

长盛同鑫保本混合型证券投资基金 招募说明书（更新）摘要

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

长盛同鑫保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2011 年 4 月 11 日获中国证监会证监许可【2011】519 号文批准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动而波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金根据股票与债券市场的波动趋势灵活配置股票与债券的投资比例，在系统研究基础上判断股票市场与债券市场的未来趋势，有可能发生判断失误的风险等。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资者投资于本保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，投资者投资本基金仍然存在本金损失的风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2011 年 11 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》

（以下简称“《信息披露办法》”）和其他相关法律法规的规定以及《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、基金合同生效的日期

本基金基金合同自 2011 年 5 月 24 日起生效。

三、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6 号文件批准，于 1999 年 3 月成立，注册资本为人民币 15000 万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%；新加坡星展银行有限公司占注册资本

的 33%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的 13%。截至 2011 年 11 月 24 日，基金管理人共管理两只封闭式基金、十五开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理多只专户理财产品。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员：

凤良志先生，董事长，博士，高级经济师。曾任安徽省政府办公厅二办副主任，安徽省国际信托投资公司副总经理，安徽省证券管理办公室主任，香港黄山有限公司董事长、总经理，安徽国元控股（集团）有限责任公司董事长、党委书记，安徽国元信托投资有限责任公司董事长。现任国元证券股份有限公司董事长。

钱正先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽省人大常委办公厅副处长、处长，安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记，安徽省国有资产管理局分党组书记。现任安徽省信用担保集团有限公司总经理。

杜长棣先生，董事，学士。曾任安徽省第一轻工业厅研究室副主任、安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长，安徽省巢湖市市委常委、常务副市长，安徽省发改委副主任。现任安徽省投资集团有限责任公司党委书记、总经理。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任，安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理，安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理，香港黄山有限公司总经理助理。现任国元证券股份有限公司董事、总裁。

陈淑珊女士，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括 ING 霸菱证券公司、花旗银行、摩根士丹利。现任星展银行有限公司私人银行业务部董事总经理兼主管。

张在荣先生，董事，学士。曾任职多个金融机构，包括法国东方汇理银行、美洲银行、渣打银行、星展银行有限公司。现任星展银行（中国）有限公司执行董事兼行政总裁。

周兵先生，董事、总经理，硕士，经济师。曾任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企

业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理（期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人）、北京朝阳门大街证券营业部总经理。2004年10月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理。

李伟强先生，独立董事，美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士，美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁，花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁。现任香港国际资本管理有限公司董事长。

张仁良先生，独立董事，金融学讲座教授。曾任香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人、太平洋经济合作理事会（PECC）属下公司管制研究小组主席、上海交通大学管理学院兼职教授、上海复旦大学顾问教授、香港城市大学讲座教授。现任香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署辖下的《伙伴倡自强》小区协作计划主席、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席以及香港特区政府策略发展委员会委员。2007 年被委任为太平绅士。2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、校学术委员会委员、政治经济学博士点学科带头人、产业经济学和工商管理硕士点学科带头人，武汉大学商学院博士生导师，中国科技大学兼职教授，安徽省政府特邀咨询员，全国马经史学会常务理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会副会长。

陈华平先生，独立董事，博士毕业，教授，博士生导师。曾任中国科技大学信息管理与决策研究室主任、管理学院副院长。现任中国科学技术大学计算机学院执行院长、管理学院商务智能实验室主任。

2、基金管理人监事会成员：

陈锦光先生，监事会主席，学士，特许金融分析师。曾任职于美国银行直投伙伴公司私募股权投资部门，历任野村证券高科技产业研究分析师、野村证券上海办事处及证券研究部门负责人、星展资产管理有限公司研究总监以及投资亚洲和中国国内市场的投资经理人。现任星展资产管理有限公司股票投资团队总监。

沈和付先生，监事，法学学士。曾任安徽省国际经济技术合作公司经理助理、

安徽省信托投资公司法律部副主任。现任国元证券股份有限公司合规总监。

叶斌先生，监事，学士，高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任，安徽省信托投资公司部门经理、副总经理。现任安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省信用担保集团有限公司副总经理。

钱进先生，监事，硕士研究生。曾任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理。现任安徽省投资集团有限责任公司总经济师。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计，太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司主管会计，长盛基金管理有限公司业务运营部总监、财务会计部总监。现任长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

3、基金管理人高级管理人员

凤良志先生，董事长，博士，高级经济师。同上。

周兵先生，董事、总经理，硕士，经济师。同上。

朱剑彪先生，金融学博士。曾任广东商学院投资金融系教师、党支部书记，广州证券有限公司宏观与策略研究员、投资银行部项目经理、基金部经理，金鹰基金管理有限公司筹备组成员、董事会秘书、研究总监、投研副总监兼研究总监和督察长。2007年4月起加入长盛基金管理有限公司，历任社保业务管理部总监、固定收益部总监、总经理助理、副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司常务副总经理、社保组合组合经理。

杨思乐先生，英国籍，拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位。从1992年9月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司（新加坡）。2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生，大学，会计师。曾任美菱股份有限公司财会部经理，安徽省信托投资公司财会部副经理，国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理。2004年10月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

蔡宾先生，1978年11月出生。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA（美国特许金融分析师）。2004年6月至2006年2月就职于宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理，投资经理等。现任固定收益部副总监，自2008年12月23日起任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，自2011年5月24日起兼任长盛同鑫保本混合型证券投资基金（本基金）基金经理。

（本招募说明书基金经理任职日是指公司批准日或公司公告日。）

5. 投资决策委员会成员

朱剑彪先生，金融学博士，常务副总经理。同上。

王宁先生，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理。

侯继雄先生，清华大学博士。历任国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部总监，同盛证券投资基金基金经理。

