长盛中证100指数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:中国农业银行

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2006年8月28日证监基金字[2006]172号文核准募集。本基金的基金合同于2006年11月22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2008年11月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效的日期

2006年11月22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:陈平
电话:(010)82255818
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(原国元证券有限责任公司)占注册资本的41%;新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司(原安徽省创新投资有限公司)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2008年11月22日,基金管理人共管理两只封闭式基金、九只开放式基金和六只社保基金委托资产,公募基金管理资产规模约211.24亿元。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员:

陈平先生,董事长,硕士。曾任教于合肥工业大学管理系,历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理、国元证券有限责任公司副总裁,2004年10月始任长盛基金管理有限公司董事。

凤良志先生,董事,博士,高级经济师。历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、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、安徽省政府驻香港窗口公司(黄山有限公司)董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理(主持工作)、安徽国元控股(集团)有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长,现为国元证券股份有限公司(原国元证券有限责任公司)董事长。

杜长棣先生,董事,学士。历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。

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,现为安徽省信用担保集团有限公司(原安徽省创新投资有限公司)董事长,安徽省信用担保集团总经理。

蔡咏先生,董事,学士,高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国(塞班)分公司任财务经理,历任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司(黄山有限公司)总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理,现为国元证券股份有限公司(原国元证券有限责任公司)董事、总裁。

叶约德女士,董事,工商管理硕士。曾任香港金融管理局助理总裁,并在花旗银行和罗富齐投资管理公司及摩根信托银行担任多项要职,于2006年10月获委任为星展银行(香港)有限公司行政总裁,同时担任星展集团控股管理委员会及星展银行资金管理有限公司主席。

何玉珠女士,董事,学士。历任JP摩根证券(亚洲)有限公司副总裁、瑞银集团董事总经理,现为星展资金管理有限公司首席执行官、新加坡财富管理学院资深顾问。

张仁良先生,独立董事,经济及金融学教授。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及上海复旦大学顾问教授。现为香港城市大学讲座教授、民政事务总署下的《伙伴倡自强》社区协作计划主席,为香港证监会的公众股东权益小组服务。于2007年被委任为太平绅士。

荣兆梓先生,独立董事,经济学学士,教授;兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学院副主编,现为安徽大学经济学院院长,校学术委员会委员,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,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,安徽省经济学会常务理事。

陈华平先生,独立董事,博士毕业,教授,博士生导师。曾任中国科技大学商学院信息管理与决策研究室主任、中国科技大学商学院商务智能实验室主任,现为中国科技大学商学院副院长,中国科技大学"管理科学与工程"一级学科博士点的学科带头人。

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。

2、基金管理人监事会成员:

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,历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理,现为安徽省中小企业信用担保中心副主任,安徽省创新投资有限公司总经理,安徽省信用担保集团副总经理。

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,现为安徽省投资集团有限责任公司总经理助理、资本运营部经理。

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,现为国元证券股份有限公司(原国元证券有限责任公司)合规管理部经理。

肖强先生,监事,学士。曾任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理,中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师,中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司,历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理、投资管理部副总监,现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(原基金同智)基金经理,并自2008年6月4日起兼任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

林良友先生,监事,学士。曾在花旗、瑞信出任要职,现为星展银行(香港)有限公司私人银行部业务主管。

3、基金管理人高级管理人员

陈平先生,董事长,硕士。同上。

陈礼华先生,硕士,高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员,华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理,南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监,长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

周兵先生,硕士,经济师。历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等职。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。历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、经理等职,现任长盛基金管理有限公司督察长。

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)。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

黄瑞庆先生,1974年出生,中共党员。2002年7月毕业于厦门大学,获博士学位。历任融通基金管理有限公司研究员;长城基金管理有限公司金融工程小组组长,长城货币市场基金基金经理;自2005年9月起加入长盛基金管理有限公司,现任社保组合组合经理。自2007年9月17日起任长盛中证100指数证券投资基金(本基金)基金经理。其以往担任基金经理情况:2005年5月30日至2005年9月24日担任长城货币市场基金基金经理。

历任基金经理情况:白仲光先生,2006年11月22日—2008年1月3日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

