长盛中证 100 指数证券投资基金招募说明书

(上接 B8 版)

（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“三层控制二道监督”（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，并通过全面梳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。

（1）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揽，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。

（2）公司基本管理制度包括风险管理制度、合规性制度、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。

（3）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。一般而言，当市场有变化或主管部门有新的规章制度时，相关制度会相应更改。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）建立了严格评价程序，以评估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、基金管理人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国农业银行

住所：北京市海淀区复兴路甲 23 号

办公地址：北京市海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人：杨明生

电话：（010）68424199

联系人：李芳菲

成立时间：1979 年 2 月 23 日

注册资本：1338.65 亿元人民币

存续期间：持续经营

（二）主要人员情况

杨明生先生：中国农业银行党委书记、行长。硕士、高级经济师。曾任中国农业银行辽宁省分行办公室副主任、农行沈阳市分行副行长、党组成员，农行工业信贷部主任助理、副主任、主任，农行天津市分行副行长、党组副书记（主持工作），农行天津市分行行长、党组书记，农行副行长、党委副书记，现任农行党委书记、行长。

杨琨先生：中国农业银行副行长。硕士、高级经济师。曾任中国农业银行人事部劳动工资处处长，农行人事教育部副主任，农行市场开发部总经理，农行安徽省分行行长、党委书记，中国农业银行行长助理，现任中国农业银行副行长。

张军洲先生：托管业务部总经理。博士，高级经济师。曾任中国农业银行信托投资公司总经理助理、副总经理，农行总行法律事务部副总经理、总经理，现任托管业务部总经理。

刘树军先生：托管业务部副总经理。工商管理硕士，高级经济师。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书，农行总行信贷部工业信贷处处长，现任托管业务部副总经理。

余晓晨先生：托管业务部副总经理，经济学硕士、高级经济师。曾任香港农银证券公司总经理、托管业务部市场开发处处长、境外资产托管处处长、委托资产托管处处长，现任托管业务部副总经理。

（三）基金托管业务经营情况

1、部门设置及员工：1998 年 5 月，中国农业银行证券投资基金托管部经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设技术保障处、营运中心、委托资产托管处、证券投资基金托管处、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处和投资银行处，拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统，现有员工 60 名。

2、基金托管业务经营情况

截至 2006 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 36 只，分别是：基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景博、基金景福、基金兴业、基金天华、基金同德、基金景业、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、湘财荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF），托管基金份额达 622 亿份。

3、基金托管人的内部风险控制制度说明

（1）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，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。

（2）内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的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。托管业务部专门设置了风险管理处，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。

（3）内部控制制度及措施

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；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、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；业务信息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。

（四）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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户，基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）长盛基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

电话：（010）82255818－263、288

传真：（010）82255981、82255982、82255983

联系人：关威

（2）长盛基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 15 楼 F 座

电话：（021）68869285、（021）68869286

传真：（021）68869287

联系人：冯岩

2、代销机构

（1）中国农业银行

住所：北京市海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人：杨明生

电话：（010）68298560

传真：（010）68297268

联系人：蒋浩

客户服务热线：95599

（2）其他代销机构（详见本基金基金份额发售公告）

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：陈耀先

电话：（010）58598839

传真：（010）58598907

联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：国浩律师集团（北京）事务所

注册地址：北京市东城区贡院六号 E 座 9 层

办公地址：北京市东城区贡院六号 E 座 9 层

法定代表人：王卫东

电话：（010）65171188

传真：（010）65176800

经办律师：李永飞、王卫东

（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

注册地址：上海市浦东新区沈家弄 325 号

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：Kent Watson

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

经办注册会计师：汪棣、薛竞

六、基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2006 年 8 月 28 日证监基金字[2006]172 号文批准募集。

（一）基金类型与存续期间

1、基金类型：契约型开放式

2、基金存续期间：不定期

（二）募集概况

1、募集方式：募集方式采用场外认购与场内认购相结合的公募方式。场外认购是指投资者可以通过本基金直销和代销渠道认购本基金份额，场内认购是指投资者可以通过上海证券交易所各会员单位认购本基金份额。

2、募集期限：本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

3、募集对象：中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者（法律法规及有关规定禁止购买证券投资基金者除外）。

4、基金募集规模：本基金不设最高募集规模。

5、基金的面值、认购价格及认购费用

本基金每份基金份额面值为人民币 1.00 元，按面值发售，每份基金份额认购价格为人民币 1.00 元。

本基金的认购费率不高于 1.0%，随认购金额的增加而递减，如下表所示：

认购金额（M，含认购费）	认购费率
M＜50 万	1.0%
50万≤M＜200 万	0.8%
200万≤M＜500 万	0.6%
M≥500 万	按笔收取，1000 元 / 笔

