所有条款和条件的承认和接受。本基金合同的当事人按照《基金法》、《运作办法》和本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

本基金由基金管理人按照《基金法》、《运作办法》和本基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会证监基金字[2006]172 号文核准募集。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于基金没有风险。

基金管理人保证依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。同时，基金的过往业绩并不预示其未来表现。

（二）基金合同当事人的权利、义务

1、基金管理人的权利

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）自本基金合同生效之日起，依法并依照基金合同的规定独立运用基金财产；

（3）依据有关法律规定及本基金合同决定基金收益分配方案；

（4）根据基金合同的规定，获取基金管理费及其他约定和法定的收入；

（5）在符合有关法律法规的前提下，并经中国证监会批准后，制订和调整开放式基金业务规则，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

（6）销售基金份额，获取认（申）购费；

（7）选择和更换代销机构，并对其销售代理行为进行必要的监督；

（8）依照有关法律法规，代表基金行使因运营基金财产而产生的股权、债权及其他权利；

（9）担任注册登记人或选择和更换注册登记代理机构，并对其注册登记代理行为进行必要的监督；

（10）基金合同规定的情形出现时，决定暂停或拒绝受理基金份额的申购、暂停受理基金份额的赎回申请或延缓支付赎回款项；

（11）核查基金托管人，如认为基金托管人违反基金合同或有关法律法规的规定，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；

（12）以自身名义，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；

（13）召集基金份额持有人大会；

（14）在更换基金托管人时，提名新任基金托管人；

（15）法律法规及基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理基金备案手续；

（2）遵守基金合同；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责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）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回及其他业务或委托其他机构代理这些业务；

（6）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册登记工作或委托其他机构代理该项业务；

（7）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；

（8）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以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；

（9）依法接受基金托管人的监督；

（10）按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值；

（11）采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

（12）严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、和本基金合同及其他有关规定，受理并办理申购、赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（13）严格按照《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》和本基金合同及其他有关规定履行信息披露及报告义务；

（14）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

（15）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收益；

（16）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（17）依据《基金法》、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；

（18）编制基金的财务会计报告；保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

（19）确保向基金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或招募说明书公告的时间和方式查阅与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

（20）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；

（21）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（22）因违反基金合同导致基金财产损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（23）因估值错误导致基金份额持有人的损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（24）基金托管人因违反基金合同造成基金财产损失时，应代表基金向基金托管人追偿；

（25）为基金聘请会计师和律师；

（26）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（27）以基金管理人名义代表基金份额持有人利益行使诉讼权及其他权力；

（28）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（29）法律法规及基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利

（1）依法持有并保管基金财产；

（2）获取基金托管费；

（3）监督和核查本基金的投资运作；

（4）监督和核查基金管理人，如认为基金管理人违反基金合同或有关法律法规的规定，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；

（5）在更换基金管理人时，提名新任基金管理人；

（6）提议召开基金份额持有人大会；

（7）法律法规及基金合同规定的其他权利。

4、基金托管人的义务

（1）遵守基金合同；

（2）以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

（3）设有专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（4）除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，委托其他人托管基金财产；

（5）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及基金份额净值；

（6）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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（7）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（8）设立证券账户、银行存款账户等基金财产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；

（9）保守基金商业秘密，除《基金法》、《运作办法》、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予以保密，不得向他人泄露；

（10）按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国银监会；

（11）对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（12）按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录、基金份额持有人名册等 15 年以上；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定支付基金份额持有人的收益和赎回款项；

（15）参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（16）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

（17）因违反基金合同导致基金财产的损失，承担赔偿责任，其违反基金合同责任不因其退任而免除；

（18）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

（19）不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

（20）监督基金管理人的投资运作；

（21）按照规定召集基金份额持有人大会或配合召开基金份额持有人大会；

（22）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（23）建立并保存基金份额持有人名册；

（24）法律法规及基金合同规定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照法律法规和基金合同规定的要求召开基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为要求赔偿或依法提起诉讼；

（9）获取基金业务及财务状况的公开资料；

（10）法律法规及基金合同规定的其他权利。

6、每份基金份额具有同等的合法权益。

7、基金份额持有人的义务

（1）遵守基金合同及相关业务规则；

（2）缴纳基金认购、申购、赎回等事宜涉及的款项，及法律法规和基金合同所规定的费用；

（3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金、基金份额持有人及其他基金当事人合法权益的活动；

（5）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（6）返还在基金交易中因任何原因，从基金管理人、基金托管人及基金管理人代理人处获得不当得利；