张芊女士，清华大学经济学硕士、法国工程师学院MBA，美国特许金融分析师CFA。历任中国银河证券债券研究员、中国人保资产债券投资主管、高级研究员等职务。现任长盛基金管理有限公司社保业务管理部和固定收益部总监，社保组合组合经理。

吴达先生，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，美国特许金融分析师CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司，历任星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2011 年 9 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益

增长混合、海富通中证 100 指数 (LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业 (TMT) 50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业

上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普 500 等权重指数(QDII)、长信标普 100 等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)等 128 只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

五、相关服务及担保机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

名称:长盛基金管理有限公司直销中心

地址:北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

邮政编码:100088

电话:(010) 82019799、82019795

传真:(010) 82255981、82255982

联系人:张莹、张晓丽

2、代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人:肖钢

电话:(010) 66594851

传真:(010) 66594942

联系人:吴雪妮

客户服务电话:95566

网站:www.boc.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客服电话：95599

传真：010-85109219

电话：010-85108227

网址：www.abchina.com

(3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

电话：010-67597114

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(4) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：林芳

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(5) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网站：<http://www.cmbchina.com/>

(6) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

网站：www.cmbc.com.cn

(7) 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：(021) 61618888

传真：(021) 63604199

联系人：虞谷云

客户服务热线：95528

网站：www.spdb.com.cn

(8) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：梁曦

电话：(021) 52629999

客户服务电话：95561

公司网站：www.cib.com.cn

(9) 广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：詹全鑫

电话：020-38322222

传真：020-87311780

客服电话：400-830-8003

公司网站：www.gdb.com.cn

（10）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66104235

传真：（010）66107914

联系人：郭越人

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

（11）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

客服电话：95558

联系人：赵树林

电话：010-65557046

传真：010-65550827

网址：<http://bank.ecitic.com>

（12）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：（010）85238000

传真：（010）85238680

客服电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

（13）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路179号

办公地址：合肥寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

开放式基金业务传真：(0551) 2272100

联系人：祝丽萍

(14) 华福证券股份有限公司

住所：福州市新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

联系人：张腾

统一客户服务电话：96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

(15) 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

电话：(0755) 82492000

传真：(0755) 82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：95513

公司网站：www.lhzq.com

(16) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

电话：(021) 53594566-4125

联系人：李笑鸣

客服电话：400-8888-001、(021) 962503

公司网址：www.htsec.com

(17) 齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(18) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

业务联系电话：021-38565785

业务联系人：谢高得

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(19) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

客户服务热线：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(20) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：万建华

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

联系人：芮敏祺

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(21) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

客户服务热线：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(22) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943237

联系人：林生迎

客户服务热线：95565、4008888111、(0755) 26951111

公司网址：www.newone.com.cn

(23) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

开放式基金咨询电话：4006000686

开放式基金业务传真：(0431) 85096795

联系人：潘锴

公司网址：www.nesc.cn

(24) 广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

开放式基金业务传真：(020) 87555305

联系人：黄岚

公司网址：www.gf.com.cn

(25) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

联系人：邱培玲、刘慧

电话：010-58328366、010-5832-8722

客户服务热线：400-887-8827

网站：www.ubssecurities.com

(26) 申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54035333

联系人：李清怡

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.sywg.com

(27) 国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

开放式基金咨询电话：(0510) 82831662

开放式基金业务传真：(0510) 82830162

客户服务热线：4008885288

公司网址：www.glsc.com.cn

(28) 中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层

法定代表人：杨明辉

联系人：杨瑞芳

电话：0755-82026511

传真：0755-82026539

(29) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

电话：(010) 66568430

传真：(010) 66568536

联系人：田薇

客服电话：400-888-8888

公司网站：www.chinastock.com.cn

(30) 中信证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：(010) 84864818

传真：(010) 84865560

联系人：张于爱

公司网址：www.ecitic.com

(31) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(32) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

长江证券客服网址：www.95579.com

(33) 华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：025-84457777-893

传真：025-84579763

联系人：程高峰

客户咨询电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(34) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑军

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

联系人：权唐

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(35) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市抚河北路 291 号

法定代理人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-6768763

客户服务热线：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

(36) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：楼斯佳

联系电话：021-50122107

客户咨询电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

(37) 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

联系人：王勤

联系电话：0571-85783750

客户咨询电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

(二) 注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：戴君棉

(三) 担保人

名称：安徽省信用担保集团有限公司

注册地址：合肥市长江西路200号

法定代表人：钱正

联系人：袁野

联系电话：0551-5227521

(四) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

(五) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

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：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：汪棣、张鸿

六、基金的名称

本基金名称：长盛同鑫保本混合型证券投资基金

七、基金的类型

基金类别：保本混合型证券投资基金

八、保本

（一）保本

本基金对适用保本条款的基金份额持有人投资净额提供本金保证。

在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期默认选择转入当期保本周期的基金份额持有人持有本基金到当期保本周期到期的，如可赎回金额加上保本周期内的累计分红金额低于其投资净额，则基金管理人或担保人应补足该差额，并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人。本基金第一个保本周期的担保人对此提供不可撤销的连带责任保证。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期内申购的或转换转入的基金份额不适用本条款。

认购保本金额 = 基金持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额。

过渡期申购保本金额 = 基金持有人过渡期申购并持有到期的基金份额的投资净额，即基金份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值。

从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额 = 基金份额持有人将其上一保本周期持有到期的基金份额转入当期保本周期并持有到期的，其基金份额在折算日所代表的资产净值。

对于基金持有人多次认购或申购、赎回的情况，以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

（二）适用保本条款的情形

1、对于本基金第一个保本周期而言，基金份额持有人在本基金募集期内认购并持有当期保本周期到期的基金份额。

2、对于本基金第一个保本周期后的保本周期而言，基金份额持有人在本基金过渡期限定期限内申购并持有当期保本周期到期的基金份额、基金份额持有人从本基金上一个保本周期默认选择转入当期保本周期的基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额）。