6、认购期利息的处理方式

本基金的认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额，归基金份额持有人所有，利息的具体金额，以注册登记人的计算和确认为准。

7、认购份额的计算

（1）场外认购采用金额认购的方式。场外认购的有效份数保留至 0.01 基金份额，小数点后第三位四舍五入，由此引起的差额计入基金财产。

本基金认购份额的计算如下：

认购费用＝认购金额×认购费率

净认购金额＝认购金额－认购费用

认购份额＝（净认购金额＋认购利息）/ 基金份额面值

（2）场内认购采用金额认购的方式。场内认购的有效份额保留到整数位，剩余部分折回金额退还给投资者，同时每笔认购金额必须是 100 的整数倍，最多不超过 99,999,900 元。

认购费用＝认购金额×认购费率

净认购金额＝认购金额－认购费用

认购份额＝（净认购金额＋认购利息）/ 基金份额面值

例：某投资人投资 100,000 元认购本基金，对应费率为 1.0%，假设该笔认购产生利息 50 元，则其可得到的认购份额为：

认购费用＝100,000×1.0%＝1,000 元

净认购金额＝100,000－1000＝99,000 元

认购份额＝（99,000+50）/1.00＝99,050 份

8、场外认购时间与程序

（1）场外认购场所

本基金通过长盛基金管理公司北京、上海直销中心和中国农业银行等销售代理机构办理开放式基金业务的网点公开发售。详细认购场所见本基金份额发售公告。

（2）时间安排

在发售期内，本基金的直销与代销机构在工作指定时间中持续办理本基金的认购手续。具体时间见发售公告和相关销售机构公告。

（3）基本认购程序

A、投资者认购本基金需首先办理开户手续，开立中国证券登记结算有限责任公司上海开放式证券投资基金账户（以下简称“开放式基金账户”），已经开立基金账户的客户无需重新开户。

B、投资者依照销售机构的规定，在募集期的交易时间段内提出认购申请，并办理有关手续。

C、本基金采取金额申报方式，认购期场外最低认购金额为 1000 元人民币，投资者认购本基金，须按销售机构规定全额缴纳认购款项。

D、在设立募集期内，投资者可多次认购基金份额。但认购申请确认完成后，投资者不得撤销。

E、销售网点受理申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记与过户机构的确认登记为准。投资人可在正式提交认购申请后 T+2 日后到所销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

F、本基金对单个基金份额持有人持有基金份额设有最高和最低比例或数量的限制。

9、场内认购时间与程序

（1）认购场所

本基金通过上海证券交易所开通上证基金通业务的各会员单位的网点公开发售。详细募集场所见本基金份额发售公告和上海证券交易所有关公告。

（2）时间安排

在发售期内，上海证券交易所将于交易日交易时间内持续挂牌定价销售本基金份额。具体时间见发售公告和上海证券交易所相关公告。

（3）基本认购程序

A、投资者认购本基金需使用中国证券登记结算有限责任公司上海人民币普通股票账户（以下简称股票账户）或上海证券投资基金账户（与股票账户合并简称为证券账户）办理上证所场内认购手续。

B、投资者依照上海证券交易所《开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》的规定，在募集期交易日交易时间内提出认购申请，并办理有关手续。

C、本基金场内认购以金额申报，最低认购金额 1000 元人民币，每笔认购金额必须是 100 元或其整数倍，全额缴纳认购款项。

D、在设立募集期内，投资者可多次认购基金份额。但认购申请受理完成后，投资者不得撤销。

E、本基金对单个基金份额持有人持有基金份额没有最高和最低比例或数量的限制。

10、认购数额的限制

（1）基金投资者场外认购本基金的最低认购金额为 1000 元人民币；

（2）基金投资者场内认购本基金的最低认购金额为 1000 元人民币，同时每笔认购金额必须是 100 元的整数倍，并且每笔认购最大不超过 99,999,900 元。

11、基金募集期间的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

在基金认购期限内，一旦基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币，同时基金份额持有人的人数不少于 200 人，基金管理人有权提前结束认购期，并发布结束认购公告。基金管理人应自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。本基金合同自中国证监会出具书面确认之日起生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

基金合同生效前，投资人的认购款项应存入专门账户，不得动用。

（二）基金募集失败时的处理方式

1、募集期限届满，未达到基金合同生效条件，或募集期内发生使基金合同无法生效的不可抗力，则基金募集失败。

2、本基金募集失败，基金管理人应当承担下列责任：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在基金募集期限届满后 30 天内返还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

