

## 长盛量化红利策略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：中国工商银行股份有限公司

### 重要提示

本基金由基金管理人经中国证券监督管理委员会 2009 年 9 月 10 日证监许可[2009]927 号文核准募集。本基金的基金合同于 2009 年 11 月 25 日正式生效。

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预示其未来表现。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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。基金投资人自依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的承认和接受，并按照《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》、《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人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。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2016 年 5 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金合同生效的日期

2009年11月25日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼10D

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：高新

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26日成立，注册资本为人民币18900万元。截至目前，基金管理人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%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。截至2016年5月25日，基金管理人共管理四十五只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

高新先生，董事长，管理工程硕士。曾担任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券营业部经理，安徽国元信托投资有限责任公司总经理助理，上海安申投资管理公司总经理，国元证券有限责任公司投资银行总部总经理、总裁助理、副总裁，国元证券股份有限公司副总裁。

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，国元证券股份有限公司董事、总裁、党委副书记。现任国元证券股份有限公司董事长、党委书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任

公司党委委员、国元证券（香港）有限公司董事长、安徽安元投资基金有限公司董事长。

钱力先生，董事，博士。曾任安徽省政府办公厅综合调研室干部、科员、副主任科员、一处副主任科员、主任科员、秘书一室主任科员、副调研员、副主任，安徽省政府金融工作办公室处长、综合处处长、副主任、党组成员，淮南市政府副市长。现任安徽省信用担保集团有限公司总经理、党委副书记。

陈翔先生，董事，硕士。曾任安徽省六安行署办公室秘书、副科长、科长、副主任，安徽省政府办公厅综合调研室助理调研员、副主任、调研员，安徽省政府办公厅一处处长、助理巡视员兼秘书一室主任、副主任、党组成员，安徽省政府副秘书长、安徽省政府办公厅党组成员，安徽省委统战部副部长、安徽省工商联党组书记、第一副主席、安徽省委非公有制经济和社会组织工作委员会副书记。现任安徽省投资集团控股有限公司董事长、党委书记。

葛甘牛先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括所罗门兄弟公司、瑞士信贷第一波士顿银行（香港）有限公司、美林集团、德意志银行、荷兰银行、中银国际控股有限公司、瑞士信贷银行股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司。现任星展银行（中国）有限公司董事、行长/行政总裁。

陈健元先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括高盛（亚洲）有限责任公司、巴克莱银行。现任星展银行（香港）有限公司董事总经理兼北亚洲区私人银行业务主管。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。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，兼任长盛基金（香港）有限公司董事长。

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，博士，公共政策讲座教授。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、香港浸会大学工商管理学院院长。现任香港教育学院校长、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。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，学士，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，武汉大学商学院博士生导师，中国科技大学兼职教授，安徽省政府决策咨询专家委员会委员，全国马经史学会理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会副会长。

周放生先生，独立董事，在职研究生毕业。曾任国家国有资产管理局副处长、处长，国有资产管理研究所副所长，国家经贸委国有企业脱困工作办公室副主任，财政部财政科学研究所国有资产管理研究室主任，国务院国资委企业改革局副巡视员。现任中国企业改革与发展研究会副会长，中国外运股份有限公司独立监事，恒安国际集团有限公司独立董事，北京北斗星通导航技术股份有限公司独立董事，中航光电科技股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

陈新先生，监事会主席，硕士，经济师。曾担任交通银行淮南分行信贷员，安徽省国债服务中心投资副经理，香港黄山有限公司投资业务经理，国元证券有限责任公司投资管理总部总经理、总裁助理、副总裁。现任国元证券股份有限公司副总裁，兼公司董事会秘书，同时兼任国元期货有限公司董事，国元股权投资有限公司董事，国元证券（香港）有限公司董事，安徽安元投资基金有限公司监事会主席。

吴达先生，监事，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，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，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。现任长盛基金管理有限公司国际业务部总监，长盛环球景气行业