3、对持有当期保本周期到期的基金份额，基金份额持有人可以做出如下选择，其投资净额在保本周期到期时都适用保本条款：

（1）在保本周期到期赎回限定期限内赎回基金份额；

（2）在到期赎回限定期内从本基金转换到管理人管理的其他基金；

（3）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有本基金份额转入下一个保本周期；

（4）保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有的本基金份额转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的基金份额。

（三）不适用保本条款的情形

1、在当期保本周期到期日符合条件的基金份额持有人的可赎回金额加上其在当期保本周期期间的累计分红金额，不低于基金份额持有人的投资净额；

2、基金份额持有人当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额；

3、基金份额持有人在本基金募集期间认购的、基金份额持有人在本基金过渡期限定期限内申购或者基金份额持有人从本基金的上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的、但在当期开放到期赎回的限定期限前赎回或转换转出的基金份额；

4、在保本周期到期日后基金份额发生的任何形式的基金份额净值减少；

5、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；

6、在保本周期内，本基金更换基金管理人，担保人不同意担保的情形；

7、发生不可抗力事件，导致本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务。

九、担保

为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金第一个保本周期由安徽省信用担保集团有限公司作为担保人。由基金管理人代表基金份额持有人与担保人签署《保证合同》。

（一）担保人基本情况

名称：安徽省信用担保集团有限公司

法定代表人：钱正

注册地址：合肥市长江西路200号

邮政编码：230031

成立日期：2005年11月25日

注册资本：28.66亿元人民币

联系人：袁野

联系电话：0551-5227521

经营范围：为中小企业提供担保，为担保机构提供再担保服务，项目投资，资本运作，资产管理及咨询服务，信用评级，财务顾问，商务信息咨询。

担保人简介：

安徽省信用担保集团有限公司于2005年11月25日成立，是安徽省政府批准设立的国有独资专业担保机构，注册资本28.66亿元。截止到2011年10月31日，安徽省信用担保集团有限公司总资产42亿元，净资产35.37亿元，累计实现利润3.38亿元。

截至2011年11月30日，安徽省信用担保集团有限公司对外提供担保规模为1514156万元。

（二）《保证合同》

1、《保证合同》

担保基金管理人为本基金第一个保本周期的保本与担保人签署《保证合同》。《保证合同》的全文详见招募说明书的附件。《保证合同》中涉及基金份额持有

人利益的主要内容如下：

甲 方：长盛基金管理有限公司

乙 方：安徽省信用担保集团有限公司

(1) 担保额度

担保额度是指乙方同意为甲方向基金份额持有人提供担保的最高金额。

根据甲方的申请和项目实际情况，乙方授予甲方人民币 51 亿元的担保额度。

在担保额度内，在符合本合同约定的条件下，甲方对基金份额持有人所负债务将由乙方为其提供保证担保，乙方的保证责任以本合同为准。

(2) 保证的范围

保证范围为按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额的差额部分。

基金份额持有人在保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的基金份额不在保证范围之内。

乙方承担保证责任的最高限额为人民币 51 亿元。

(3) 保证期间

基金保本周期到期日起六个月。

(4) 保证的方式

在保证期间，乙方在保证范围内承担连带责任保证。

(5) 保证受益人

认购本基金并持有到期的基金份额持有人。

(6) 除外责任

下列任一情形发生时，乙方不承担保证责任：

1) 在保本周期到期日，按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资净额；

2) 基金份额持有人认购，但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出本基金的基金份额；

- 3) 基金份额持有人在本保本周期内申购的基金份额;
- 4) 在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形;
- 5) 在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形,且乙方不同意继续承担保证责任;
- 6) 保本周期到期日之后(不包括该日),基金份额发生的任何形式的净值减少;
- 7) 发生不可抗力事件,导致保本基金投资亏损或导致担保人无法履行保证义务。

(7) 到期偿付制度安排

1) 到期保本偿付准备及代偿准备

① 保本偿付准备:

a. 甲方应按照《基金合同》中的到期赎回制度安排基金资产的变现操作,准备资金应对持有人的赎回:

b. 甲方应在本基金保本周期到期日前 30 个日历日当日预测本基金是否可能发生到期保本偿付,并向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。甲方应自本基金保本周期到期日前 30 个日历日起每周做出预测并应于每周周末之前向乙方书面报送《保本到期前报送信息》。《保本到期前报送信息》的内容应包括基金资产累计净值、预计到期偿付金额、甲方在保本周期到期日可调度的自有资金总额等数据。

c. 甲方应不迟于保本周期到期日前 6 个月在托管银行开设独立帐户,与乙方共管。从保本周期到期日前 30 个日历日开始,其中任一工作日,保本基金按保证本金要求测算后,若出现不足保证本金的差额,甲方应在次工作日向上述共管账户划转相应金额的风险准备金,以补平上述差额。

② 代偿准备

a. 在保本周期到期日前 30 个日历日当日,如甲方预测保本周期的到期日甲方可能依据《基金合同》的约定承担保本责任,且乙方可能依据本合同承担保证责任的,则甲方应在首份及其后的《保本到期前报送信息》中同时向乙方书面通知经预测的需要乙方代偿的金额,提示乙方准备资金;

b. 在保本周期到期日后十个工作日内,甲方不能全额履行保本义务,则甲方

应将保本周期到期日的基金资产累计净值、经计算得出的应向基金份额持有人支付的金额、已自行偿付的金额以及需乙方代偿的金额向乙方发出书面《履行保证责任通知书》。《履行保证责任通知书》的格式和内容见附件。