3、基金募集失败，基金托管人、基金管理人及销售机构不得请求报酬。

（三）基金合同生效后的基金份额持有人数量和资产规模限制

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

八、基金份额的申购与赎回

（一）日常申购与赎回的场所

1、场外申购与赎回

投资者可以通过长盛基金管理公司北京、上海直销中心和中国农业银行等销售代理机构办理开放式基金业务的网点申购与赎回本基金份额。详细认购场所见本基金份额发售公告。

2、场内申购与赎回

投资者可以通过上海证券交易所开通上证基金通业务的各会员单位的网点申购与赎回本基金份额。详细信息见本基金份额发售公告和上海证券交易所有关公告。

（二）申购与赎回的开放日及开放时间

本基金合同生效后不超过三个月的时间起开始办理申购、赎回。基金管理人应在申购开放日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日，开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

基金管理人如果对申购、赎回时间进行调整，应报中国证监会备案，并在实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

（三）申购与赎回的限制

1、申购与赎回的数额限制

（1）本基金场外申购的最低申购金额为 1000 元人民币。

（2）本基金场内申购的最低申购金额为 1000 元人民币，同时每笔申购金额必须是 100 的整数倍，并且每笔申购最大不超过 99,999,900 元。

（3）本基金不设最低赎回份额。场内单笔赎回的基金份额申报必须是整数份额，且最多不能超过 99,999,999 份基金份额。

（4）根据市场情况，基金管理人可以调整申购基金份额的最低金额限制，基金管理人必须在开始调整之日的 3 个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

2、单个账户持有本基金份额的限制

本基金暂无单个账户基金份额最低持有余额限制，根据市场情况，基金管理人可以调整单个账户持有本基金份额的限制，基金管理人必须在开始调整之日的 3 个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

本基金对单个投资人累计持有份额不设上限限制，但法律法规、中国证监会另有规定的除外。

（四）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购、赎回申请可以在当日交易时间结束以前撤销（但场内申请已被确认或场外申报已被受理的除外），在当日的交易时间结束以后不得撤销。

4、投资者提交赎回申请时，由系统自动识别先前认购 / 申购基金份额的时间，按每笔交易的具体时间来计算持有期限，系统会采取先进先出法，即先认购 / 申购的基金份额会先赎回，按不同的持有期限分别计算收取赎回费。

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前三个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

（五）申购、赎回的程序

1、申请方式：书面申请或基金销售机构规定的其他方式。

2、基金投资者必须根据基金销售机构规定的手续，向基金销售机构提出申购、赎回的申请。

投资人在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回申请时，账户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效而不予成交。

3、申购、赎回申请的确认

T 日提交的有效申请，投资者可在 T＋2 日后到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

4、申购、赎回的款项支付

基金申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项通常在 T＋7 日内划往赎回人指定的银行账户。在发生巨额赎回或延期支付的情形时，款项的支付办法参照本基金合同和招募说明书的有关条款办理。

5、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

（六）申购份额、赎回金额的计算方式

1、申购份额及金额的处理方式

场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用（若有）后，以申请当日的基金份额净值为基准计算，四舍五入法保留两位小数，由此引起的差额计入基金财产。

场内申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用（若有）后，以申请当日的基金份额净值为基准计算，保留到整数位，剩余部分折回金额返回投资者。

2、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

申购费用＝申购金额×申购费率

净申购金额＝申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额 / 当日基金份额净值

例：某投资人投资 100,000 元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	100,000 元
基金份额净值（NAV）	1.0160 元
申购费用	100,000×1.5%＝1,500 元
净申购金额	100,000－1,500=98,500 元
申购份额	98,500/1.0160＝96,948.82 份

3、赎回金额的处理方式：

本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用，赎回金额保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此引起的差额计入基金资产。

本基金不设最低赎回份额。场内单笔赎回的基金份额申报必须是整数份额，且最多不能超过 99,999,999 份基金份额。

4、基金赎回金额的计算

赎回费＝赎回当日基金份额净值×赎回份额×赎回费率

赎回金额＝赎回当日基金份额净值×赎回份额－赎回费

例：某投资人赎回 10,000 份本基金，假设赎回当日的基金份额净值为 1.0560 元，持有期不足一年，则其可得到的赎回金额为：

赎回份额	10,000 份
基金份额净值（NAV）	1.0560 元
赎回费用	10,000×1.0560×0.5%＝52.80 元
赎回金额	10,000×1.0560－52.80＝10,507.20 元

5、基金份额净值的计算

本基金每个工作日公告基金份额净值，当日基金份额净值在当天收市后计算，并在下一工作日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