大盘精选混合型证券投资基金基金经理，兼任长盛基金（香港）有限公司副总经理，长盛创富资产管理有限公司总经理。

魏斯诺先生，监事，英国雷丁大学硕士。历任中国人寿资产管理有限公司投资组合经理、高级组合经理，合众资产管理有限公司组合管理部总经理。2013年7月加入长盛基金管理有限公司，现任社保业务管理部总监，社保组合组合经理。

### 3、管理层成员

高新先生，董事长，管理工程硕士。同上。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

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，特许另类投资分析师 CAIA。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，兼任长盛基金（香港）有限公司董事、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。

林培富先生，上海财经大学经济学硕士。曾任安徽省信托投资公司国际业务部科长、副经理、投资银行总部副经理、经理，国元证券有限责任公司基金公司筹备组负责人。2005年1月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司总经理助理。现任长盛基金管理有限公司副总经理，兼任人力资源部总监、长盛基金（香港）有限公司董事、长盛创富资产管理有限公司执行董事。

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，曾任基金经理助理、长盛动态精选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、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理、长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理、长盛

同德主题增长混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，权益投资部总监，社保组合组合经理，长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理。

蔡宾先生，中央财经大学硕士，特许金融分析师 CFA。历任宝盈基金管理有限公司研究员、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，长盛积极配置债券基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理。

#### 4、本基金基金经理

王超先生，1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。自 2011 年 12 月 6 日起任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 1 月 5 日起兼任长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，自 2015 年 4 月 27 日起兼任长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 5 月 22 日起兼任长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2015 年 6 月 16 日起兼任长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，自 2015 年 6 月 18 日起兼任长盛量化红利策略混合型证券投资基金（本基金）基金经理。

本基金历任基金经理：刘斌先生，2009 年 11 月 25 日至 2013 年 11 月 4 日任本基金基金经理；翟彦垒先生，2013 年 8 月 30 日至 2015 年 6 月 18 日任本基金基金经理。

（本招募说明书基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。）

#### 5. 投资决策委员会成员

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

王宁先生，副总经理，EMBA。同上。

蔡宾先生，副总经理，中央财经大学硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

吴达先生，监事，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

魏斯诺先生，监事，英国雷丁大学硕士。同上。

刘旭明先生，清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，现任研究部总监，长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

#### （二）主要人员情况

截至 2016 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 198 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安

全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 555 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013 年七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2014 年中国工商银行资产托管部第八次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。



## 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

## 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

## 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每

位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### **四、相关服务机构**

##### **(一) 基金份额发售机构**

###### **1、直销机构**

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：张晓丽、吕雪飞

###### **2、代销机构**

###### **(1) 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

办公地址：中国北京复兴门内大街55号

法定代表人：易会满

联系人：杨菲

电话：010-66107909

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(2) 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

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：王洪章

联系人：王未雨

电话：010-67596220

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(3) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

联系人：宋府

电话：010-66594904

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(4) 中国农业银行股份有限公司

住所：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：刘士余

联系人：唐文勇

电话：010-85106055

传真：010-85109219

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：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

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195050

客户服务电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(6) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(7) 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

联系人：王继伟

电话：010-58560666

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(8) 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

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

联系人：王者凡

电话：010-85238890

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

公司网址：[www.hxb.com.cn](http://www.hxb.com.cn)

(9) 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

办公地址：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：常振明

联系人：廉赵峰

电话：010-65557053

传真：010-65550981

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

(10) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号

法定代表人：李国华

联系人：王硕

电话：010-68858096

传真：010-68858057

客户服务电话：95580

公司网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

(11) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：姚磊

电话：021—61614467

传真：021—63604199

客户服务电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（12）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号中山大厦

办公地址：上海市江宁路168号兴业大厦9楼

法定代表人：高建平

联系人：李博

电话：021—52629999

传真：021—62569070

客户服务电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

（13）广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：李立

电话：020-38321739

传真：020-87311780

客户服务电话：400-830-8003

公司网址：www.cgbchina.com.cn

（14）大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路88号

办公地址：大连市中山区上海路51号

法定代表人：陈占维

联系人：李格格

电话：：0411-82356627

传真：0411-82356590

客户服务电话：400-664-0099

公司网址：www.bankofd1.com

（15）包商银行股份有限公司

注册地址：内蒙古包头市钢铁大街6号

办公地址：内蒙古包头市钢铁大街6号

法定代表人：李镇西

联系人：刘芳

电话：：0472-5189051

传真：0472-5189051

客户服务电话：96016(内蒙、北京)，967210(深圳、宁波)，65558555(成都)

