

长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）

上市交易公告书

公告书送出时间：2010 年 4 月 13 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

注册登记人：长信基金管理有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2010 年 4 月 16 日

公告时间：2010 年 4 月 13 日

目 录

一、重要提示与说明.....	3
二、基金概览	4
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	7
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要.....	16
七、基金财务状况.....	37
八、基金投资组合.....	39
九、重大事件揭示.....	43
十、基金管理人承诺.....	44
十一、基金托管人承诺.....	45
十二、备查文件目录.....	46

一、重要提示与说明

《长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书》(以下简称“本公告”)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〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人长信基金管理有限责任公司的董事会及董事保证本公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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告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。

中国证监会、深圳证券交易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 2010 年 2 月 1 日登载于上海证券报、中国证券报和证券时报和长信基金管理有限责任公司网站(<http://www.cxfund.com.cn>)的本基金招募说明书。

二、基金概览

- 1、基金简称：长信中证中央企业100指数（LOF）或长信100（深交所）
- 2、交易代码：163001
- 3、基金份额总额：743,255,611.35份（截止：2010年4月9日）
- 4、基金份额净值：1.000元（截止：2010年4月9日）
- 5、本次上市交易份额：155,765,645份
- 6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 7、上市交易日期：2010年4月16日
- 8、基金管理人：长信基金管理有限责任公司
- 9、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

(一) 本次基金上市前基金募集情况:

1、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2009年12月11日证监许可【2009】1361号

2、基金运作方式: 上市契约型开放式

3、基金合同期限: 不定期

4、发售日期: 2010年2月4日至2010年3月19日

5、发售价格: 1.00元人民币

6、发售期限: 44天

7、发售方式: 场外、场内认购

8、发售机构:

(1) 深圳证券交易所(场内)办理认购业务的发售机构:

具有基金代销业务资格的深交所会员: 名单详见深交所网站(<http://www.szse.cn>)的相关栏目内容

(2) 柜台(场外)办理认购业务的发售机构:

1) 直销机构: 长信基金管理有限责任公司

2) 代销机构: 指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件, 取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议, 代为办理基金销售业务的机构。

9、验资机构名称: 上海众华沪银会计师事务所

10、募集资金总额及入账情况: 本次募集的有效净认购额(不含利息)为人民币742,975,016.75元, 折合基金份额742,975,016.75份; 注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司确认的认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币280,594.60元, 折合基金份额280,594.60份。本次募集净认购资金及认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息已于2010年3月25日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购户数为11,737户, 按照每份基金份额面值1.00元人民币

币计算,本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 743,255,611.35 份,已分别计入各基金份额持有人基金账户,归各基金份额持有人所有。本基金管理人基金从业人员持有的基金份额总额为 6,084.31 份,占本基金总份额的比例为 0.00%。

11、本基金募集备案情况:本基金于 2010 年 3 月 25 日验资完毕,2010 年 3 月 26 日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于 2010 年 3 月 26 日获得书面确认,本基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日:2010 年 3 月 26 日。

13、基金合同生效日的基金份额总额:743,255,611.35 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:深圳证券交易所深证上【2010】116 号

2、上市交易日期:2010 年 4 月 16 日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称:长信 100 (深交所)或长信中证中央企业 100 指数 (LOF)

5、交易代码:163001

6、本次上市交易份额:155,765,645 份

7、基金资产净值的披露:包括开放式基金每个工作日交易结束后对基金资产净值进行的估值和基金上市交易时间内的参考净值揭示两部分。

基金管理人每日对基金资产估值。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。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》,开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此基金管理人公布的基金净值负责。

8、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至 2010 年 4 月 9 日的场内基金持有情况:

场内基金份额持有人户数: 3,650 户

平均每户持有的场内基金份额: 42,675 份

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例: 机构持有 21,831,526 份, 占 14.02%

场内个人投资者持有的基金份额及场内基金占总份额比例: 个人持有 133,934,119 份, 占 85.98%

场内基金前十名持有人情况:

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例 (%)
1	山西华银投资担保有限公司	20,001,400	12.84
2	范阳秋	6,001,200	3.85
3	梁灼平	6,000,420	3.85
4	吴炎龙	2,400,192	1.54
5	冯宝东	2,197,065	1.41
6	王玲	2,020,444	1.3
7	陈耀	2,000,320	1.28
8	王强	2,000,256	1.28
9	王蒲仙	1,988,059	1.28
10	江苏翔威贸易有限公司	1,600,112	1.03