（7）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（三）基金份额持有人大会

1、召开原则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

基金份额持有人大会决议须经基金份额持有人大会审议通过。上述通过事项如无需监管部门批准，则即刻生效；需监管部门批准的，在获得相关批准后生效。

2、召开事由

在本基金需要决定下列事项之一时，应召开基金份额持有人大会：

（1）修改基金合同。但本基金合同另有规定或根据法律法规变更做出相应更改的除外；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）决定终止基金合同；

（5）与其他基金合并；

（6）持有本基金百分之十或以上基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算）提议召开基金份额持有人大会；

（7）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（8）转换基金运作方式；

（9）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（10）变更基金类别；

（11）变更基金的投资目标、投资范围；

（12）变更基金份额持有人大会程序；

（13）对基金当事人权利义务产生重大影响事项；

（14）法律、法规或中国证监会规定的其他情形。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

（1）因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；

（2）调低基金管理费、基金托管费；

（3）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

（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的变化；

（5）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；

（6）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。

3、召集人和召集方式

（1）在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的开会时间、地点及权益登记日由基金管理人选择确定；

（2）在更换基金管理人或基金管理人未行使召集权的情况下，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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

（4）在基金管理人和基金托管人均未行使召集权的情况下，单独或合计持有权益登记日百分之十或以上份额的基金份额持有人有权自行召集；若就同一事项出现若干个基金份额持有人提案，则由提出该等提案的基金份额持有人共同推选出代表召集基金份额持有人大会。

（5）代表基金份额百分之十或以上的基金份额持有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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十或以上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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

（6）基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以按照《基金法》第七十二条第二款的规定自行召集基金份额持有人大会。

基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

（7）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。

4、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应在会议召开前至少三十日，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和方式；

（2）会议拟审议的主要事项；

（3）会议的议事程序；

（4）会议的表决方式；

（5）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

（6）代理投票授权委托书送达时间和地点；

（7）会务常设联系人姓名、电话；

（8）召集人需要通知的其他事项。

若采取通讯等方式开会并进行表决，会议通知中还应说明本次基金份额持有人大会所采取的具体方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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书面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书面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任何基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

5、召开方式

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开，也可以采取通讯等方式召开。会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人的更换、提前终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表百分之五十以上（含百分之五十）基金份额的持有人参加方可召开，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不应发生变化。

（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书委派代表出席，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。

亲自出席会议者应持有基金份额的凭证，受托出席会议者应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书应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

（2）通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

①召集人应按本基金合同规定公告会议通知；

②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；

③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，提交的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书应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

6、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

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。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日前三十日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有三十日的间隔期。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额百分之十或以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

①关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律、法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

②程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额百分之十以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月，法律法规另有规定除外。

（2）议事程序

①现场开会

大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额百分之五十以上（不含百分之五十）多数选举产生一名基金份额持有人或其代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（八）款规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。

②通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前三十日公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

7、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

（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，须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上（不含百分之五十）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，须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（不含三分之二）通过方可做出。更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金合同、转换基金运作方式等重大事项必须以特别决议通过方为有效，但法律法规、本基金合同另有约定的除外。

（3）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（4）采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

（5）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。

8、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，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中选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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人；

②计票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果；

③如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议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，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

（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督员在基金托管人授权代表（如基金托管人为召集人，则为基金管理人的授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如果基金管理人或基金托管人经通知拒不派代表监督计票的，不影响表决的效力。

9、生效与公告

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起五日内报中国证监会或其他有权机构核准或者备案，自其核准之日或相关核准另行确定的日期或出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对基金管理人、基金托管人和全体基金份额持有人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在至少一种指定媒体公告。在公告基金份额持有人大会决议时，将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。法律法规或监管机关对基金份额持有人大会有关事项另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配的原则

1、基金收益分配比例按有关规定制定；

2、投资者可以选择现金分红或红利再投资，本基金分红的默认方式为现金分红；

3、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

4、基金当期收益应先弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配；

5、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配四次。全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%，但若基金合同生效不满 3 个月则不进行收益分配；

6、每一基金份额享有同等分配权。

（五）基金收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、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。