2) 偿付顺序

在保本周期到期日，如根据《基金合同》甲方需承担保本责任，且根据本合同乙方需要承担保证责任的，则保本差额部分按照下列顺序偿付：

①基金合同第 6.1.1 (3) (即上文“①保本偿付准备”的 c 项) 约定的共管帐户内的风险准备金；

②甲方的自有资金；

③乙方资金。

乙方在接到甲方书面《履行保证责任通知书》及相关数据资料后五个工作日内一次性将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的资金结算账户，而不得对甲方调度自有资金的情况及方式提出异议，乙方对相关基金份额持有人的保证责任即视为履行完毕，代偿款项的分配与支付由甲方负责。

(3) 基金份额持有人追偿的权利及其程序、方式

在担保人逾期未能履行保证责任的情况下，基金份额持有人在保证期间内有权委托基金管理人代表基金份额持有人要求乙方按照基金合同的约定履行保证责任。

2、基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意《保证合同》中的约定。

(三) 担保费用及支付方式

担保人为本基金提供保证收取的担保费用不从基金财产中列支。担保费用的费率由基金管理人与担保人协商确定，并以基金管理人的自有资金承担。

担保费从基金管理人收取的本基金管理费中列支，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的 2 个工作日内向担保人支付担保费。基金当期保本周期到期转下一保本周期的过渡期内，即申购限定期，基金管理人支付担保费。

每日担保费=担保费计提日前一日基金资产净值×0.2%×1/当年日历天数

在法律法规允许的前提下，基金管理人依法履行适当程序后，担保费可从基金财产中列支。

（四）担保的性质和担保范围

本基金保本担保的范围为：

在保本周期到期时，符合条件的基金份额持有人持有当期保本周期到期的基金份额的可赎回金额加上当期保本周期内本基金的累计分红金额，低于投资净额时的差额部分。符合条件的基金份额持有人，对于第一个保本周期而言是指在本基金的募集期间认购本基金的基金份额持有人，对于第一个保本周期后各保本周期而言是指在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人。

担保为本基金第一个保本周期承担的连带责任保证的金额最高不超过 51 亿元人民币。本基金第一个保本周期后各保本周期的担保人、担保方式及担保额度，由基金管理人在当期保本周期开始前公告。

（五）影响担保人担保能力情形的处理

保本周期内，担保人出现足以影响其履行《保证合同》项下担保责任能力的情形的，应在该情形发生之日起 3 日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人应在在接到通知之日起 3 个工作日内将上述情况报告中国证监会并提出处理办法，包括但不限于加强对担保人担保能力的持续监督、及时提取风险准备金、当确定担保人已丧失继续履行担保责任能力或歇业、停业、被吊销企业法人营业执照、宣告破产的情况下应根据基金合同约定的程序更换担保人等。基金管理人还应在同时通知基金托管人并在接到通知之日起 3 个工作日内在指定媒体上公告上述情形。确定担保人已丧失保证能力的，基金管理人应在 15 个工作日内召集基金份额持有人大会，就如下事项进行表决：

- 1、更换担保人；
- 2、变更基金类别；
- 3、《基金合同》终止；
- 4、法律法规或中国证监会规定的其他事项。

（六）担保人的更换

保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，但因担保人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义务的除外。更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任

的担保人承担。在新的担保人接任之前，原担保人应继续承担担保人责任。某一保本周期结束后，基金管理人有权更换下一保本周期的担保人，更换后的担保人为本基金下一保本周期提供的担保不得影响基金份额持有人在基金合同项下享有的保本条款，此项变更无需召开基金份额持有人大会决议通过。

保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。

保本周期内更换担保人的程序：

1、提名

新任担保人由基金管理人提名。

基金管理人提名的新任担保人必须符合如下条件：（1）具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件；（2）符合基金份额持有人的利益。

2、决议

基金份额持有人大会对被提名的新任担保人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 1/2 以上（含 1/2）表决通过。

3、备案

基金份额持有人大会选任新任担保人的决议须经中国证监会备案生效后方可执行。

4、签订《保证合同》

更换担保人经中国证监会核准后，基金管理人与新任担保人签订《保证合同》。

5、公告

基金管理人在中国证监会核准后 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。

6、交接

原担保人职责终止的，原担保人应妥善保管保本周期内保证业务资料，及时向基金管理人和新任担保人办理保证业务资料的交接手续，基金管理人和新任担保人应及时接收。

保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权

利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前，原担保人应继续承担保证责任。

（七）担保人免除保证责任的情形

除本节第（六）款所指的担保人承担的所有与本基金担保相关的权利义务由继任的担保人承担的情况以及本节第（二）款第 1 项《保证合同》主要内容的“除外责任”所列明的免责情形外，不得免除担保责任。

保本周期届满时，担保人同意继续为本基金提供担保或基金管理人认可的其他机构继续为本基金的保本提供连带责任保证或者风险买断担保或者中国证监会认可的其他担保方式，同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的，本基金将转入下一保本周期；否则，本基金变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，担保人不再为本基金承担担保责任。

（八）担保责任的履行

基金份额持有人同意授权基金管理人作为其代理人代为行使向担保人索偿的权利并办理相关的手续(包括但不限于向担保人发送履行担保责任的书面通知及代收相关款项等)。如果符合第九节第（二）款“适用保本条款的情形”的基金份额在保本周期到期日的可赎回金额加上其在当期保本周期内的累计分红金额之和低于其投资净额的，且基金管理人无法全额履行保本义务的或基金管理人不承担保本义务的，基金管理人在保本周期到期日后五个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》(应当载明需担保人代偿的金额)。担保人将在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的五个工作日内，将需代偿的金额划入本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人将该差额支付给基金份额持有人。若担保人未履行全部或部分保证责任的，基金份额持有人有权直接就差额部分向担保人追偿。担保人将代偿金额全额划入本基金在基金托管人处开立的账户中后即为全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。代偿款的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

十、基金的投资

本基金在当期保本周期内或保本周期到期自动转为下一保本周期，基金的投资适用如下约定：

（一）投资目标

依据本基金的保证合同，本基金通过运用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争在本基金保本周期结束时，实现基金资产的收益增长。