公司网站：www.bsb.com.cn

（16）徽商银行股份有限公司

注册地址：合肥安庆路79号天徽大厦A座

办公地址：合肥安庆路79号天徽大厦A座

法定代表人：李宏鸣

联系人：叶卓伟

电话：0551-62667635

传真：0551-62667684

客服电话：4008896588（安徽省内可直拨96588）

公司网站：www.hsbank.com.cn

（17）星展银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号1301、1801单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号1301、1801单元

法定代表人：葛甘牛

联系人：程芳夷/吴欣莹

电话：021-38525985/021-38968359



传真：021-38968995

客服电话：400-820-8988

公司网站：www.dbs.com.cn

（18）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

客户服务电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

（19）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451958

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

（20）财通证券股份有限公司

注册地址：杭州杭大路15号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：0571-87822359

传真：0571-97918329

客户服务电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

公司网址：www.ctsec.com

(21) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000, 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

(22) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人：姚文平

联系人：朱磊

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

(23) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

办公地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：(0755) 23838750

传真：(0755) 23838701

客户服务电话：400-888-1888

公司网址：www.fcsc.com

(24) 东北证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：安岩岩

电话：400-600-0686

传真：（0431）85096795

客户服务电话：400-600-0686

公司网址：www.nesc.cn

（25）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

电话：95531、400-8888-588

传真：（021）50498825

客户服务电话：95531、400-8888-588

公司网址：www.longone.com.cn

（26）东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客户服务电话：4008888993

公司网址：www.dxzq.net

（27）东莞证券股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼

法定代表人：张运勇

联系人：乔芳

电话：0769-22100155

传真：0769-22119426

客户服务电话：0769-961130

公司网址：www.dgzq.com.cn

（28）方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

客户服务电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

（29）光大证券股份有限公司

注册地址：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：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

客户服务电话：95525 4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

（30）广发证券股份有限公司

注册地址：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：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、  
42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：95575或致电各地营业网点

客户服务电话：95575或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

(31) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

(32) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(33) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客户服务电话：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(34) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(35) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：芮敏祺

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

客户服务电话：95521

公司网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(36) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(37) 国元证券股份有限公司

注册地址：合肥市寿春路179号

办公地址：合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

联系人：祝丽萍

电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

传真：（0551）2272100

客户服务电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

公司网址：www.gyzq.com.cn

（38）海通证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：李笑鸣

电话：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客户服务电话：400-8888-001、（021）962503

公司网址：www.htsec.com

（39）红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

联系人：高国泽

电话：0871-3577946

客户服务电话：0871-3577930

公司网址：www.hongtastock.com

（40）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

客户服务电话：96518(安徽)、4008096518（全国）

公司网址：www.hazq.com

（41）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

电话：021-50122107

客户服务电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

（42）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张宗锐

电话：（0591）87383600

传真：（0591）87383610

客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

（43）华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路638号财富大厦21楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客户服务电话：4006898888、0931-95368

公司网址：www.hlzqgs.com



(44) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街8号

办公地址：北京市西城区金融大街8号

法定代表人：宋德清

联系人：黄恒

电话：010-58568235

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

公司网址：www.hrsec.com.cn

(45) 华泰证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客户服务电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(46) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

办公地址：上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人：俞洋

联系人：杨丽娟

电话：021-54967202

传真：021-54967293

客户服务电话：021-32109999、029-68918888

公司网址：www.cfsc.com.cn

(47) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：刘爽

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

客户服务电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

（48）联讯证券股份有限公司

注册地址：中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

办公地址：中国广东省惠州市惠城区江北东江三路广播电视新闻中心

法定代表人：徐刚

联系人：郭晴

电话：0752-2119391

传真：0752-2119369

客户服务电话：95564

公司网址：www.lxsec.com.cn

（49）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

法定代表人：岳献春

电话：4006 19 8888

客户服务电话：4006 19 8888

公司网址：www.msza.com

（50）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

客户服务电话：95511—8

公司网址：www.pingan.com

（51）山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351—8686659

传真：0351—8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

（52）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人：龚德雄

联系人：许曼华

电话：021-53686888

传真：021-53686100

客户服务电话：021-962518

公司网址：www.962518.com

（53）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客户服务电话：95523或4008895523 电话委托：021-962505