（六）基金的费用种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金证券交易费用；

4、基金的信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；

7、销售服务费，具体计提办法按中国证监会的规定执行；

8、按照国家有关规定可以列入的其它费用。

（七）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理费

本基金管理费年费率为 0.75%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率，计算方法如下：

H＝E×0.75%÷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，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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管费

本基金托管费年费率为 0.15%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率，计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H：为每日应支付的基金托管费；

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，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、公休假等，支付日期顺延。

3、基金首次发售中所发生的律师费、会计师费及与基金有关的法定信息披露费等费用自基金认购费用中列支，不另从基金财产中支付；若本基金发售失败，发售费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

4、上述（六）基金费用第 3－8 项费用，除上款规定的费用外，由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，从基金财产中支付。

（八）基金投资

1、投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在 4%以下，以实现对基准指数的有效跟踪。

2、投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数成份股、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，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%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。

3、基准指数与业绩衡量基准

基准指数：本基金股票资产的基准指数为中证 100 指数。

如果中证 100 指数被停止编制及发布，或中证 100 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中证 100 指数不宜继续作为基准指数，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变更本基金的基准指数；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基准指数。

根据市场变化，从基金份额持有人利益出发，依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，本基金可能转换成为 ETF 基金。

本基金由于上述原因变更基准指数或转换成为 ETF 基金，需经中国证监会核准，并在正式实施前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告

业绩衡量基准：中证 100 指数收益率×95%＋一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%

4、投资理念

本基金认为，我国经济增长将保持持续稳定的发展态势，为指数投资获取长期稳定收益奠定了良好的宏观经济基础。本基金选择了以市值代表性强、流动性高、大盘蓝筹为特色的中证 100 指数为股票组合的跟踪基准，力求通过被动指数化、分散化的投资方式，通过买入并持有的长期投资策略，获取中国资本市场长期增长的稳定收益，以使投资者能够分享中国经济增长的长期收益。

（九）基金的投资限制

1、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）依照法律行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动；

2、本基金投资组合比例将符合以下限制

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

（2）股票、债券和现金的投资比例应符合本基金合同规定的投资比例限制；

（3）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起 3 个月内达到规定的标准。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

（十）基金资产净值的计算方式和公告

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

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、基金份额净值。

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、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值、基金份额累计净值。

基金管理人应当在半年度和年度最后一个市场交易日的次日，将前日的基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（十一）基金合同的终止和基金财产的清算

1、出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止的；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

（3）法律法规规定、中国证监会要求或基金合同规定的其他情况。

2、本基金终止后，须依据法律法规和本基金合同对基金进行清算。清算报告报中国证监会备案并予以公告后本基金合同终止。

3、清算程序

（1）基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；

（2）清算小组对基金财产进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估价和变现；

（4）基金财产清算小组做出清算报告；

（5）会计师事务所对清算报告进行审计；

（6）律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（7）将基金财产清算报告报中国证监会备案；

（8）公布基金财产清算公告；

（9）对基金财产进行分配。

（十二）争议的处理

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，应由各方通过协商予以解决。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设在北京的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。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

（十三）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅；也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十一、基金托管协议的内容摘要

长盛中证 100 指数证券投资基金托管协议（以下简称“本托管协议”）是依据《基金法》《运作办法》和《销售办法》等有关法规及《基金合同》由基金管理人和基金托管人订立。

（一）托管协议当事人

本基金托管协议当事人基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行。

（二）基金托管人和基金管理人之间的业务核查

1、基金托管人对基金管理人的业务核查

（1）基金托管人对基金管理人的投资行为进行监督和核查

①基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关技术系统，对基金投资范围、投资对象进行监督，监督内容包括但不限于：投资范围、投资对象是否符合《基金合同》规定的指数化投资风格等。监督标准包括但不限于：基金是否严格投资于《基金合同》规定的指数成分股、备选成分股和新股（一级市场初次发行或增发）等；基金年跟踪误差是否不超过 4%等。监督的程序为：基金托管人每日日终进行核查，如果发现超过限制规定，将通知基金管理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）。基金托管人应对基金实际投资是否符合《基金合同》进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