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：长信基金管理有限责任公司

2、法定代表人：田丹

3、总经理：蒋学杰

4、注册资本：1.5亿元人民币

5、注册地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼

6、设立批准文号：中国证监会证监基金字【2003】63号

7、工商登记注册的法人营业执照文号：310101000315489

8、经营范围：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务（涉及许可经营的凭许可证经营）。

9、存续期间：持续经营

10、股东及其出资比例：公司股东由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司组成，三家股东的出资额分别为 7350 万元人民币、5149.5 万元人民币、2500.5 万元人民币，占注册资本比例分别为 49%、34.33%、16.67%。

11、内部组织结构及职能

公司实行董事会领导的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。根据公司发展战略和组织管理原则，结合基金管理的业务特点，在经营管理层下设内部控制委员会、特定客户资产投资决策委员会、投资决策委员会和产品发展委员会四个非常设委员会，以及投资管理部、研究发展部、交易管理部、固定收益部、金融工程部、专户理财部、基金事务部、市场开发部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、国际业务部等 12 个部门，并设立了北京分公司和武汉办事处。

投资管理部

主要负责基金资产的具体投资。

研究发展部

负责投资组合的基础研究，主要负责收集、分析各类政治、经济与行业信息，研究宏观经济、资本市场、行业及上市公司的情况，为投资组合的投资决策提供建议和依据。

交易管理部

负责制定交易管理的基本制度，核查指令的合规性，准确及时地执行交易指令，进行市场分析、询价，维护有关交易数据，协调与交易相关的业务关系等。

固定收益部

负责分析和研究经济、货币政策和财政政策等有关信息，向投资决策委员会投资决策提供固定收益证券的投资策略和资产配置建议，管理固定收益证券的投资组合。

金融工程部

根据公司业务开展的需要，从事金融创新研究，做好基金产品开发、风险与业绩评估、数量分析研究等基本工作，不断完善公司的基金产品线，并在与公司研究部门协作的基础上共同支持投资管理部、固定收益部和各投资组合经理的投资组合资产管理工作的。

专户理财部

负责公司特定客户资产管理业务的运作和管理。

基金事务部

负责基金、专户投资组合资产清算、会计核算、注册登记、直销客户业务办理等。

市场开发部

负责公司基金产品的首次发行和持续营销、基金产品营销策略制定和推广，为各类客户提供日常及增值服务，协助公司制订发展战略和开拓新业务。主要包括渠道开发维护、机构客户开发维护、客户服务、营销策划和支持等职能。

信息技术部

负责提供信息系统支持，保障公司日常经营正常运转。

监察稽核部

在公司内部行使监察稽核职能，负责公司的法律事务、信息披露、各项业务的常规监察稽核和专项监察稽核等工作，在业务上接受督察长和内部控制委员会

的指导和监督。

综合行政部

全面负责公司的行政后勤、人力资源的开发与管理、财务及自有资产管理等工作。

国际业务部

负责 QDII 等海外投资研究等相关业务。

北京分公司

主要负责公司与中国证监会、托管银行等相关部门的沟通与联系。同时，负责公司在北方地区（含东北、华北、西北等省、直辖市、自治区）的各项业务的拓展工作。

武汉办事处

公司在湖北省武汉市设立的联络性派驻机构，不从事经营性活动。

12、人员情况：

截至 2009 年 12 月，公司现有正式员工 101 人，博士学历 6 人，占 6%；硕士学历 48 人，占 48%；本科学历 39 人，占 39%；专科学历 6 人，占 6%；其它 2 人，占 2%。具有海外留学或工作经历的 17 人，占 17%。

13、信息披露负责人及咨询电话：

周永刚，(021) 61009999

14、基金管理业务情况简介：

目前公司已具有发起设立公募基金、特定客户资产管理业务和合格境内机构投资者 (QDII) 业务资格。

截止 2010 年 3 月 31 日，目前公司旗下共有 8 只开放式基金，其中 1 只为货币型基金，1 只为混合型基金，5 只为股票型基金，1 只为债券型基金。专户理财业务方面，我公司现管理 1 只“一对一”资产管理计划和 2 只“一对多”资产管理计划。

公司最近一年内没有因违法违规行为收到行政处罚或者刑事处罚，没有因违法违规行为正在被监管机构调查，或者处于整改期间，不存在对基金运作已经造成或可能造成不良影响的重大变更事项，或者诉讼、仲裁等其他重大事项，不存在公司治理不健全、经营管理混乱、内部控制和 risk 管理制度无法得到有效执行、

财务状况恶化等重大经营风险。

15、本基金基金经理：

许万国

(二) 基金托管人

1、基金托管人情况

(1) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000 股(包括 224,689,084,000 股 H 股及 9,000,000,000 股 A 股)。