（二）投资范围

本基金的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）、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（包括一级、二级市场股票）资产占基金资产的比例不高于 30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产（包括国债、央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）占基金资产的比例不得低于 70%，其中现金或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%。

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）投资理念

严格有效的风险控制是实现稳健收益的前提。

（四）投资策略

本基金投资策略突出强调配置的科学性与纪律性，通过严格金融工程手段有效控制风险，保证实现投资期中的稳定收益，并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。

1、资产配置及保本策略

（1）资产配置策略

科学合理的资产配置是实现稳健保本投资目标的基础。本基金将按照恒定比例组合保险机制将资产配置于安全资产与风险资产。本基金投资的安全资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）、货币市场工具和现金资产。本基金投资的风险资产为股票（包括一级、二级市场股票）资产。

在基金实际管理过程中，基金管理人将根据宏观经济和证券市场的阶段性变化，在投资组合比例范围内，适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例。因此，本基金资产配置策略分为两个层次：一层是对风险资产和安全资产的资产配置，该层次以资产管理优化恒定比例组合保险策略（CPPI）为依据；另一层是对风险资产的资产配置策略。

（2）保本技术及策略

本基金采用固定比例组合保险（CPPI）的保本投资策略，即用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损，并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。

采用核心 CPPI 策略的目标是控制风险类资产的投资比例，确保本基金组合价值线的增长，从而实现稳健的收益目标。当以股票市场为代表的风险类资产上涨的过程中，分享风险资产上涨的收益，带动组合价值线的增长；当风险类资产下跌的过程中，控制风险，快速止损，保持前期收益成果。

本基金所采用的核心 CPPI 策略是应用 CPPI 基础上通过变动投资安全垫、主动投资策略中情景预测等先进的技术，创新性为本基金组合设计了独特的改进型组合保险策略。

改进后的组合保险策略的基本公式为：

$$RA_t = k \times m \times (AN_t - F_t)$$

其中： RA_t 是在 t 期组合可以投资于风险资产的最大投资金额； AN_t 为 t 期期初的组合资产净值； F_t 是 t 期期初的防守垫金额； k 是情景调整系数（调整范围为 0-1），与当期市场状况有关系； m 是动态风险配置系数放大倍数，与组合资产在当期可能面临的最大损失有关系。

在风险资产和安全资产的配置上，本基金通过对远期利率、市场价格及趋势等参数的预测，计算风险资产组合中不同类属资产可能发生的最大亏损，据此得到不同类属资产的可放大倍数。根据风险资产投资的盈亏状况，动态调整风险资产和安全资产的权重。

依照 CPPI 投资策略主要有三点关键点：

①安全资产的确定

在 CPPI 中，安全资产在保本周期末需要有确定的现金流。在实际投资中，有确定现金流的安全资产最好是选用剩余期限与保本周期相匹配的高信用等级零息票据，如零息国债。对于认购期以后投资者追加的申购资金，将投入剩余期限与保本周期剩余期限相匹配的三年期债券。

②放大倍数的确定

在 CPPI 中，安全垫是风险资产可承受的最高损失限额，因此风险资产变现时所能承担损失的比例上限是放大倍数的倒数。在本基金的投资中，本基金管理人将着重考察保本周期内的市场中长期走势，根据市场的中长期态势，适度调整安全垫中长期的放大倍数。在市场处于弱市时，辅以提高安全垫以控制基金风险，确保基金保本目标的实现。

③安全垫放大倍数的维持

根据 CPPI 策略，只有当安全垫的放大倍数在一定时间内保持恒定，才能保证在安全垫减少至零时，风险资产的数量也能按需要同时减少至零，以保证基金的本金安全。在本基金的实际投资中，为维持风险资产与安全垫的放大倍数，基金管理人对风险资产与安全资产的比例进行定期调整而不是随时调整，同时管理人还将根据这种调整可能造成的交易费用与冲击成本，设立调整阈值，根据调整阈值来确定调整的最佳时点，以降低交易费用。

在市场可能发生剧烈变化时，本基金管理人对基金安全垫的中长期放大倍数进行调整，调整的时间间隔将比日常安全资产与风险资产比例调整的时间间隔长，这样一方面保证基金能够有充足的时间间隔实现“恒定比例”的投资组合保险策略，另一方面，本基金管理人又能根据对市场中长期态势的判断来决定是否该减小或增大放大倍数。

3、股票投资策略

本基金在构造股票组合时，采取自上而下的方法，定量分析与定性分析相结合，通过组合管理有效规避个股的非系统性风险，通过行业精选确定拟投资的优势行业及相应比例，通过个股选择，挖掘具有突出成长潜力且被当前市场低估的上市公司。

股票选择标准：

1) 建立以行业基本面、上市公司基本面、行业二级市场相对投资价值、分

析师建议等因素为基础的多因素行业综合评估模型,对各行业的超额收益潜力进行打分和排序,初步确定当期拟进行投资的优势行业;

2) 建立成长企业甄别模型,选出优势行业中具有可持续成长性的上市公司;

3) 建立成长企业相对定价模型,对潜力公司进行相对价值评估,根据相对价值排序确定股票投资组合的初选方案;

4) 对初选股票组合中上市公司的财务结构、市场表现进行细致分析,结合上市公司调研等手段确定最终的股票组合。

此外,本基金谨慎参与一级市场股票首发和增发,以获得一、二级市场之间的利润。

4、债券投资策略

在债券投资方面,通过投资于剩余期限与避险周期基本匹配的债券,规避利率、收益率曲线、再投资等各种风险,控制企业债信用风险,并注重利用市场时机、无风险套利、利率预测以及低估值等策略,获取债券投资收益。

(1) 利率策略

利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。根据对市场利率水平的变化趋势的预期,可以制定出组合的目标久期,预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。

通过全面研究宏观经济运行,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略。

(2) 类属策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行,货币市场及资本市场资金供求关系以及不同时期市场投资热点,分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