②基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例、股票申购限制进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

a 本基金投资权证目前遵循下述投资比例限制，若相关法律法规另有规定，本基金权证投资比例限制自动按相关法律法规进行修订，不受下述条款限制：本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的千分之五；本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的百分之三；本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不超过该权证的百分之十。

b 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。

c 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。

监督的程序为：基金托管人定期或不定期对基金投融资进行核查，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，如果发现超过限制规定，将通知基金管理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证监会。

③基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金的投资禁止行为实施监督。监督内容和标准包括但不限于：基金是否违反了法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定（基金管理人和基金托管人应相互提供与其有控股关系的股东或有重大利害关系的公司名单）；是否从事了承销证券、向他人贷款或者提供担保；是否从事了承担无限责任的投资等。监督的程序为：基金托管人定期或不定期对基金的禁止投资行为等进行监督核查，如果发现基金管理人违规操作，将通知基金管理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证监会。

④基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督，监督内容包括但不限于：基金的银行间市场投资情况；基金对交易对手的资信控制和交易方式的控制等。监督标准包括但不限于：基金是否严格按照有关法律法规的规定参与银行间债券市场交易；基金是否严格按照有关风险防范制度对交易对手的资信情况和交易方式进行控制等。监督的程序为：基金托管人定期或不定期对基金参与银行间债券市场的交易行为等进行监督核查，如果发现基金管理人违规操作，将通知基金管理人限期整改；基金管理人逾期未能整改或拒绝整改的，基金托管人有权报告中国证监会。

⑤基金托管人还可以根据法律法规的规定及《基金合同》的有关约定，对基金投资的其他方面进行监督。

（2）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则托管银行不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（3）基金托管人发现基金管理人的实际投资运作或投资指令违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时的处理方式和程序。

①基金托管人发现基金管理人的实际投资运作有违反《基金法》、《基金合同》、本协议和有关法律法规规定的，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

②基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《基金合同》、本协议和其它有关规定时，可以拒绝执行，但需立即通知基金管理人。

③基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，同时及时向中国证监会报告。

④基金托管人有权利行使法律法规、《基金合同》或本协议赋予、给予、规定基金托管人应有的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和《基金合同》当事人的利益。基金管理人因违反《基金合同》及本协议造成基金财产损失的，基金托管人应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿。

（4）基金管理人有义务配合和协助基金托管人依照本协议对基金业务执行监督和核查。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正；就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

2、根据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人应对基金托管人的业务进行核查。

（1）基金管理人应对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于：基金托管人是否安全地保管了基金财产、是否正确地开设了基金财产的资金账户和证券账户、是否合规复核了基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否严格根据管理人的指令办理清算交收、是否合规办理了相关信息披露并对基金投资运作进行监督等。

（2）基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查时应当遵循相应的程序，如果基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，出现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄漏基金投资信息或因基金托管人的其它原因而导致基金财产有所灭失、减损、或处于危险状态等情况时，基金管理人应立即以书面方式要求基金托管人限期纠正和采取必要的补救措施；基金管理人有权在限期内随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人有权报告中国证监会。

（3）基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性；收到基金管理人通知后及时核对；在规定时间内以书面形式对基金管理人发出回函并改正。

（4）如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本协议，基金管理人有权呈报相关监管机构，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本协议赋予、给予、规定的基金管理人应有的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和《基金合同》当事人的利益。基金托管人因违反《基金合同》及本协议造成基金财产损失的，基金管理人应为基金份额持有人的利益向基金托管人追偿。

（5）基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使核查权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效核查，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

（三）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产的保管责任，由基金托管人承担。基金托管人须遵守《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效持有并保管基金财产。

（2）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（3）基金托管人应安全、完整地保管基金财产；未经基金管理人的合法指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

（4）基金托管人应该按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（5）基金托管人保证其托管的不同基金财产之间相互独立；对不同的基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立，确保基金财产的完整与独立。

（6）基金托管人应当设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；建立健全内部风险控制制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先预防和事后监督，防范和减少风险。

（7）基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

（8）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定或约定外，基金托管人不得为自己及任何第三方谋取利益；基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取不当利益，其所得利益归于该基金财产；基金托管人不得将基金财产转为其固有财产，不得将固有资产与基金财产进行交易，或将不同基金财产进行相互交易；违背此款规定的，应承担相应的责任，包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任等。

（9）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定或约定外，基金托管人不得委托第三方托管基金财产。

2、基金成立时募集资金的验证

基金募集期限届满，具备基金备案条件，基金管理人应将募集的全部资金及其在募集期产生的利息存入指定的相应验资专户；由基金管理人聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具书面验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