陈礼华先生,硕士,总经理,同上。

詹凌蔚先生,经济学硕士学位,曾历任融通基金管理有限公司研究部研究员,研究部副总监,基金经理助理,基金经理,投资总监,总经理助理;博时基金管理有限公司基金经理职务;现任长盛基金管理有限公司投资管理部总监、研究发展部总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

朱剑彪先生,金融学博士。历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,现任机构理财部总监兼专户理财部总监。

侯继雄先生,博士。曾任国泰君安证券股份有限公司企业融资业务经理、研究所行业研究员和策略经理等职务;于2007年2月加入长盛基金管理有限公司,现任研究发展部副总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理和基金同盛证券投资基金基金经理。

潘九岩先生,硕士。曾任博时基金管理公司交易部任中央交易员,2002年起至今在长盛基金管理有限公司任职,先后担任交易主管、同智基金经理助理、交易部副总监,现在担任交易部总监。

白仲光先生,金融工程专业工学博士,2003年加入长盛基金管理有限公司,历任研究员、高级金融工程师,中证100指数基金基金经理。现任金融工程部总监。

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。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

名称:中国农业银行
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦
法定代表人:项俊波
成立时间:1979年2月23日
注册资金:361亿元人民币
存续期间:持续经营
电话:68424199
联系人:李芳菲

发展概况及财务状况:1998年5月,中国农业银行证券投资基金托管部经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统。现有员工87名。截止2008年9月30日,中国农业银行托管的基金达60只。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)长盛基金管理有限公司北京分公司
地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座9层
电话:(010)82255818转263、288
传真:(010)82255981、82255982
联系人:银晓莉
客户服务电话:(010)62350088、400-888-2666

(2)长盛基金管理有限公司上海分公司
地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1601室
电话:(021)6888 9056、(021)6888 9206
传真:(021)6888 9156
联系人:冯岩

(3)长盛基金管理有限公司华南营销中心
地址:深圳市福田区福中三路1006号诺德中心8层GH单元
电话:(0755)88267980
传真:(0755)82022118
联系人:梁琪

2、代销机构

(1)中国农业银行
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:项俊波
传真:(010)85109219
联系人:滕 涛
客户服务电话:95599
网址: www.abchina.com

(2)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富华大厦C座
法定代表人:孔丹
电话:010-65557018
联系人:黎珊
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(3)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
联系人:靳晓杰
传真:(010)66594946
客户服务电话:95566
银行网站:www.boc.cn

(4)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

(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:秦晓
电话:0755－83198888
传真:0755－83195109
联系人:兰奇
客户服务电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

(6)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:姜建新
电话:(010)66107900
传真:(010)66107914
联系人:王佺
客户服务电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

(7)广东发展银行股份有限公司:
注册地址:广州市农林下路83号
法定代表人:李若虹
联系人:赵亮
客户服务电话:020-38322974 / 38322542
网址:www.gdb.com.cn

(8)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
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(9)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:汤嘉惠、虞谷云
客户服务热线:95528
网站:www.spdb.com.cn

(10)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:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(11)国元证券股份有限公司
住所:合肥市寿春路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)2634400-3612
联系人:祝丽萍

(12)国联证券有限责任公司
住所:无锡市县前东街168号
办公地址:无锡市县前东街8号6楼、7楼
法定代表人:范炎
开放式基金咨询电话:(0510)82831662,(0510)82588168
开放式基金业务传真:(0510)82831589
联系人:袁丽萍
电话:(0510)82831662
公司网站:www.glsc.com.cn

(13)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
联系电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:肖中梅
公司网站:www.gf.com.cn

(14)中国银河证券有限责任公司
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:肖时庆
电话:(010)66568047
传真:(010)66568536
联系人:李洋

(15)广发华福证券有限责任公司
住所:福州市新天地大厦8层
办公地址:福州市新天地大厦8层
法定代表人:黄金琳
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
联系人:张腾
公司网址:www.gfhfzq.com.cn

(16)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝内大街188号
法定代表人:张佑军
电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:(010)65182261
联系人:权唐

(17)联合证券有限责任公司
住所:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、14、24、25楼
办公地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、14、24、25楼
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:400-8888-555,(0755)25125666
公司网址:www.lhzq.com

(18)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
公司网址:www.sw2000.com.cn

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

(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:祝幼一
电话:(021)62580818-213
传真:(021)62569400
联系人:芮敏祺

