长盛积极配置债券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:中国建设银行股份有限公司

重要提示:

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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》(以下简称《运作办法》)、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2009年10月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效的日期:2008年10月8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2009年10月8日,基金管理人共管理两只封闭式基金、十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422.54亿元。

(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。

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总经理。

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。

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。

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。

吴彩民先生,董事,工商管理硕士,特许财务分析师。有逾二十年投资银行及资产管理经验,曾任职多个主要财务机构,包括汇丰银行及JP摩根。现为星展资金管理(香港)有限公司董事总经理。

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,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,香港城市大学讲座教授。现为香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署辖下的《伙伴倡行强》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。

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,中国科技大学管理学院商务智能实验室主任。

2.基金管理人监事会成员:

沈和付先生,监事会主席,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,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。现为安徽省投资集团有限责任公司总经济师。

林良友先生,监事,学士。曾在花旗银行、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。

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、基金同智基金经理,投资管理部副总监,现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

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。

叶金松先生,大学,会计师。历任美菱股份有限公司财务部经理,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。

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。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。自2008年12月23日起任长盛积极配置债券型证券投资基金(本基金)基金经理。

刘静女士,1977年1月出生。毕业于中央财经大学,获经济学硕士。2000年7月至2003年6月就职于北京证券有限责任公司;2003年7月加入长盛基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、首席债券交易员。自2006年11月29日起任长盛货币市场基金基金经理,自2008年8月13日起兼任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,自2008年10月8日起兼任长盛积极配置债券型证券投资基金(本基金)基金经理。

吴达先生,1979年8月出生,伦敦政治经济学院金融经济学硕士,CFA。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理,专户投资组合经理;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。自2008年10月10日起任长盛积极配置债券型证券投资基金(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,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总经理助理兼投资管理部总监,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,现任社保业务管理部总监兼固定收益部总监。

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、基金经理等职务。现任金融工程部总监,长盛中证100指数基金基金经理。

吴达先生,硕士,国际业务部总监,本基金基金经理,同上。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一)基金托管人情况

1.基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:郭树清

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:尹东

联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代号:HK0939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司普身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

2008年,中国建设银行的综合盈利能力和资产质量继续同业领先,截止2008年12月31日,中国建设银行实现净利润926.4亿元,较上年增长34%;平均资产回报率为1.3%,平均股东权益回报率为20.7%,分别较上年提高0.16个百分点和1.18个百分点,居全球银行业最好水平;每股盈利为0.4元,比上年增长0.10元;总资产达到75,554.52亿元,较上年增长14.51%;资产质量稳步上升,不良贷款额和不良贷款率实现双降,信贷资产质量持续改善,不良贷款率为2.21%,较上年下降0.39个百分点;拨备水平充分,拨备覆盖率为131.58%,较上年提升27.17个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行,在伦敦、纽约、悉尼设有代表处,纽约分行、伦敦子银行正式获颁营业执照。中国建设银行在香港拥有建行亚洲和建银国际两家全资子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)31,896台,居全球银行业首位。

2008年,中国建设银行在英国《金融时报》公布的「全球500强」中列第20位;在美国《财富》杂志公布的全球企业500强中由上年的第230位上升至第171位;被《福布斯(亚太版)》评为“亚太地区最佳上市公司50强”;被《银行家》杂志评为“中国商业银行竞争力(财务指标)第一名”和“最佳商业银行”;被美国《环球金融》杂志 评为“最佳公司贷款银行”和“最佳按揭贷款银行”;荣获香港上市公司商会“公司管治卓越奖”、《亚洲银行家》杂志“零售风险管理卓越奖”、中国民政部颁发的“中华慈善奖–最具爱心内资企业奖”和香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”等奖项。

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

2.主要人员情况

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

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

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

3.基金托管业务经营情况

截止到2009年6月30日,中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、国泰金盛封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等7只封闭式证券投资基金,以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长贰号混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费品股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华–道琼斯88指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票(LOF)、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合(LOF)、华夏中小板ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票(LOF)、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票(LOF)、华宝兴业行业精选股票、工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票(QDII)、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票(QDII)、海富通中国海外股票(QDII)、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信2026周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票(QDII)、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票(LOF)、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合、长城双动力股票、上投摩根中小盘股票、华商收益增强债券、泰达荷银品质生活股票、光大保德信均衡精选股票、银河行业优选股票、海富通领先成长股票、诺德增强收益债券、工银瑞信沪深300指数、信诚经典优债债券、国泰双利债券、民生加银品牌蓝筹混合、信达澳银稳定价值债券、中欧稳健收益债券、万家精选股票、浦银安盛精致生活混合、长盛同庆可分离交易股票、富国优化增强债券、长城景气行业龙头混合等108只开放式证券投资基金。

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)82255818–263,288

传真:(010)82255981,82255982,82255983

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)68889056

传真:(021)68889156

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)中国建设银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街25号

法定代表人:郭树清

电话:(010)67597114

联系人:王琳

(2)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)66594853

传真:(010)66594946

联系人:靳晓杰

客户服务电话:95566

网站:www.boc.cn

(3)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

(4)中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址:北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址:北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人:刘安东

联系人:陈春林

传真:010–66415194

客户服务电话:11185

网址:www.psbc.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:秦晓

电话:0755–83198888

传真:0755–83195109

联系人:兰奇

客户服务电话:95555

网站:http://www.cmbchina.com/

(6)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:孔丹

客服电话:95558

联系人:金蕾

电话:010–65557013

传真:010–65550827

网址:http://bank.ecitic.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

法定代表人:董文标

客户服务电话:95568

网站:www.cmbc.com.cn

(8)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)66107900

传真:(010)66108013

联系人:王佳

客户服务电话:95588

公司网址:www.icbc.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:汤惠惠、龚谷云

客户服务热线:95528

网站:www.spdb.com.cn

(10)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:刘丰

电话:(010)85238421

传真:(010)85238680

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

(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)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