3、基金的银行存款账户的开设和管理

（1）基金托管人应负责本基金的银行存款账户的开设和管理。

（2）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行存款账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

（3）本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行与本基金相关业务无关的活动。

（4）基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行存款账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《中国人民银行利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

4、基金证券账户和结算备付金账户的开设和管理

（1）基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设专门的证券账户。

（2）本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行与本基金相关业务无关的活动。

（3）基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的相关基金在交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

（4）基金证券账户和基金托管人结算备付金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理或变更，而不限于上述关于账户开设、使用的规定。

（5）在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定或相关法律法规、业务规则之规定办理。

5、债券托管专户的开设和管理

（1）《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入银行间债券市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向银行监管部门进行报备。

（2）基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

6、基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券、银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

7、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件由基金托管人、基金管理人共同保管；保管期限不少于 15 年；除另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。

（四）基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值总额除以计算日该基金发行在外的基金份额总份数后的数值。

2、当相关法律法规或基金合同规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人与基金托管人应当协商确定新的基金估值方法，若双方经协商未能达成一致，则基金管理人有权按照其选择的估值方法对基金进行估值，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。

3、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，基金管理人与基金托管人应当协商确定新的基金估值方法，若双方经协商未能达成一致，则基金管理人有权按照其选择的估值方法对基金进行估值，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。

4、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。如基金管理人与基金托管人核对净值一致并公告之后发现估值错误，若估值差错在基金资产净值的 0.5%以下，基金管理人与基金托管人应及时改正；若估值差错超过基金资产净值的 0.5%，则基金管理人需发布临时公告，由此给基金份额持有人造成的损失由基金管理人与基金托管人共同承担。

5、基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的基金资产净值和基金份额净值，并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人。

6、基金管理人和基金托管人在基金资产净值计算方法上意见不一致且协商不成时，基金管理人有权按照其选择的方法计算基金资产净值，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案，基金托管人对由此导致的估值差错不承担责任。

7、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

（五）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册等，均由基金管理人和基金托管人负责并分别保管，彼此应及时向对方提供相关信息。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金管理人可以担任注册登记机构，也可以授权其他合格机构担任注册登记机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

基金管理人有权利并有义务持续保管基金份额持有人名册。基金管理人授权其他合格机构担任注册登记机构时，可委托该注册登记机构承担基金份额持有人名册的持续保管义务。注册登记机构对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及相关监管机构的要求执行。基金份额持有人名册通常以书面形式提供，双方另行协商的除外。基金份额持有人名册的保管期限不少于 15 年。

基金管理人应当定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。基金管理人向基金托管人提供基金份额持有人名册的频率为一年不超过 1 次。

基金托管人未能妥善保存基金份额持有人名册，造成基金份额持有人名册毁损、灭失、泄漏基金份额持有人的秘密等，因此给基金份额持有人造成损害的，基金份额持有人有权要求基金托管人回复原状，并赔偿基金份额持有人因此遭受的损失。基金托管人只能将基金份额持有人名册用于履行本协议约定的目的，不得为其他任何目的使用基金份额持有人名册。

（六）争议解决方式

基金管理人、基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双方当事人应恪守其职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

（七）托管协议的变更与终止

1、本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。本协议变更的内容涉及到需要变更《基金合同》的相关内容的，则在按照《基金合同》规定的程序完成《基金合同》的变更后，本协议的相关内容方可变更。变更后的新协议需报中国证监会核准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；

（3）管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；

（4）发生《基金法》、《基金合同》及其他法律法规规定的终止事项。

二十二、对基金份额持有人的服务

我公司承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务项目，我公司根据基金份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，有权增加、修改服务项目：

（一）基金份额持有人注册登记服务

我公司委托注册登记人为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记人配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，基金份额持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

（二）红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该基金份额持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转基金份额，且不收取任何申购费用。

（三）定期定额投资计划

在条件成熟时，我公司可通过代销机构为基金份额持有人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，基金份额持有人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，该定期定额申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。、