截至 2009 年 12 月 31 日，中国建设银行实现净利润 1,068.36 亿元，较上年增长 15.32%，每股盈利为 0.46 元，较上年增加 0.06 元，盈利水平好于预期；

平均资产回报率为 1.24%，较上年降低 0.07 个百分点，加权平均净资产收益率为 20.87%，较上年提高 0.19 个百分点，整体盈利趋势向好；总资产达到 96,233.55 亿元，较上年增长 27.37%；资产质量在国内大银行中保持领先，不良贷款额和不良贷款率持续双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为 1.50%，较上年末下降 0.71 个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为 175.77%，较上年末提升 44.19 个百分点。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行，在悉尼设有代表处，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM) 36,021 台，拥有员工约 30 万人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，在 2009 年共获得 50 多个国内外奖项。中国建设银行在英国《银行家》杂志公布的“全球金融品牌 500 强”、“全球银行 1000 强”中分列第 9 位和第 12 位，被《亚洲货币》杂志评为 2009 年度“中国区最佳银行”，被《欧洲货币》杂志评为 2009 年度“中国最佳银行”，连续两年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”，荣获《亚洲银行家》杂志颁发的“中国风险管理成就奖”，中国扶贫基金会颁发的“20 年特别贡献奖”等奖项，被中国红十字基金会评为“最具责任感企业”，被《全球托管人》杂志评为“国内最佳托管银行”，连续三年荣获香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室，现有员工 130 余人。2008 年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会(AICPA)颁布的审计准则公告第 70 号(SAS70)进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的 SAS70 国际专项认证的托管银行。

(2) 主要人员情况

罗中涛, 投资托管服务部总经理, 曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作, 对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信, 投资托管服务部副总经理, 曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部, 对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟, 投资托管服务部副总经理, 曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部, 长期从事大客户的客户管理及服务工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(3) 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行, 中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念, 不断加强风险管理和内部控制, 严格履行托管人的各项职责, 切实维护资产持有人的合法权益, 为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展, 中国建设银行托管资产规模不断扩大, 托管业务品种不断增加, 已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系, 是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2009 年 12 月 31 日, 中国建设银行已托管 143 只开放式证券投资基金, 其中封闭式基金 6 只, 开放式基金 137 只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平, 赢得了业内的高度认同。2010 年初, 中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度“国内最佳托管银行”(Domestic Top Rated), 并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

2、基金托管人的内部控制制度

(1) 内部控制目标

作为基金托管人, 中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定, 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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行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。投资托管服务部专门设置了监督稽核处,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

投资托管服务部具备系统、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;业务管理严格实行复核、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。

3、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

(1) 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(2) 监督流程

A、每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

B、收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

C、根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

D、通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

（三）上市推荐人

无

（四）基金验资机构

名称：上海众华沪银会计师事务所

法定代表人：孙勇

注册地址：上海市嘉定工业区沪宜路叶城路口

联系电话：（021）63525500

经办注册会计师：沈蓉、程月敏

六、基金合同摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照本基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）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、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金财产及相关当事人的利益；

（7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

（8）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；

（9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（10）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（11）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（13）依法召集基金份额持有人大会；

（14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

（1）依法募集基金，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、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）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；

（6）除依据《基金法》、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，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）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（9）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；

（10）按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（12）编制中期和年度基金报告；

（13）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；

（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）按照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）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；

（17）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

（18）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者实施其他法律行为；

（19）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；

（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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（23）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；

（24）执行生效的基金份额持有人大会决议；

（25）不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

（26）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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（27）法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

2、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

（1）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（2）监督基金管理人对本基金的投资运作；

（3）自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

（4）在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

（5）根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大

损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

- (6) 依法召集基金份额持有人大会；
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，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；
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- (4) 除依据《基金法》、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，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 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；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密，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；
- (8) 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；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿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，应为基金向基金管理人追偿；

(19) 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；

(20) 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和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(23) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

3、基金份额持有人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

(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) 依法申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开或依法自行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依法提起诉讼；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购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及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

2、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上（含 10%，下同）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，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- A、终止基金合同；
- B、转换基金运作方式；
- C、变更基金类别；
- D、变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- E、变更基金份额持有人大会程序；
- F、更换基金管理人、基金托管人；
- G、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- H、本基金与其他基金的合并；
- I、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- J、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，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：

- A、调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- B、在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率；
- C、因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- D、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发生重大变化；
- E、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；
- F、按照法律法规或本基金合同规定需召开基金份额持有人大会的情形以外的其他情形。

3、召集人及召集方式

(1) 除法律法规或本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，会议时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 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，应当自行召集并确定会议时间、地点、方式和权益登记日。