公司网址：国际互联网网址：www.swhysc.com

（54）首创证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座

办公地址：北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座

法定代表人：吴涛

联系人：刘宇

电话：010-59366070

传真：010-59366055

客户服务电话：400-620-0620

公司网址：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

（55）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元

办公地址：深圳市福田区金田路4028号经贸中心47-49楼

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客户服务电话：40018-40028

公司网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

（56）湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：林俊波

联系人：赵小明

电话：021-68634510-8620

传真：021-68865680

客户服务电话：400-888-1551

公司网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

（57）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

办公地址：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

传真：010-63080978

客户服务电话：95321

公司网址：www.cindasc.com

（58）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

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（59）招商证券股份有限公司

注册地址：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

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943237

客户服务电话：95565、4008888111、（0755）26951111

公司网址：www.newone.com.cn

（60）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-65058065

客户服务电话：400-910-1166

公司网址：www.cicc.com.cn

（61）中国银河证券股份有限公司

注册地址：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：陈有安

联系人：田薇

电话：（010）66568430

传真：（010）66568536

客户服务电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（62）中国中投证券有限责任公司

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-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客户服务电话：400-600-8008 95532

公司网址：www.china-invs.cn

（63）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

客户服务电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

（64）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

电话：0755-82570586

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011

公司网址：www.zszq.com

（65）中泰证券股份有限公司

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

公司网址：www.qlzq.com.cn

（66）中信建投证券股份有限公司

注册地址：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：王常青

联系人：权唐

电话：400-8888-108

传真：（010）65182261

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(67) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号天泰金融广场A座20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号天泰金融广场A座20层（266061）

法定代表人：杨宝林

联系人：赵艳青

电话：0532-85023924

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(68) 中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

联系人：张于爱

电话：010-84864818

传真：010-84865560

客户服务电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(69) 深圳众禄金融控股有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩萍

联系电话：0755-33227951

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网站：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(70) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼



法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

开放式基金咨询电话：400-700-9665

开放式基金业务传真：021-68596916

公司网站：www.ehowbuy.com

(71) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

联系电话：021-38509636

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

(72) 北京展恒基金销售股份有限公司

住所：北京市顺义区后沙峪镇安福街6号

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

联系电话：010-59601366

传真：010-62020355

客服电话：400-888-6661

公司网站：<http://www.myfp.cn>

(73) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座九层

法定代表人：其实

联系人：何春燕

联系电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

公司网站：<http://www.1234567.com.cn/>

(74) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：徐昶绯

联系电话：021-60897840

客服电话：4000-766-123

公司网站：<http://www.fund123.cn>

(75) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

住所：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809

法定代表人：沈伟桦

联系人：宋欣晔

联系电话：010-52361860

客服电话：400-6099-500

网站：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(76) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

办公地址：北京市西城区金融大街35号国企大厦C座9层

法定代表人：马令海

联系人：邓洁

联系电话：010-58321105

传真：010-58325282

客服电话：4008507771

网站：[www.jrj.com.cn](http://www.jrj.com.cn)

(77) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街22号1002室  
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
法定代表人：王莉  
联系人：吴卫东  
联系电话：021-20835787  
客服电话：400-920-0022  
网站：<http://licaike.hexun.com>

(78) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室  
办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼  
法定代表人：凌顺平  
联系人：吴强  
联系电话：0571-88911818  
传真：0571-86800423  
客服电话：0571-88920897、4008-773-772  
公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(79) 北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室  
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层  
法定代表人：梁越  
联系人：陈攀  
联系电话：010-57756019  
传真：010-57756199  
客服电话：4007-868-868  
网站：<http://www.chtfund.com>