(21)新时代证券有限责任公司
住所:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座15层
办公地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座15层
法定代表人:马金声
开放式基金咨询电话:(010)68084591
开放式基金业务传真:(010)68084986
联系人:戴荻

(22)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨
联系电话:021-50818887-281
客户咨询电话:021-68823685
公司网址:www.ebscn.com

(23)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
联系人:金芸
客服电话:400-8888-001、(021)962503

(24)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:长春市人民大街138－1号
法定代表人:矫正中
开放式基金咨询电话:(0431)96688-0、(0431)5096733
开放式基金业务传真:(0431)5680032
联系人:潘锴
公司网址:www.nesc.cn

(25)恒泰证券有限责任公司
住所:内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路111号
办公地址:上海浦东松林路357号通贸大厦20楼
法定代表人:刘汝军
联系人:张同量
联系电话:(021)68405273
客户咨询电话:(021)68405392
公司网址:http://www.cnht.com.cn

(26)第一创业证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
开放式基金咨询电话:(0755)25832686
开放式基金业务传真:(0755)25831718
联系人:杨柳

(27)华西证券有限责任公司
住所:四川省成都市陕西街239号
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼
法定代表人:张慎修
电话:(0755)83025430
传真:(0755)83025991
联系人:杨玲

(28)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

(29)渤海证券有限责任公司
住所:天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:张志军
客户服务热线:(022)28455588或城市营业网点咨询电话
电话:(022)28451883
联系人:王兆权

(30)中信万通证券有限责任公司
住所:青岛市崂山区香港东路316号
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:史洁民
联系电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人:丁韶燕
公司网址:www.zxwt.com.cn
客户咨询电话:0532-96577

(31)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层
法定代表人:王少华
电话:800-810-8809
传真:010-64482090
联系人:黄静
公司网址:www.guodu.com

(32)齐鲁证券有限公司
地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
电话:0531-81283728
传真:0531-81283735
联系人:傅咏梅

(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

(34)安信证券股份有限公司
地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82558323
传真:0755-82558355
联系人:余江

(35)长城证券有限责任公司
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
法定代表人:黄耀华
联系人:匡婷
电话:0755-83516289
传真:0755-83516199
客户服务热线:　0755-33680000　400 6666 888
长城证券网站:www.cc168.com.cn

(36)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: 王敏
电话:0871-3577011
客户服务电话:0871-3577930
网址:www.hongtazq.com

(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:(010)58598839
传真:(010)58598907
联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:国浩律师集团(北京)事务所
注册地址:北京市东城区贡院六号E座9层
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层
法定代表人:王卫东
电话:(010)65890699
传真:(010)65176800
经办律师:李永飞、王卫东

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区沈家弄325号
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人: Kent Watson
电话:(021)61238888
传真:(021)61238800
经办注册会计师:薛竞、陈宇

五、基金的名称

本基金名称:长盛中证100指数证券投资基金

六、基金的类型

基金类型:契约型开放式

七、基金的投资目标

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

八、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场初次发行或增发)等,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。

九、基金的投资策略与程序

(一)投资理念

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

(二)投资策略

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

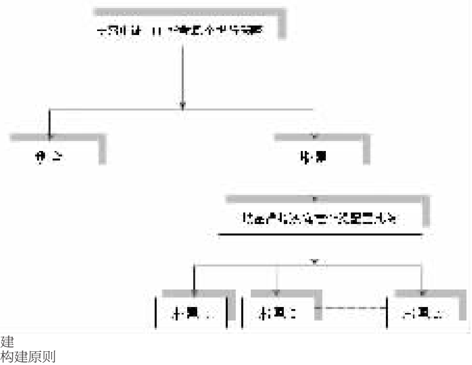
当预期成份股发生调整和成份股发生分红、配股、增发等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况(如股权分置改革等)导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为3个月,3个月之后本基金投资组合比例达到基金合同相关规定。

1、资产配置

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

图3 长盛中证100指数基金投资策略体系



2、股票组合构建

(1)股票组合构建原则

本基金原则上采用复制基准指数的方法,按照个股在基准指数中的基准权重构建指数化股票投资组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