(3) 代表基金份额 10%以上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。

(4) 代表基金份额 10%以上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，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%

以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 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、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) 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- A、会议召开的时间、地点和出席方式；
- B、会议拟审议的主要事项；
- C、会议形式；
- D、议事程序；
- E、有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- F、代理投票的授权委托书的内容要求（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；
- G、表决方式；
- H、会务常设联系人姓名、电话；
- I、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- J、召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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人和基金托管人到指定地点对书面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，不影响计票和表决结果。

5、基金份额持有人出席会议的方式

(1) 会议方式

A、基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

B、现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

C、通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

D、会议的召开方式由召集人确定。

(2) 召开基金份额持有人大会的条件

A、现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

a、对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同）；

b、到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与注册登记机构提供的注册登记资料相符。

B、通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

a、召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

b、召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

c、召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

d、本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上；

e、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、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

6、议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

A、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。

B、基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上（包括 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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。

C、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：

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解释和说明。

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。

D、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上（包括 10%）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。法律法规另有规定的除外。

E、基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

（2）议事程序

A、现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

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代表的基金份额 50%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。

B、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。

7、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。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

A、一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列 B 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；

B、特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）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。

8、计票

(1) 现场开会

A、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。

B、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。

C、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；如大会主持人未组织监票人进行重新清点，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组织监票人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。

9、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。

(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。

10、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。

(三) 基金收益分配原则、执行方式

1、基金分配原则

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除权后的份额净值自动转为基金份额；

(3) 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 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 30%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日除权后的份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资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交所及中国证券登记

结算有限责任公司的相关规定；

（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。

2、收益分配方案

基金收益分配方案中至少应载明收益分配基准日、截至收益分配基准日的可供分配利润、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。

3、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。

（四）与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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）基金上市费用；
- （4）基金财产划拨支付的银行费用；
- （5）基金合同生效后的基金信息披露费用；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- （8）基金的证券交易费用；
- （9）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、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。

3、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 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日。

(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 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日。

(3) 除管理费和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。

4、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。

5、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。

6、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。

(五) 基金财产的投资方向和投资限制

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，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现对标的指数的有效跟踪。

2、投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括中证中央企业 100 指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。

本基金投资于股票资产的比例占基金资产的 90%-95%，其中，中证中央企业 100 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

此外，本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，待指数衍生金融产品推出以后，基金管理人可以履行适当程序使本基金运用衍生金融产品进行风险管理。

3、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：

A、本基金投资于股票资产的比例占基金资产的 90%-95%，其中，中证中央企业 100 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值

的 5%;

B、本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;

C、本基金持有的同一权证不超过该权证的 10%; 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%; 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

D、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%;

E、本基金持有的债券其信用级别不低于 BBB 级;

F、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;

G、本基金持有的所有流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 5%; 本基金持有的同一流通受限证券, 其公允价值不得超过本基金资产净值的 3%;

H、如果法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货及其他金融衍生品工具时, 投资比例遵从法律法规和监管机构的规定;

I、法律法规及中国证监会规定的其他限制。

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 6 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:

A、承销证券;

B、向他人贷款或者提供担保;

- C、从事承担无限责任的投资；
- D、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- E、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；
- F、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；
- G、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；
- H、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；
- I、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。

（六）基金资产净值的计算方法和公告方式

1、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。

2、基金资产净值公告

（1）本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

（2）在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将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；

（3）基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、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。

（七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

（1）基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- A、转换基金运作方式；
- B、变更基金类别；
- C、变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- D、变更基金份额持有人大会程序；
- E、更换基金管理人、基金托管人；
- F、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规要求适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- G、本基金与其他基金的合并；
- H、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- I、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

- A、调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- B、在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- C、因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- D、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发生重大变化；
- E、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；
- F、按照法律法规或本基金合同规定需召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的

职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

（4）中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

（1）基金财产清算组

A、基金合同终止时，自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金财产清算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。

B、基金财产清算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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

（2）基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- A、基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- B、基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- C、对基金财产进行清理和确认；
- D、对基金财产进行估价和变现；
- E、聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- F、聘请律师事务所出具法律意见书；
- G、将基金财产清算结果报告中国证监会；
- H、参加与基金财产有关的民事诉讼；
- I、公布基金财产清算结果；
- J、对基金剩余财产进行分配。

（3）清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

（4）基金财产按下列顺序清偿：

- A、支付清算费用；
- B、交纳所欠税款；
- C、清偿基金债务；
- D、按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 A—C 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（5）基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

（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保存 15 年以上。

（八）争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

（九）基金合同存放地和投资者取得合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况

深圳证券交易所长信中证中央企业 100 指数证券投资基金(LOF)募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）2010 年 4 月 9 日资产负债表如下：