(80) 北京钱景财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012  
法定代表人：赵荣春

联系人：周悦

联系电话：010-57418829

传真：010-57569671

客服电话：400-678-5095

网站：<http://www.niuji.net>

(81) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：郑茵华

电话：021-20691831

传真：021-20691861

客户服务电话：400-820-2899

公司网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(82) 众升财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人：李招娣

联系人：李艳

客户服务电话：400-059-8888

公司网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(83) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702

办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(84) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路227号3层310室

办公地址: 上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼

法定代表人: 燕斌

联系人: 张巍婧

电话: 021-51507071

传真: 021-62990063

客户服务电话: 021-51507071

网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(85) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址: 上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址: 上海市黄浦区中山南路100号19层

法定代表人: 冯修敏

联系人: 周丹

电话: 021-33323999\*8318

传真: 021-33323830

客服电话: 4008202819

网站: [fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

(86) 济安财富(北京)资本管理有限公司

注册地址: 北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路7号财富中心A座46层

法定代表人: 杨健

联系人: 李海燕

电话: 010-65309516转814

传真: 010-65330699

客服电话: 400-075-6663

网站: [www.pjfortune.com](http://www.pjfortune.com)

(87) 中经北证(北京)资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层

办公地址：北京市西城区北礼士路甲129号

法定代表人：徐福星

联系人：李美

电话：010-68998820

客服电话：400-600-0030

网站：www.bzfunds.com

(88) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

法定代表人：罗细安

联系人：李皓

电话：13521165454

传真：010-67000988-6000

客服电话：400-001-8811

网站：www.zcvc.com.cn

(89) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

联系人：何雪

电话：02120665952

传真：02122066653

客服电话：400-821-9031

网站：lufunds.com

(90) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈纪伟

联系人：赵沛然

电话：02150583533

传真：02150585353

客服电话：400-033-7933

网站：www.leadfund.com.cn

（91）泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

联系人：薛长平

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客服电话：400-6411-999

网站：www.taichengcaifu.com

（92）北京微动利投资管理有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341室

办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341室

法定代表人：梁洪军

联系人：季长军

电话：010-68854005

传真：010-68854009

客户服务电话：400-819-6665

网址：www.buyforyou.com.cn

（93）北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室

法定代表人：董浩

联系人：张婷婷

电话：18510450202

传真：010-56580660

客户服务电话：400-068-1176

公司网址：www.jimufund.com

（94）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

联系人：陈勇军

电话：0755-83999907-806

传真：0755-83999926

客户服务电话：0755-83999913

公司网址：www.jinqianwo.cn

（95）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

（96）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

电话：021-63333319

传真：021-63332523

客户服务电话：4000 178 000



公司网址: [www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(97) 泰信财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间

办公地址: 北京市海淀区西四环北路69号一层

法定代表人: 李静

联系人: 周栋

电话: 010-88499161

传真: 010-88460066

客户服务电话: 400-168-7575

公司网址: [www.taixincf.com](http://www.taixincf.com)

(98) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址: 杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室

办公地址: 杭州市拱墅区登云路55号一楼

法定代表人: 徐黎云

联系人: 孙成岩

电话: 0571-88337717

传真: 0571-88337666

客户服务电话: 400-068-0058

公司网址: [www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(99) 北京君德汇富投资咨询有限公司

注册地址: 北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室

办公地址: 北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室

法定代表人: 李振

联系人: 周汶

电话: 13810043063

传真: 010-65174782

客户服务电话: 400-057-8855

公司网址: [www.vjinke.com](http://www.vjinke.com)

(100) 奕丰科技服务(深圳)有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

公司地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室

法人：TAN YIK KUAN

联系人：项晶晶

电话：0755 8946 0500

传真：0755 2167 4453

客户服务电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

（101）大连网金金融信息服务有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2层202室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号2层202室