(13)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:北京市朝阳门内大街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:权朋

(14)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

(15)东北证券股份有限公司

住所:长春市人民大街138–1号

办公地址:长春市人民大街138–1号

法定代表人:李树

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:潘皓

公司网址:www.nesc.cn

(16)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

(17)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

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

(18)中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)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

法定代表人:胡长生

电话010)66568047

联系人:李洋

客服:400–8888888

银河网址:www.chinastock.com.cn

(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)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

电话:(020)87555888

传真:(020)87557985

联系人:肖中梅

公司网站:www.gf.com.cn

(22)华泰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)82492062

联系人:盛宗凌

客户服务电话:400–8888–555,(0755)25125666

公司网站:www.lhzq.com

(23)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

(24)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号万凯国际商务楼A座

办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯国际商务楼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

(25)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

(26)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转63266

传真:(010)84865560

联系人:陈忠

(27)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

(28)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

(29)长江证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客服电话:4008–888–999

联系人:李良

委托电话:4008–888–318

电话:021–63219781

传真:027–85481900

网址:www.cjsc.com.cn

(30)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

(31)第一创业证券有限责任公司

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

联系电话:0755–25832686

网址:www.fcsc.cn

(32)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

(33)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,100140

法定代表人:刘弘

联系人:谢亚凡、田文健

电话:010–59226788

网站:www.ubssecurities.com

(34)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:杨小阳

联系人:刘权

电话:0755–82026521

传真:0755–82026539

(35)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

法定代理人: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

(36)江南证券有限责任公司

注册地址:南昌市抗洪北路291号

法定代理人:姚江涛

联系人:戴蕾

电话:0791–6768763

客户服务热线:400–8866–567

网址:www.scstock.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:戴君栖

(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:北京市东城区页院六号E座9层

办公地址:北京市东城区页院六号E座9层

法定代表人:王卫东

电话:(010)65171188

传真:(010)65176800

经办律师:田璧、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路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:长盛积极配置债券型证券投资基金

六、基金的类型

基金类型:契约型开放式

七、基金的投资目标

在控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

八、基金的投资范围

本基金主要投资固定收益类品种,投资范围包括:债券、中央银行票据、资产支持证券、债券回购以及中国证监会批准的允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金还可以参与一级市场新股申购以及在二级市场上投资股票、权证等权益类证券。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。

本基金投资于债券等固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,其中,权证投资的比例不超过基金资产的3%;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%。

九、基金的投资策略与程序

(一)资产配置策略

本基金为积极投资策略的债券型基金,不同与传统债券型基金的投资策略特点,本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。本基金具体投资策略如下:

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。通过全面研究国民经济运行状况,分析宏观经济运行的可能情景,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。

组合久期是反映利率风险最重要的指标,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。

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,例如:子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

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。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动,通过深入分析市场参与者的立场和观点,充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者税收待遇等因素导致的市场失衡机会,形成相对价值投资策略,为本基金的投资带来增加价值。

5. 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。

6. 可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,以合理价格买入并持有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

7. 资产支持证券等品种投资策略

包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。

8. 股票投资策略

本基金的股票投资包括股票一级市场投资和股票二级市场投资。

(1)一级市场新股投资策略

在参与股票一级市场投资的过程中,本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面,运用长盛基金的研究平台和股票估值体系,深入发掘新股内在价值,结合市场估值水平和股市投资环境,充分发挥本基金作为机构投资者在新股询价发行过程中的对新股定价所起的积极作用,积极参与新股的申购、询价与配售,有效识别并防范风险,以获取较好收益。

(2)二级市场股票投资策略

当本基金管理人判断市场出现明显的投资机会,或行业(个股)的投资价值被明显低估时,本基金可以直接参与股票二级市场投资,努力获取超额收益。在构建二级市场股票投资组合时,本基金管理人强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合,运用数量模型分析方法,包括股票评级系统、行业评级系统、价值成长模型及风险管理系统等挖掘价值被低估的股票,从而构建本基金的股票投资组合。

9. 权证投资策略

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。主要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,估计权证合理价值。根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”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。

(二)投资管理程序

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的团队决策管理模式,建立了严谨、科学的投资管理流程,具体包括投资研究、投资决策、组合构建、交易执行和风险管理及绩效评估等全过程,如图1所示。

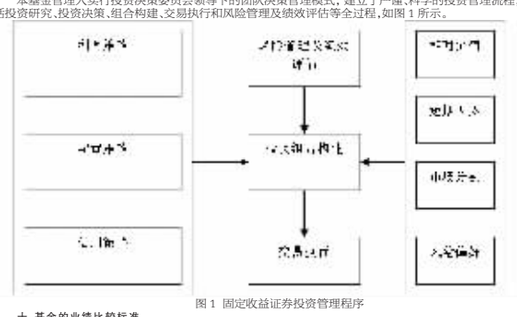

图1 固定收益证券投资管理程序

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%

十一、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。

十二、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据取自长盛积极配置债券型证券投资基金2009年第2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	20,161,900.00	6.29
	其中:股票	20,161,900.00	6.29
2	固定收益投资	254,331,788.60	79.31
	其中:债券	254,331,788.60	79.31
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	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	40,071,677.40	12.50
6	其他资产	6,107,742.48	1.90
7	合计	320,673,108.48	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	2,582,200.00	0.82
C	制造业	6,080,200.00	1.92
C0	食品、饮料	1,080,000.00	0.34
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–