(3) 信用策略

信用策略主要是分析企业债券发行人所处行业发展前景,发行人业务发展状

况，企业市场地位，财务状况，管理水平，债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险。根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券的信用风险利差。对企业债券信用级别的研判与投资，主要是发现信用风险利差上的相对投资机会，而不是绝对收益率的高低。

（4）选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

5、可转债投资策略

本基金运用国际普遍使用的二叉树模型计算可转债所含期权的价值，结合该可转债的债券价值对可转债进行相对价值评估，根据本溢价率排序和行业资金配置情况确定最终的可转债投资组合。

（五）有关保本技术及投资管理的测算举例

首先，按照组合保险策略，在战略性债券资产配置的基础上，计算初始防守垫（价值线）的底线。其次，在股票配置策略指导下，在模拟组合 VaR 测算的基础上，运用组合保险策略计算风险资产的配置比例。

CPPI 组合保险技术策略的模型如下：

$RA_t = k \times m \times (AN_t - F_t)$ 。其中 $m \times (AN_t - F_t)$ 由金融工程小组根据组合情况自动计算给出，而最终风险资产投资额度 RA_t 则由投决会根据市场状况确定情景调整系数 k 形成风险授权额度，其中 k 在（0—1）的范围内可调。

根据上述策略进行简单计算举例如下：

假如保本基金的初始总资产为 $An=50$ 亿元，安全性资产比例 Sa （债券），假设未来安全资产（债券）收益率为 $r=3\%$ ，则三年的总收益率为 $3 \times r=9\%$ ；

根据 Var 测算，风险性资产比例 Ra （股票）的最大可能性损失为 50%，则其放大系数 $m=1/0.5=2$ ；如将安全性资产的未来收益部分投入的风险性资产中来，则风险性资产的可投的比例为 $Ra=Sa \times 9\% \times 2=Sa \times 18\%$ ；由于 $Sa+Ra=1$ ， $Sa+Sa \times 18\%=1$ ，则安全性资产比例为 $Sa=1/(1+18\%)=84.7\%$ ，风险资产的比例为 $Ra=1-Sa=15.3\%$ 。

安全垫 $Ft=An \times (1-Ra \times 50\%)=50 \times 92.5\%=46.18$ 亿。因此，当 k 值为 1 时，

我们初试的资产配置为：

风险性资产（股票） $RA=k \times m \times (Ant-Ft)=1 \times 2 \times (50-46.18)=7.65$ 亿元；

安全性资产（债券） $SA=50-RA=42.35$ 亿元；

从上述举例测算中，我们初始投资为 42.35 亿债券资产，7.65 亿股票资产，另根据当时市场情况及投资委员会的建议可用 K 值（0-1）对风险性资产进行调整以更加安全保护本金的安全。

（六）业绩比较基准

3 年期银行定期存款税后收益率

本基金是保本型基金产品，保本周期为 3 年。以基金合同成立日所在年度的中国人民银行公布的 3 年期银行定期存款基准利率的税后收益率为计算基准。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后变更本基金业绩比较基准并及时公告。

（七）风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。

（八）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （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）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、

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、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

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) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%；

(3) 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%；

(4) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%；

(5) 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%；

(6) 本基金持有的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%；

(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；

(10) 本基金不投资于权证，若转型为非保本其他类型基金时，则遵循转型后的基金组合对于投资权证所约定的相关限制；

(11) 本基金投资于股票（包括一级、二级市场股票）资产占基金资产的比例不高于 30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产（包括国债、央行票据和公司债、企业债、金融债、短期融资券、资产支持证券等）占基金资产的

比例不得低于 70%；

(12) 本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的流通受限证券，且投资流通受限证券的锁定期不得超过当期保本周期的剩余存续期；

(13) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(九) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

(十) 基金投资组合报告

基金投资组合报告数据摘自本基金2011年第3季度报告（以下简称“本报告”）。

基金管理人长盛基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告所载数据内容自2011年7月1日起至2011年9月30日止。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的
----	----	-------	---------

			比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	846,230,546.21	33.04
	其中：债券	846,230,546.21	33.04
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	957,909,496.86	37.40
	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	748,594,610.71	29.23
6	其他资产	8,324,404.68	0.33
7	合计	2,561,059,058.46	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	37,073,600.00	1.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,390,000.00	3.85
	其中：政策性金融债	98,390,000.00	3.85
4	企业债券	204,291,396.21	8.00
5	企业短期融资券	457,963,000.00	17.94
6	中期票据	-	-
7	可转债	48,512,550.00	1.90
8	其他	-	-
9	合计	846,230,546.21	33.15

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110245	11 国开 45	1,000,000	98,390,000.00	3.85
2	126011	08 石化债	546,670	48,926,965.00	1.92
3	110015	石化转债	555,000	48,512,550.00	1.90
4	126003	07 云化债	367,230	34,519,620.00	1.35

5	115003	中兴债1	368,040	34,411,371.96	1.35
---	--------	------	---------	---------------	------

6、报告期末按公允价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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期末未持有股票投资。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,797,313.60
5	应收申购款	27,091.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,324,404.68

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	48,512,550.00	1.90

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

若本基金保本周期到期后变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基

金”，则基金的投资适用如下约定：

（一）投资目标

积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会，在控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。

（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）、债券、货币市场工具、权证、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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-95%；其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议等）、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证券品种占基金资产的 0%-40%，其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

（三）投资策略

在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，以谋求行业配置的超额收益。

1、资产配置

对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中，本基金管理人采用经济周期资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。

2、行业配置

不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的

潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会。

具体操作中，首先考察各行业历史收入和利润增长表现，对未来行业收入增长率和行业平均利润增长率进行预测；然后对行业的综合表现和增长空间进行评估和排序，挑选出未来一段时间内最具增长前景的行业。具体评估将从宏观经济环境、行业景气度分析和预测、行业财务状况和行业竞争力综合表现四个方面入手，采用定性分析结合定量分析的方法对行业的未来的增长前景进行综合评价。

