

## Disclosure

**重要提示**  
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。  
基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2007年10月23日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。  
基金管理人承诺以诚信信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。  
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。  
本基金报告期为2007年7月1日起至2007年9月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

**二、基金产品概况**

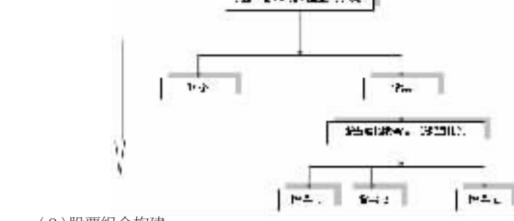
1.基金名称：长盛中证100指数证券投资基金  
2.基金类别：股票型开放式基金  
3.基金合同生效日：2006年11月12日  
4.报告期末基金份额总额：1,073,318,932.27份  
5.投资目标：本基金将通过被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值增长率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在4%以下，以实现对基金净值的长期跟踪。  
6.投资策略  
本基金完全采用被动式指数基金策略，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基本权数构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。  
当单只成份股发生调整和成份股发生分红、配股、增发等行为时，因基金的申购和赎回等对基金净值产生影响时，或因某些特殊情况（如基金分拆和合并）进行相应调整。  
调仓比例：当单只成份股在指数中的权重变化达到±0.5%时，本基金公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

(B) 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所有成份股的最新数据，决定成份股审核结果（指数组成股及其权重）。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指数成份股因送股、派息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报告公告日次日公布的临时调整决定及其调整后的权重比例，进行相应调整。  
调仓比例：当单只成份股在指数中的权重变化达到±0.5%时，本基金公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

(C) 对指数的调整  
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基金保有比时，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  
当单只成份股因停牌、被暂停上市、被实施特别处理、或因基金的申购和赎回等对基金净值产生影响时，或因某些特殊情况（如基金分拆和合并）进行相应调整。  
调仓比例：当单只成份股在指数中的权重变化达到±0.5%时，本基金公司调整决定公布日至该股票除权日之前。

7.业绩比较基准  
中证100指数×95%+一年期银行存款利率(税后)×5%  
8.风险收益特征  
本基金以追求基准指数长期增长的稳定的收益为宗旨，采用自上而下的两级资产配置策略，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。

## 长盛中证100指数基金投资策略体系



(2) 股票组合构建  
A. 基准指数构建  
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的基本权数构建指数化股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

B. 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所占的权重。

C. 资产配置  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

D. 风险控制  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

E. 投资组合管理  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

F. 风险控制  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

G. 基金管理人  
长盛基金管理有限公司

H. 基金托管人  
中国农业银行

I. 其他重要费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

J. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

K. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

L. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

M. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

N. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

O. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

P. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Q. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

R. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

S. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

T. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

U. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

V. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

W. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

X. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Y. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Z. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

A. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

B. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

C. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

D. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

E. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

F. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

G. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

H. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

I. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

J. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

K. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

L. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

M. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

N. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

O. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

P. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Q. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

R. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

S. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

T. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

U. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

V. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

W. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

X. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Y. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Z. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

A. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

B. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

C. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

D. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

E. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

F. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

G. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

H. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

I. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

J. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

K. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

L. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

M. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

N. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

O. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

P. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Q. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

R. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

S. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

T. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

U. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

V. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

W. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

X. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Y. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Z. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

A. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

B. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

C. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

D. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

E. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

F. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

G. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

H. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

I. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

J. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

K. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

L. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

M. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

N. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

O. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

P. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Q. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

R. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

S. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

T. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

U. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

V. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

W. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

X. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Y. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

Z. 其他费用  
本基金将根据市场情况，适时调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例。

A. 其他费用