(2)股票组合构建方法

本基金原则上将采取复制基准指数的方法, 按照个股在基准指数中证100指数中的基准权重进行指数化投资组合构建。复制方法将使用下列模型:

$$Amount_{i,t} = \omega_{i,t} \times Netvalue_t$$

$$Volume_{i,t} = Amount_{i,t} / P_{i,t}$$

这里,$\omega_{i,t}$:中证100指数中第i个成份股t时刻在指数中所占的权重

$Amount_{i,t}$:本基金对中证100指数中第i个成份股t时刻的投资额度

$Volume_{i,t}$:本基金对中证100指数中所有成份股在t时刻购买的股票数量

$Netvalue_t$:本基金在t时刻投资在股票上的总资金

$P_{i,t}$:中证100指数中第i个成份股在t时刻的市场价格

3、股票组合调整

(1)组合调整原则

本基金为指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(2)投资组合调整方法

①对基准指数的跟踪调整

A、定期季度调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的中证100指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

中证指数委员会每过半年召开审核会议,根据指数编制规则,使用最后一个交易日收盘后的资料进行成份股审核,决定成份股审核结果(指数成份股及其权重)。本基金将按照中证100指数对成份股及其权重的调整方案,在考虑跟踪误差风险的基础上,对股票投资组合进行相应调整。

B、不定期调整

根据指数编制规则,当中证100指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。

调整期间原则上定为:中证指数公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

②限制性调整

A、大额赎回调整

由于本基金开放式基金的特点,当发生大额赎回超过现金保有比例时,本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整,以保证基金正常运行。

B、流动性调整

如果因基准指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素,使得基金管理人无法依照基准指数权重购买某成份股,本基金管理人将视当时市场情况,综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。

替代股票的选取主要依照行业、规模相似的前提下,计算需替代的基准指数成分股票和替代股票历史收益率之间的相关系数,原则上要求最近一年的日收益率相关系数达到0.8以上,相关系数的计算方法如下

$$\rho = \frac{COV(r_{基准}, r_{替代})}{\sqrt{VAR(r_{基准})VAR(r_{替代})}}$$

这里COV函数表示样本协方差,VAR函数表示样本方差。

C、如果预期指数的成份股将会发生调整,本基金管理人将视情况对基金资产进行前瞻性的调整,以更好地跟踪基准指数。

D、针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

E、为使得基金收益率尽可能地贴近所跟踪基准指数的收益率,本基金可能使用投资金融衍生产品,以对冲某些成分股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

F、在其他影响指数复制的情况下,本基金管理人可以根据市场情况,在跟踪误差最小化的条件下,对基金资产进行适当的调整。

(三)基金投资决策与程序

1、投资决策依据

(1)国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定。

(2)宏观经济发展环境、微观企业经济运行态势和证券市场走势。

2、投资决策机制

本基金的投资决策机制为,实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

(1)投资决策委员会

负责制定基金投资方面的整体战略和原则;审定基金季度投资检讨报告;决定基金禁止的投资事项等。

(2)基金经理

负责资产配置与投资组合构建的日常管理。

3、投资决策程序

(1)金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算,并提供数量化风险分析报告;研究部对基准指数成份股中基本面恶化的企业情况提供及时的风险分析报告;市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告,供基金经理决策参考。

(2)投资决策委员会定期召开会议,依据上述报告对资产配置提出指导性意见;如遇重大事项,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

(3)基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告,在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下,采取适当的方法,控制与指数的偏差风险、流动性风险,降低交易成本。

(4)交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖。

(5)风险控制委员会根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议;风险管理小组对投资组合的偏离度风险进行实时跟踪和评估,并对风险隐患提出预警;监察稽核部对指数化投资组合的执行过程进行实时风险监控;基金经理依据基金申购和赎回的情况控制指数化投资组合的流动性风险。

4、投资评价

在正常市场情况下,本基金净值收益率与业绩衡量基准之间年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(四)投资限制

1、基金财产不得用于下列投资或者活动

(1)承销证券;

(2)向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券;

(7)从事内幕交易操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

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

2、本基金投资组合比例将符合以下限制

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

(2)股票、债券和现金的投资比例不得违反本基金合同有关投资范围、投资策略、投资比例等内容的约定;

(3)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起3个月内达到规定的标准。

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

十、基金的业绩比较标准

中证100指数收益率×95%＋一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%

十一、基金的风险收益特征

本基金为被动投资型指数基金,风险中等,将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略,在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险,本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

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——中国农业银行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截至2008年9月30日,本报告财务资料未经会计师事务所审计。