最后，在完成对行业增长预测和行业综合评价基础上，通过市场及各个行业的相对和绝对估值水平 PE、PB 等数据的横向、纵向分析，进行估值比较，并跟踪各行业的资金流向、机构持仓特征等判断行业吸引力，动态把握行业板块轮换蕴涵的投资机会。

3、股票选择

本基金综合运用长盛行业股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，前述优势行业中股票优先入选。具体分以下两个层次进行股票挑选：

(1) 品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理上符合基本要求的上市公司，构建备选股票池，主要筛选指标包括：盈利能力指标(如 PE、PCF、PB 等)、经营效率指标(如 ROE、ROA 等)和财务状况指标等。

(2) 价值评估

本基金在前述优势行业选择体系的基础上，根据下述标准挑选出其中具有投资潜力的上市公司构建核心股票池：

- ①公司治理结构良好，管理规范，信息透明，无违规行为；
- ②公司主营业务鲜明，盈利能力强，收入和利润稳定增长；
- ③公司具有优良的成长性，不断增长或改善的优质公司；
- ④公司财务状况良好，具备规模优势和较好的抗风险能力；
- ⑤公司在产品、技术方面具有核心竞争优势，处于行业龙头。

对上述核心股票池中的重点上市公司进行内在价值评估和成长性研究，在明确的价值评估基础上选择定价相对合理且成长性可持续的投资标的。

4、债券投资策略

在债券投资方面，本基金的债券投资采取主动的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券组合。在具体操作中，本基金运用久期策略、期限结构策略、类属策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

5、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

6、资产支持证券的投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（五）业绩比较基准

该混合型基金的整体业绩比较基准采用：

60%×沪深 300 指数+40%×中证全债指数

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人将视情况调整本基金的业绩评价基准，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

（六）风险收益特征

该基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

（七）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（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) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

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) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (3) 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%；
- (4) 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 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，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%。
- (5) 现金或者到期日不超过 1 年的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%；
- (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%；
- (8) 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%；

(9) 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%；

(10) 本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；

(11) 本基金股票资产占基金资产的 40%-95%；债券、货币市场工具（包括一年以内的短期国债、回购协议等）、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证券品种占基金资产的 0%-40%；

(12) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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。

基金管理人应当自本基金变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”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。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(八) 基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

十一、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	同期业绩比较基准收益率超额收益率
2011 年 5 月 24 日 (基金合同生效日) -2011 年 9 月 30 日	0.6%	1.69%	-1.09%

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

十二、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、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 7、基金的资金汇划费用及开户费用；
- 8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.2% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 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。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。

在保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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。

3、本基金当期保本周期到期转下一保本周期的过渡期内，即申购限定期，不收取基金管理费和基金托管费。

4、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法同上。

5、本条第（一）款第 3 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十三、保本周期到期

（一）保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一个保本周期，下一保本周期的起始日一般为上一保本周期到期日后，下一保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准；

如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”。同时，变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的基金投资及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人协商一致后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后公告，并在更新的招募说明书中予以说明。

如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将根据本基金合同的规定终止。

（二）保本周期到期的处理规则

1、在本基金保本周期到期日前的到期赎回限定期内，基金份额持有人可以做出如下选择，其持有当期保本周期到期的基金份额都适用保本条款：

（1）在到期赎回限定期内赎回其持有当期保本周期到期的基金份额；

（2）在到期赎回限定期内将其持有当期保本周期到期的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金。

2、本基金保本周期到期日后，基金份额持有人未选择赎回或转换转出的，按以下两种情形处理，且其持有当期保本周期到期的基金份额都适用保本条款：

（1）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人持有的基金份额将根据届时基金管理人的公告自动转入下一个保本周期；

（2）保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人所持有的本基金基金份额默认转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的基金份额。

3、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人（对于第一个保本周期而言）、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人（对于第一个保本周期后的各保本周期而言），在到期赎回限定期内选择赎回或者转换转出的，均无需支付赎回费用、基金间转换费用（基金间转换费用包括转出基金的赎回费用和

转入基金的申购费补差，下同)。

在当期保本周期开始后申购的或转换转入的基金份额，不适用到期赎回限定期的条款。基金份额持有人就其在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额选择赎回时，需支付赎回费用；选择基金间转换时，按规定支付基金转换费用，其赎回费或基金间转换费用按照招募说明书或相关公告规定的费率确定，其持有时间以该份额在注册登记机构的注册登记日开始计算。

在折算日登记在册的基金份额(包括投资者进行过渡期申购的基金份额和上一保本周期结束后默认选择转入下一保本周期的持有人所持有的基金份额)转入下一保本周期时，无需支付费用。

如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定，变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”。基金份额持有人在保本周期到期时持有的基金份额(包括持有当期保本周期到期的基金份额和在当期保本周期内申购和转换转入的基金份额)在保本周期到期后默认转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的基金份额的，无需再支付转换费用。

(三) 保本周期到期选择的时间约定

本基金保本周期到期前，基金管理人将提前公告并提示基金份额持有人作出到期选择申请。

在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中，由基金管理人指定在当期保本周期结束前5个工作日内至当期保本周期到期日(含当期保本周期到期日)的一段期间为到期赎回限定期。基金份额持有人在到期赎回限定期内将在当期保本周期内持续持有的基金份额进行赎回或转换为基金管理人管理的其他基金的，视为持有到期，无需支付赎回费用、基金间转换费用，其赎回日或转换日为当期保本周期到期日。到期赎回采取“未知价”原则，基金份额持有人可赎回金额或转出金额以基金份额持有人实际赎回日或转换日当日的本基金基金份额净值为基准进行计算。基金份额持有人可按持有当期保本周期到期赎回日或转换日当日基金份额的可赎回金额加上当期保本周期内的累计分红金额低于保本额的差额(即保本赔付差额)享有保本利益。当期保本周期到期日之后的净值下跌风险应由基金份额持有人自行承担。