当日基金份额净值＝当日基金资产净值 / 当日基金份额数

（七）申购费率和赎回费率

1、申购费率：

本基金的申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减，可适用以下收费费率标准：

申购金额（M，含申购费）	申购费率
M＜50 万	1.5%
50万≤M＜200 万	1.2%
200万≤M＜500 万	1.0%
M≥500 万	按笔收取，1000 元 / 笔

2、本基金的赎回费率不高于 0.5%，随着持有期限的增加而递减：

持有期限	赎回费率
持有期＜一年	0.5%
一年≤持有期＜两年	0.25%
持有期≥两年	0

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可按中国证监会规定的程序调整申购费率、赎回费率，并在更新的《招募说明书》中进行公告。基金管理人调整申购费率、赎回费率应最迟在实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体和网站公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在取得有关监管机构核准之后，对促销期间的基金申购费等实行优惠。

（八）赎回费的归属和申购费、赎回费的用途

本基金赎回费的 25%归入基金财产所有。申购费和赎回费用的用途为市场推广、基金份额销售及注册登记等。

（九）申购、赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记人在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续。

投资者赎回基金成功后，注册登记人在 T+1 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体和网站上刊登公告。

（十）拒绝或暂停接受申购的情形及处理

本基金出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作；

2、证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金份额持有人利益产生损害；

4、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

5、基金场内交易停牌时；

6、法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停申购公告。

发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告。

（十一）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形和处理

本基金发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、不可抗力；

2、证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、基金场内交易停牌时；

4、连续 2 个开放日以上发生巨额赎回；

5、法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会报告并应在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。已确认的赎回申请，基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回份额。投资者在申请赎回时可以选择将当日未获受理部分予以撤销。

如果连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，对于已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过支付时间 20 个工作日，并在中国证监会指定的媒体上公告。

发生本基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停赎回或延缓支付赎回款项的，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停赎回或延缓支付赎回款项的公告。在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并按时支付赎回款项。

（十二）巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

巨额赎回指在单个开放日内，本基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）超过上一开放日基金总份额 10%的情形。

2、巨额赎回的处理

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为基金兑付投资者的全部赎回申请有困难，或认为为实现投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回的比例不低于上一日基金总份额 10%的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占基金赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回优先权并将以该开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回申请为止。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种指定媒体上公告，并说明有关处理办法。

（3）巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 2 日内在至少一种指定媒体上公告，并说明有关处理办法。

3、连续巨额赎回的情形及处理方式

基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间后的 20 个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（十三）与暂停申购和暂停赎回或延缓支付赎回款项相关的公告

发生上述暂停申购和暂停赎回或延缓支付赎回款项情况的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内在指定媒体上刊登暂停公告。

若发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

若发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

若发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

九、基金份额的非交易过户和基金间转换

（一）基金份额的非交易过户

基金注册登记人只受理继承、捐赠、司法执行情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”只受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供相关资料。

（二）基金间的份额转换

在条件允许的情况下，本基金也可与本公司其他开放式基金转换，具体业务办理时间在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换开始前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上公告。

（三）转托管

1、基金份额的登记

本基金通过场外和场内认购或申购买入的基金份额都登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下。

2、系统内转托管

系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构之间进行转托管的行为。

3、跨系统转托管

投资人可将上证所场内基金份额申请转托管至场外基金管理人或其代销机构处，也可将场外基金份额申请转托管至上证所场内证券经营机构处。

该类转托管只限于在上证所场内证券账户和场外以其为基金注册的开放式基金账户之间进行。

（四）冻结与解冻

基金登记注册人只受理司法机构依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金登记注册人的相关规定办理。

十、基金的投资

（一）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。

（二）投资范围

本基金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。

（三）基准指数与业绩衡量基准

1、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。

2、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%

（四）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。

（五）投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。

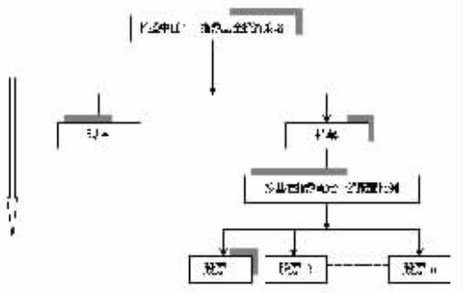
当预期成份股发生调整和成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如股权分置改革等）导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到基金合同相关规定。

1、资产配置

本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨，采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例，再进一步以复制基准指数的方法，确定不同股票之间的配置比例。

图 3 长盛中证 100 指数基金投资策略体系



（三）基准指数资产的基准指数构成

1、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。

2、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%

（四）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。

（五）投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。

当预期成份股发生调整和成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如股权分置改革等）导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到基金合同相关规定。

1、资产配置

本基金以追求基准指数长期增长的稳定收益为宗旨，采用自上而下的两层次资产配置策略，首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例，再进一步以复制基准