法定代表人：卜勇

联系人：贾伟刚

联系电话：（0411）3902 7828

传真：（0411）3902 7888

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

（102）北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人：李悦章

联系人：曹庆展

联系电话：010-65983311

传真：010-65983333

客服电话：010-82350618

公司网址：www.igesafe.com

（103）大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱海涛

联系电话：021-20324000

传真：021-20324199

客服电话：400-928-2266

公司网址：www.dtfunds.com

## （二）注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼10D

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：高新

电话：（010）82019988

传真：（010）82255988

联系人：龚珉

## （三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海市通力律师事务所

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：吕红

经办律师：吕红、黎明

## （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（特殊普通合伙）

注册地址：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

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：陈玲、曹阳

联系人：曹阳

## 五、基金的名称

本基金名称：长盛量化红利策略混合型证券投资基金

## 六、基金的类型

基金类型：契约型开放式

## 七、基金的投资目标

本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。

## 八、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融投资工具，包括股票、债券等。此外，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。

基金资产配置比例为：股票类资产占基金资产的比例为 60%—95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的 80%。债券类资产占基金资产的比例为 0%—40%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

## 九、基金的投资策略与程序

本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。

## a) 大类资产配置策略

本基金综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，在规定范围内合理确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高资产配置效率。

## b) 股票投资策略

### 1. 红利风格股票池

本基金的股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。红利股票具有如下特征：

（1）行业竞争优势明显，企业属于国民经济增长中的重点支柱行业，或受国家政策鼓励扶持的优势行业，具有较强的核心竞争优势；

（2）行业发展状况良好，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性；

（3）企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高，现金流创造能力强，资产盈利水平较高；企业财务状况良好，各项指标健康；

（4）企业分红派息率较高，企业历年的分红派息率较高，特别是现金分红能力强且分红频率较高。

上市公司的分红派息、利润增长和盈利能力是红利股票特征的基本量化指标。因此，红利风格股票初选标准如表1所示：

**表1：红利风格股票池的初选标准**

股票筛选指标	指标条件
分红能力	上一年度的现金股息率大于0。
利润增长	过去三年的EPS平均增长率在全市场排名前50%
盈利能力	过去三年的累计净利润大于0。

在上述初选的基础上，本基金按照预期股息率对初选股票进行排序，选取排名前70%的股票构成最终的红利风格股票池。其中，预期股息率采用一致预期净利润增长率和前三年上市公司历史平均现金股利发放率作为测算依据。

此外，根据对上市公司基本面研究，结合宏观经济、行业经济发展周期性的研究判断，每半年对红利股票池进行调整。

### 2. 股票组合的构建

本基金在数量化股票选择模型所生成的红利风格股票池的基础上，采用核心

-卫星策略配置股票资产。

### **(1) 核心股票组合的构建**

本基金核心股票组合以量化方法和模型进行构建，是基金股票资产配置的核心内容。核心股票组合是保证基金股票投资收益的稳健性并使基金资产具有明显红利收益的风格特征。

核心股票组合构建是通过对红利风格股票池中的股票再进一步量化筛选，并根据多因子指标来对红利风格股票池中的股票进行评分，选取评分排名在前50%的股票为所选择投资的红利核心股票。其中，多因子指标包括预期股息率、PB、PE、PCF、净利润增长率、ROE等指标，采用等权重法确定股票评分。

通过上述多因子量化评分及筛选方法选出核心红利股票后，采用股票组合优化模型来确定个股权重，从而构建基金股票资产的红利核心股票组合。其中，股票组合的优化目标是使核心组合的风险调整后收益最大化。

### **(2) 卫星股票组合的构建**

本基金在保证核心股票组合风险和收益稳健性的同时，积极利用卫星股票资产的灵活增强配置以获取基金股票组合的超额投资收益。

根据宏观经济波动、行业周期性及上市公司基本面等因素的分析，确定宏观及行业经济变量的变动对股票市场的潜在影响，并根据基金管理人的研究及投资决策判断，增强配置具有超预期增长和深度投资价值的股票作为卫星资产，以此灵活构建卫星股票组合。

### **(3) 核心-卫星策略的实施**

本基金核心-卫星股票组合的比例根据风险预算来确定和配置实施，其中核心股票组合的配置比例不低于股票资产的60%。每季度对基金股票资产中核心-卫星组合进行再平衡和头寸管理，即再平衡核心-卫星资产的比例及组合中个股权重，以使得红利股票组合中的个股在组合中的权重符合风险收益要求，并达到投资目标。