1、2008年9月30日基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,234,382,272.73	94.42
	其中:股票	1,234,382,272.73	94.42
2	固定收益投资	–	0.00
	其中:债券	–	0.00
	资产支持证券	–	0.00
3	金融衍生品投资	485,574.39	0.04
4	买入返售金融资产	–	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	62,918,319.81	4.81
6	其他资产	9,574,296.14	0.73
7	资产合计	1,307,360,463.07	100.00

2、2008年9月30日按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	0.00
B	采掘业	210,005,657.27	16.15
C	制造业	250,372,697.92	19.25
C0	食品、饮料	53,486,325.00	4.11
C1	纺织、服装、皮毛	6,906,081.40	0.53
C2	木材、家具	–	0.00
C3	造纸、印刷	–	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	31,301,495.45	2.41
C5	电子	–	0.00
C6	金属、非金属	110,260,146.90	8.48
C7	机械、设备、仪表	48,418,649.17	3.72
C8	医药、生物制品	–	0.00
C99	其他制造业	–	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	75,992,154.51	5.85
E	建筑业	16,579,746.06	1.28
F	交通运输、仓储业	91,825,516.98	7.06
G	信息技术业	42,456,533.22	3.27
H	批发和零售贸易	16,609,448.40	1.28
I	金融、保险业	453,099,551.83	34.85
J	房地产业	51,285,159.15	3.94
K	社会服务业	16,563,056.65	1.27
L	传播与文化产业	3,825,839.28	0.29
M	综合类	5,766,911.46	0.44
	合计	1,234,382,272.73	94.95

3、2008年9月30日按公允价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	600036	招商银行	4,807,465	84,707,533.30	6.52
2	600030	中信证券	2,791,525	69,118,159.00	5.32
3	601088	中国神华	2,041,385	55,913,535.15	4.30
4	601318	中国平安	1,603,340	53,343,121.80	4.10
5	600028	中国石化	4,363,526	46,602,457.68	3.58
6	600016	民生银行	7,406,739	38,218,773.24	2.94
7	600000	浦发银行	2,032,345	31,745,228.90	2.44
8	600050	中国联通	5,659,928	30,959,806.16	2.38
9	601857	中国石油	2,380,512	30,565,774.08	2.35
10	000002	万 科 A	4,604,270	30,065,883.10	2.31

4、2008年9月30日按券种分类的债券投资组合:

本基金报告期末未持有债券。

5、2008年9月30日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、投资组合报告附注

(1)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,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2)基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

(3)2008年9月30日其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	6,457,065.19
3	应收股利	397,624.89
4	应收利息	16,586.27
5	应收申购款	1,653,019.79
6	其他资产	–
7	合 计	9,574,296.14
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	6,457,065.19
3	应收股利	397,624.89
4	应收利息	16,586.27
5	应收申购款	1,653,019.79
6	其他资产	–
7	合 计	9,574,296.14
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	6,457,065.19
3	应收股利	397,624.89
4	应收利息	16,586.27
5	应收申购款	1,653,019.79
6	其他资产	–
7	合 计	9,574,296.14
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	6,457,065.19
3	应收股利	397,624.89
4	应收利息	16,586.27
5	应收申购款	1,653,019.79
6	其他资产	–
7	合 计	9,574,296.14

(4)2008年9月30日基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金2008年9月30日未持有可转换债券。

(5)2008年9月30日本基金投资权证明细

序号	代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	580020	上港CWB1	131,733	274,004.64	0.02
2	580019	石化CWB1	134,330	211,569.75	0.02
序号	代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	580020	上港CWB1	131,733	274,004.64	0.02
2	580019	石化CWB1	134,330	211,569.75	0.02

(6)2008年9月30日基金持有的资产支持证券明细

本基金2008年9月30日未持有资产支持证券。

十三、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下:

	2006.11.22–2006.12.31	2007年度	2008.1.1–2008.9.30	自成立至2008.9.30
基金份额净值增长率	9.45%	115.49%	–53.37%	9.98%
同期业绩比较基准收益率	27.88%	135.95%	–55.31%	34.85%
超额收益率	–18.43%	–20.46%	1.94%	–24.87%

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。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。

十四、基金费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)证券交易费用;

(4)基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;

(7)销售服务费,具体计提办法按中国证监会的规定执行;