（四）保本周期到期的保本条款

1、基金份额持有人对于其在本基金募集期认购本基金并持有第一个保本周期到期的基金份额、在本基金过渡期限定期限内申购并持有当期保本周期到期的基金份额以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期并持有当期保本周期到期的基金份额，无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、默认选择转入下一个保本周期或是继续持有变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，均适用保本条款。

2、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，若在当期保本周期的到期赎回限定期内选择赎回基金份额、转换基金份额或继续持有基金份额，而可赎回金额加上当期保本周期内的累计分红金额低于其投资净额，基金管理人或担保人应补足该金额差额。

3、若本基金保本周期到期后不符合保本基金存续条件，在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人，若继续持有基金份额，其持有的基金份额转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的基金份额，而可赎回金额加上当期保本周期期间的累计分红金额低于其投资净额，基金管理人或担保人应补足该金额差额。

（五）下一保本周期基金资产的形成

1、过渡期和过渡期申购

在公告的到期处理规则中，基金管理人指定在当期保本周期到期后，即当期保本周期到期日至下一保本周期开始之前不超过15个工作日的一段期间的过渡期作为进行申购限定期限。

投资者在申购限定期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在申购限定期限内，投资者转换入本基金基金份额，视同为过渡期申购。投资者进行的过渡期申购，其投资净额适用下一保本周期的保本条款。

（1）基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

（2）过渡期申购采取“未知价”原则，即过渡期申购价格以申请当日收市

后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。

(3) 投资者进行过渡期申购的，其持有相应基金份额至过渡期最后一日（含该日）期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

(4) 过渡期申购费率

本基金过渡期申购费率如下：

过渡期申购金额(含申购费)	费率
$M < 50$ 万	0.8%
$50 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$	0.5%
$200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	0.2%
$M \geq 500 \text{ 万}$	1000 元/笔

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(5) 过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告。

(6) 过渡期内，基金管理人应使基金财产尽量保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

2、下一保本周期基金资产的形成

(1) 持有到期的基金份额

如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额可赎回金额加上相应基金份额的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

对于投资者认购或者在保本周期内申购、转换入的基金份额，选择或默认选择转入下一保本周期的，转入下一保本周期的转入金额等于选择或默认选择转入下一保本周期的相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值。

(2) 过渡期申购的基金份额

对于投资者过渡期申购的基金份额，转入下一保本周期的转入金额等于相应基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值。

3、基金份额折算

下一保本周期开始日的前一工作日为折算日。对在折算日登记在册的基金份

额持有人所持有的基金份额(过渡期申购的持有人所持有的基金份额和上一个保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的持有人所持有的基金份额),将以折算日的基金估值为基础,在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下,变更登记为基金份额净值为 1.000 元的基金份额,其持有的基金份额数额按折算比例相应调整。具体折算规则由基金管理人通过到期处理规则进行公告。

4、下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日,本基金进入下一保本周期运作。

本基金进入下一保本周期后,仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务,下一保本周期的日常申购按本基金合同有关约定执行。投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换入本基金基金份额的,相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。

(六) 转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”资产的形成

保本周期届满时,若本基金依据基金合同的规定转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”:

1、在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本周期到期时默认选择转入当期保本周期的持有人,如果其持有当期保本周期到期的可赎回金额加上当期保本周期期间的累计分红金额高于其投资净额,则按可赎回金额作为转入变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的转入金额;

如果持有到期的可赎回金额加上保本周期期间的累计分红金额低于其投资净额,则按投资净额(扣除已分红款项)为转入金额转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”基金份额。

2、在保本周期内申购本基金的基金份额持有人,如果继续持有本基金而转为变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”,则按可赎回金额作为转入变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的转入金额。

3、变更后的“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”申购的具体操作办

法由基金管理人提前公告。

（七）保本周期到期的公告

1、保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，保本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续、持有人到期选择及转入下一个保本周期前的过渡期申购等相关事宜进行公告。

2、保本周期届满时，在不符合保本基金存续条件下，保本基金将变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”的更新招募说明书中公告相关规则。

3、基金管理人可以修改相关规则，并将在临时公告或更新的招募说明书中公告。

4、在保本周期到期前，基金管理人还将进行提示性公告。

（八）保本周期到期的赔付

发生赔付的具体操作细则由基金管理人依据基金合同和与担保人所签署的合同约定提前公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

（一）在“重要提示”中，明确了更新的招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

（二）在“第三节 基金管理人”中，更新了基金管理人的相关基本情况。

（三）在“第四节 基金托管人”中，更新了基金托管人的相关基本情况。

（四）在“第五节 相关服务及担保机构”中，更新了相关服务及担保机构的有关信息。

（五）在“第六节 基金的募集”中，更新了基金募集的相关内容。

（六）在“第七节 基金合同的生效”中，更新了基金合同生效的相关

内容。

（七）在“第八节 基金份额的申购与赎回”中，增加了本基金开放申购与赎回的时间。

（八）在“第十节 担保”中，更新了担保人的相关信息。

（九）在“第十一节 基金的投资”中，增加了“（十）基金投资组合报告”的相关内容。

（十）增加了“第十二节 基金的业绩”的相关内容。

（十一）在“第二十四节 对基金份额持有人的服务”中，更新了相关内容。

（十二）增加了“第二十五节 其他应披露的事项”的相关内容。

十五、 签署日期

本招募说明书（更新）于2011年12月15日签署。

长盛基金管理有限公司

二〇一一年十二月二十一日

附件一、《保证合同》

《保证合同》内容详见本招募说明书正文。

附件二、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金保函》

《长盛同鑫保本混合型证券投资基金保函》内容详见本招募说明书正文。