## **c) 债券投资策略**

本基金在实际的投资管理运作中，将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略，以获取债券市场的长期稳定收益。

### **(1) 利率配置策略**

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。通过研究分析宏观经济，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。

#### (2) 类属配置策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，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) 信用配置策略

信用策略主要是根据国民经济运行周期阶段，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。并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) 相对价值策略

本基金认为市场普遍存在着失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在于这些不同因素之间的相对价值，也是本基金发现投资机会的重要方面。

#### (5) 单个债券选择策略

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。

### d) 权证投资策略

本基金投资权证的原则是有利于基金资产增值和投资风险控制，具体权证投资的策略是：

(1) 考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，利用Black - Scholes模型、二叉树模型及其它权证定价模型计算权证合理价值。

(2) 根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、

持有或沽出权证。

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻与实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

### 1) 决策依据

国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定是本基金进行投资的前提；宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势是本基金投资决策的基础；投资对象收益和风险的科学合理配比是本基金维护投资者利益的重要保障。

### 2) 决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的资产配置建议报告对基金的资产配置下达指导性意见，基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责。

#### 1、投资组合的构建

(1) 股票投资组合的构建。通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。

(2) 债券投资组合的构建。在科学预测利率变动的前提下，通过久期管理等策略稳健地进行债券投资，控制债券投资风险。

(3) 权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。

#### 2、交易过程

基金经理通过投资管理系统向交易部下达投资指令。交易部负责交易执行和一线监控。

#### 3、投资组合调整过程

基金经理密切关注宏观经济及市场形势，结合基金申购赎回情况和组合调整情况等，对投资组合进行动态监控和调整。

#### 4、业绩与风险评估过程

基金经理小组和金融工程部按照投资决策委员会指导性方针和投资实施方案对投资业绩进行评估。



## 十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准：75%\*中证红利指数+25%\*中证综合债指数

## 十一、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金产品，风险低于股票型基金、高于债券基金和货币市场基金，属于较高风险、较高回报的基金产品。

## 十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国工商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。

本投资组合报告所载数据取自长盛量化红利混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告，本报告中所列财务数据未经审计。

### 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	204,013,612.24	67.72
	其中：股票	204,013,612.24	67.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	96,584,114.72	32.06
8	其他资产	675,394.39	0.22
9	合计	301,273,121.35	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
---	------	---------	-----------

码			(%)
A	农、林、牧、渔业	1,367,657.50	0.46
B	采矿业	3,833,430.25	1.28
C	制造业	109,885,804.68	36.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业	36,234.48	0.01
F	批发和零售业	16,192,135.39	5.40
G	交通运输、仓储和邮政业	3,891,187.90	1.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,104,263.14	1.04
J	金融业	64,668,348.90	21.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合	1,034,550.00	0.35
	合计	204,013,612.24	68.04

### 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

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	601169	北京银行	2,149,940	21,671,395.20	7.23
2	601288	农业银行	4,600,000	14,720,000.00	4.91
3	601988	中国银行	4,300,000	14,620,000.00	4.88
4	601998	中信银行	2,249,910	13,656,953.70	4.55
5	600120	浙江东方	406,800	7,851,240.00	2.62
6	300038	梅泰诺	99,919	4,688,199.48	1.56
7	000768	中航飞机	175,000	3,386,250.00	1.13
8	600038	中直股份	75,005	3,264,217.60	1.09
9	600118	中国卫星	90,000	3,213,000.00	1.07
10	002335	科华恒盛	74,595	3,165,811.80	1.06

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1 浙江东方集团股份有限公司于 2016 年 2 月 5 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局（以下简称“浙江证监局”）《关于对浙江东方集团股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016]4 号），发现公司存在如下问题：一、公司本部及子公司通过伪造虚假采购合同、销售合同等单据并以现金流配合支持，虚构对张家港保税物流园区浩阳国际贸易有限公司的采购及索日新能源股份有限公司的销售，导致公司 2013 年、2014 年年报存在虚假