单位：人民币元

项目	行次	2010 年 4 月 9 日
资产：		
银行存款	1	35,952,893.31
结算备付金	2	3,045,455.99
存出保证金	3	250,000.00
交易性金融资产	4	249,601.04
其中：股票投资	5	249,601.04
债券投资	6	-
资产支持证券投资	7	-
衍生金融资产	8	-
买入返售金融资产	9	700,000,000.00
应收证券清算款	10	3,989,836.91
应收利息	11	178,583.18
应收股利	12	-
应收申购款	13	-
其他资产	14	-
资产总计	15	743,666,370.43
负债：		
短期借款	16	-
交易性金融负债	17	-
衍生金融负债	18	-
卖出回购金融资产款	19	-
应付证券清算款	20	-
应付赎回款	21	-
应付管理人报酬	22	213,826.41
应付托管费	23	42,765.29
应付销售服务费	24	-
应付交易费用	25	217.24

应交税费	26	-
应付利息	27	-
应付利润	28	-
其他负债	29	29,892.39
负债合计	30	286,701.33
所有者权益：		
实收基金	31	743,255,611.35
未分配利润	32	124,057.75
所有者权益合计	33	743,379,669.1
负债和所有者权益总计	34	743,666,370.43

八、基金投资组合

截止到 2010 年 4 月 9 日, 长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 的投资组合如下:

(一) 期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	249,601.04	0.03
	其中: 股票	249,601.04	0.03
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	700,000,000.00	94.13
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	38,998,349.30	5.24
6	其他资产	4,418,420.09	0.59
7	合计	743,666,370.43	100.00

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

1、指数投资部分

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	41,287.00	0.01
C	制造业	105,631.00	0.01
C0	食品、饮料	6,272.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,628.00	0.00
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	21,563.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	55,213.00	0.01
C8	医药、生物制品	16,719.00	0.00
C99	其他制造业	3,236.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,051.00	0.00

E	建筑业	13,435.00	0.00
F	交通运输、仓储业	11,776.00	0.00
G	信息技术业	12,448.00	0.00
H	批发和零售贸易	5,809.00	0.00
I	金融、保险业	18,294.04	0.00
J	房地产业	7,775.00	0.00
K	社会服务业	3,077.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,518.00	0.00
	合计	233,101.04	0.03

2、积极投资部分

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	16,500.00	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	16,500.00	0.00

(三) 截至公告前两个工作日即 2010 年 4 月 9 日, 按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002390	信邦制药	500	16,500.00	0.00
2	600150	中国船舶	200	13,972.00	0.00
3	600489	中金黄金	200	10,020.00	0.00
4	000423	东阿阿胶	200	6,202.00	0.00
5	601088	中国神华	200	5,838.00	0.00
6	600550	天威保变	200	5,774.00	0.00
7	000612	焦作万方	200	5,380.00	0.00
8	000999	华润三九	200	5,280.00	0.00
9	002128	露天煤业	200	5,228.00	0.00
10	600875	东方电气	100	4,800.00	0.00

1、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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002390	信邦制药	500	16,500.00	0.00

2、指数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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600150	中国船舶	200	13,972.00	0.00
2	600489	中金黄金	200	10,020.00	0.00
3	000423	东阿阿胶	200	6,202.00	0.00
4	601088	中国神华	200	5,838.00	0.00
5	600550	天威保变	200	5,774.00	0.00

(四) 期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金截至 2010 年 4 月 9 日止未持有债券。

(五) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金截至 2010 年 4 月 9 日止未持有债券。

(六) 期末按市值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资
 明细

本基金截至 2010 年 4 月 9 日止未持有资产支持证券。

(七) 期末按市值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金截至 2010 年 4 月 9 日止未持有权证。

(八) 投资组合报告批注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、截至 2010 年 4 月 9 日，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、 其他资产构成

单位：人民币元

其他资产明细	金额
交易保证金	250,000.00
应收证券清算款	3,989,836.91
应收股利	-
应收利息	178,583.18
应收申购款	-
其他应收款	-
待摊费用	-
其他	-
合计	4,418,420.09

4、 期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截止到 2010 年 4 月 9 日，本基金没有持有处于转股期的可转换债券。

5、 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说 明
1	002390	信邦制药	16,500.00	0.00	网上新股申购

6、 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

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、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

本基金备查文件包括以下文件：

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)基金合同》；
- (三) 《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)托管协议》；
- (四) 《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（<http://www.cxfund.com.cn>）查阅。

长信基金管理有限责任公司

2010年4月13日