（四）网上交易服务

为基金份额持有人提供网上交易平台。通过先进的网络通讯技术，为基金份额持有人提供高效安全的基金交易服务、及时迅捷的基金信息和理财服务。

（五）主动通知服务

通过邮寄、电子邮件、短信、主动致电等方式为基金份额持有人提供各项主动通知服务，包括邮寄季度对账单、发送月度电子对账单、基金份额持有人交易成交后发送电子通知单和短信通知信息、对账单寄送失败将进行电子邮件或短信通知、公司公告及重要信息将通过以述方式主动通知基金份额持有人等服务。

（六）查询服务

为方便基金份额持有人随时了解公司相关信息及投资资讯，我公司开通 24 小时自动语音服务、网上查询、短信查询。通过以上方式可进行公司信息查询和基金份额持有人账户信息查询。

具体查询内容：

自动语音及网上查询：最新活动公告、各基金介绍、公司介绍等公司信息；基金交易查询、投资现值查询、基金分红查询、对账单查询等账户信息

短信查询：基金净值情况、账户情况

或可直接致电客户服务热线转人工查询。

（七）多元资料索取

为向基金份额持有人提供详细的专业基金投资资料，便于办理各种交易手续，同时方便基金份额持有人索取，我公司提供了多元化的资料索取服务，索取途径多样，资料内容丰富详尽。

基金份额持有人可通过 24 小时客户服务热线的自动语音系统以传真与 EMAIL 形式索取公司最新文件：直销业务表格、封闭式及开放式基金公告、各种投资研究报告、基金知识及公司相关信息。

所有对外公布之文件及各种相关历史文件均可向客户服务人员索取，客户服务人员可通过传真、EMAIL 及邮寄形式提供。

同时，公司网站上提供各种资料、业务表单及公告下载。

（八）资讯服务定制

为进一步提高基金运作的透明度，提升服务品质，使基金份额持有人及时了解基金投资资讯，我公司推出全方位资讯服务定制项目。基金份额持有人可通过客服热线、公司网站、短信定制各种资讯，公司通过传真、EMAIL、短信等多渠道发送资讯定制服务。

我公司会按照基金份额持有人要求定期提供日报、周报、月报及月度电子对账单、电子交割确认单、短信成交通知、短信每周净值、公司旗下四只封闭式及开放式基金的中报、年报、投资组合公告、业绩表现、及各种投资研究报告和临时公告等。

我公司的资讯服务，在做到每天发送各种不同资讯同时，资讯内容全方位涵盖了公司全部可披露信息，并将市场的最新信息、具有深度的新闻资讯及我公司的市场判断、操作等。每月我公司向基金份额持有人提供电子邮件形式的电子对账单，以便更加及时的了解账户情况。

另外，我公司每季度还为基金份额持有人准备了精美的季刊，使基金份额持有人能深切体会长盛的公司文化、了解公司研究成果。

（九）投资业务咨询

我公司拥有一支训练有素、专业知识全面的投资顾问队伍，为更好地与基金份额持有人进行沟通，公司的专业客户服务代表在工作时间内回答客户提出的问题，提供关于基金投资全方位的咨询服务。

同时，还提供网上短信息交流及手机短信息交流。

（十）投诉建议受理

如果对我公司提供的各种服务感到不满或需求，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等各种方式随时向我公司提出，也可直接与客户服务人员联系，我公司将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉；同时，基金份额持有人的合理建议是我公司发展的动力与方向。

（十一）语音留言服务

为加强沟通和联系，我公司在任何时间均提供语音留言服务，将基金份额持有人疑问或意见保存，客户服务人员将及时进行处理。

（十二）客服互动活动

我公司为基金份额持有人举办各种互动活动如基金份额持有人见面会、理财讲座、积分银行活动，以加强基金份额持有人与基金公司间的互动联系。

（十三）长盛客户服务中心联系方式

长盛基金管理有限公司客户服务热线：（010）62350088
400－888－2666

长盛基金管理有限公司网址：www.csfunds.com.cn

长盛基金管理有限公司客户服务电子信箱：service@csfunds.com.cn

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、销售代理人和登记注册人的办公场所和营业场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

（一）中国证监会批准长盛中证 100 指数证券投资基金设立的文件

（二）法律意见书

（三）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（四）基金托管人业务资格批件和营业执照

（五）《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》

（六）《长盛中证 100 指数证券投资基金托管协议》

（七）《长盛中证 100 指数证券投资基金注册登记与登记过户委托代理协议》

（八）中国证监会规定的其它文件

长盛基金管理有限公司
二零零六年十月二十三日