信息披露。二、按照关联方浙江国贸新能源投资股份有限公司（以下简称“国贸新能源”）各股东的实际借款总额和出资比例，公司在 2013 年底、2014 年底和 2015 年 10 月底向国贸新能源提供的配套资金应为 9487.84 万元、12462.18 万元和 8463.00 万元，但近三年公司实际向国贸新能源提供的配套资金分别为 14000 万元、14000 万元和 9540 万元，导致公司控股股东浙江省国际贸易集团有限公司及其子公司浙江省国兴进出口有限公司在 2013 年底、2014 年底、2015 年 10 月底分别占用上市公司资金 4512.16 万元、1537.82 万元和 1077.00 万元，公司未及时披露上述关联方非经营性资金占用情形。三、公司自 2013 年 4 月起向关联方国贸新能源提供 14000 万元借款并多次展期，公司未及时披露相关情况。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条、第四十八条的规定，按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，责令公司作出如下整改：一、追溯调整公司 2013 年和 2014 年财务报告并披露。二、追回被控股股东及其子公司占用的资金，并披露关联方非经营性资金占用情况。三、详细披露 14000 万元借款的后续展期情况。本基金做出如下说明：浙江东方集团是浙江省大型优质国有企业，综合实力突出，基本面良好。基于相关研究，本基金判断，这一处罚对公司无实质影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，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。

11.2 基金的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	587,897.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,952.46
5	应收申购款	66,544.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	675,394.39

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

11.5 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(元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600120	浙江东方	7,851,240.00	2.62	重大事项停牌
2	300038	梅泰诺	4,688,199.48	1.56	重大事项停牌

#### 11.6 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。

### 十三、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下:

阶段	净值增长率 ①(%)	净值增长率 标准差②(%)	业绩比较基 准收益率③ (%)	业绩比较基 准收益率标 准差④(%)	①-③(%)	②-④(%)
2009年11月25日(基金合同生效日)至2009年12月31日	0.60	0.49	1.71	1.63	-1.11	-1.14
2010年1月1日至2010年12月31日	4.17	1.30	-9.10	1.14	13.27	0.16
2011年1月1日至2011年12月31日	-17.82	1.06	-16.84	0.94	-0.98	0.12
2012年1月1日至2012年12月31日	2.42	0.94	6.57	0.91	-4.15	0.03
2013年1月1日至2013年12月31日	7.44	1.10	-6.29	1.12	13.73	-0.02
2014年1月1日至2014年12月31日	43.41	1.40	38.77	0.85	4.64	0.55
2015年1月1日至2015年12月31日	65.67	2.91	22.88	1.98	42.79	0.93
2016年1月1日至2016年3月31日	-12.95	2.39	-9.59	1.86	-3.36	0.53
2009年11月25日(基金合同生效日)至2016年3月31日	95.98	1.62	18.19	1.26	77.79	0.36

年 3 月 31 日						
------------	--	--	--	--	--	--

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资产，但不保证基金一定赢利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策之前应仔细阅读本基金的招募说明书。

#### 十四、基金费用与税收

##### (一)基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

##### (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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述（一）基金费用的种类中第 3-8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）与基金销售有关的费用

#### 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	1.0%
200万≤M<500万	0.3%
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

### （四）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、

信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### **(五) 费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### **(六) 基金税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### **十五、 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”中更新了有关招募说明书更新截止日期的描述。
- (二) 更新了“三、基金管理人”中的相关内容。
- (三) 更新了“四、基金托管人”中的相关内容。
- (四) 更新了“五、相关服务机构”中的相关内容。
- (五) 更新了“十一、基金的投资”中“(十)基金投资组合报告”的相关内容。
- (六) 更新了“十二、基金的业绩”中的相关内容。
- (七) 更新了“十五、基金资产的估值”中的相关内容。
- (八) 更新了“二十五、其他应披露的事项”中的相关内容。



## 十六、 签署日期

本招募说明书（更新）于 2016 年 7 月 5 日签署。

长盛基金管理有限公司

2016 年 7 月 7 日