(8)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、与基金运作有关的费用的费率、计提方法、计提标准、收取方式和使用方式

(1)基金管理人的管理费

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

H＝E×0.75%÷当年天数

H:为每日应计提的基金管理费;

E:为前一日基金资产净值。

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

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

H＝E×0.15%÷当年天数

H:为每日应支付的基金托管费;

E:为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(3)上述(一)基金费用第(3)－(8)项费用,除上款规定的费用外,由基金托管人根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额,从当期基金财产中支付。

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

3、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本基金财产的损失,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。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费,下调前述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3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费率不高于1.5%,随申购金额的增加而递减:

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

2、赎回费

(1)费率:

本基金的赎回费率不高于0.5%:

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

(2)本基金收取的赎回费中25%的部分归入基金财产。

3、转换费

本基金将在未来开放与基金管理人管理的其他基金之间的基金份额的转换,届时基金管理人将会同基金托管人制定基金的转换费收取水平并予公告。

(三)其他费用

本基金运作和销售过程中发生的其他费用,以及因故与本基金有关的其他费用,将依照国家法律法规的规定,予以收取和使用。

(四)本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律法规的规定,履行纳税义务。

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方法》、《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"三、基金管理人"中,更新了基金管理人的相关基本情况。

(三)、在"四、基金托管人"中,更新了基金托管人的相关基本情况。

(四)、在"五、相关服务机构"中,更新和增加了直销机构和代销机构的有关信息。

(五)、在"十、基金的投资"中,更新了"(十)基金投资组合报告",数据截至到2008年9月3日。

(六)、在"十一、基金的业绩"中,更新了基金从成立到2008年9月30日的业绩情况。

(七)、在"二十四、基金资产的估值"中,更新了相关内容。

(八)、在"二十四、其他应披露的事项"中,披露了如下事项:"

1)本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

2)最近3年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚。

3)2008年5月23日本基金管理人发布关于长盛基金客服中心延长工作时间的公告。

4)2008年6月2日本基金管理人发布查找地震灾区基金份额持有人的公告。

5)2008年6月6日本基金管理人发布关于增加广东发展银行股份有限公司为代销机构的公告。

6)2008年7月1日本基金管理人发布本基金招募说明书(更新)及其摘要。

7)2008年7月1日本基金管理人发布关于旗下部分基金参与中信银行网上交易申购费率优惠活动的公告。

8)2008年7月2日本基金管理人发布关于增加中国民生银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告。

9)2008年7月4日本基金管理人发布关于变更公司高管的公告。

10)2008年7月15日本基金管理人发布关于旗下基金通过民生银行开展定期定额投资业务的公告。

11)2008年7月19日本基金管理人发布本基金2008年第2季度报告。

12)2008年8月5日本基金管理人发布关于参与中国银行网上银行及定期定额申购费率优惠活动公告。

13)2008年8月6日本基金管理人发布关于增加定期定额投资业务代销机构的公告。

14)2008年8月28日本基金管理人发布关于调整长盛基金管理有限公司网上直销申购费率的公告。

15)2008年8月29日本基金管理人发布本基金2008年半年度报告及其摘要。

16)2008年9月3日本基金管理人发布关于开通长盛网上直销基金定期定额申购业务的公告。

17)2008年9月16日本基金管理人发布关于调整本司旗下基金所持停牌股票估值方法的公告。

18)2008年9月17日本基金管理人发布关于本司旗下证券投资基金所持停牌股票估值调整的公告。

19)2008年9月23日本基金管理人发布关于赎回旗下长盛动态精选基金的公告。

20)2008年9月25日本基金管理人发布关于增加浦发银行为旗下基金代销机构的公告。

21)2008年10月10日本基金管理人发布关于增加长城证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告。

22)2008年10月24日本基金管理人发布本基金2008年第3季度报告。

23)2008年10月29日本基金管理人发布关于增加交通银行为代销机构并开通定期定额投资业务及同时参加定期定额申购费率优惠活动的公告。

24)2008年11月5日本基金管理人发布关于增加注册资本、变更注册地址和股东名称的公告。

25)2008年11月17日本基金管理人发布关于增加第一创业证券有限责任公司和红塔证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告。"

十六、签署日期

本招募说明书(更新)于2008年12月8日签署。

长盛基金管理有限公司
二〇〇九年一月六日