

长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

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：

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2012 年 4 月 25 日证监许可〔2012〕549 号文核准的《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议》，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金”。自 2012 年 5 月 12 日起，由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》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，本基金的特定风险等。本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收

益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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。

投资有风险,投资人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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行承担。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2012年11月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效的日期:2012年5月12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: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26日成立,注册资本为人民币15000万元。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2012年11月12日,基金管理

人共管理两只封闭式基金、二十一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

凤良志先生，董事长，管理学博士，经济学硕士，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，国元证券股份有限公司董事长。现任国元证券股份有限公司董事、党委书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任公司党委书记。

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控股有限公司董事长、党委书记。

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总裁。现任国元证券股份有限公司董事长、党委副书记，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。

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，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。

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，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，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、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，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、监事会成员

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，安徽省投资集团有限责任公司资本运营部经理、总经理助理、总经济师。现任安徽省投资集团控股有限公司党委委员、副总经理。

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，历任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、管理层成员

凤良志先生，董事长，管理学博士，经济学硕士，高级经济师。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。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

王宁先生，1971年10月出生。毕业于北京大学光华管理学院，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等职务。现任公司总经理助理，权益投资部总监，自2012年5月12日起任长盛同庆中证800指数分级证券投资基金（本基金）基金经理，自2012年7月20日起兼任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

王超先生，1981年9月出生。中央财经大学硕士，中国科学技术大学金融工程专业在读博士，金融风险管理师(FRM)。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，从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。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2012年7月20日起兼任长盛同庆中证800指数分级证券投资基金（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，EMBA，总经理助理，权益投资部总监。同上。

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，现任公司总经理助理，研究部总监，同盛证券投资基金基金经理。

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，历任星展珊瑚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。

蔡宾先生，中央财经大学硕士，美国特许金融分析师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等职务。现任固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

刘斌先生，清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、

基金经理助理、长盛沪深 300 指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部执行总监，长盛量化红利策略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，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。

邓永明先生，学士。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005 年 7 月底加入长盛基金管理有限公司，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任权益投资部副总监，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

李庆林先生，硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究发展部副总监。现任社保组合组合经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同祥泛资源主题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。

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：王洪章

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

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(股票代码：939)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 股公司晋身恒生指数。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 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2011 年 9 月 30 日，中国建设银行资产总额 117,723.30 亿元，较上年末增长 8.90%。截至 2011 年 9 月 30 日止九个月，中国建设银行实现净利润 1,392.07 亿元，较上年同期增长 25.82%。年化平均资产回报率为 1.64%，年化加权平均净资产收益率为 24.82%。利息净收入 2,230.10 亿元，较上年同期增长 22.41%。净利差为 2.56%，净利息收益率为 2.68%，分别较上年同期提高 0.21 和 0.23 个百分点。手续费及佣金净收入 687.92 亿元，较上年同期增长 41.31%。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 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、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球 13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行 33 家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011 年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的 50 多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011 年“世界银行品牌 500 强”中位列第 10，较去年上升 3 位；在美国《财富》世界 500 强中排名第 108 位，较去年上升 8 位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁

发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”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、QFII 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、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2. 主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，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。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，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

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

（二）基金托管人的内部控制制度

1. 内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2. 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3. 内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1. 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2. 监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与

基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

(一) 基金份额销售机构

1. 场外直销机构

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. 场外代销机构

(1) 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：何奕

电话：010-67596093

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(2) 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：肖钢

联系人：吴雪妮

电话：010—66594851

传真：010—66594946

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(3) 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：蒋超良

联系人：刘一宁

电话：010-85108227

传真：010-85109219

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(4) 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：陈春林

电话：010-68858101

传真：010-68858117

客户服务电话：95580

公司网址：www.psbc.com

(5) 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

联系人：林芳

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(6) 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

(7) 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：田国立

联系人：赵树林

电话：010-65556960

传真：010-65550981

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

(8) 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：刘玲

电话：021-52629999

传真：021--62569070

客户服务电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

（9）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：虞谷云

电话：021—61616206

传真：021—63604199

客户服务电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（10）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：董文标

联系人：董云巍

电话：010-57092851

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

（11）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

联系人：祝丽萍

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

公司网址：www.gyzq.com.cn

(12) 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：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc.com.cn

(13) 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

联系人：李笑鸣

联系电话：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客服电话：400-8888-001、(021) 962503

公司网址：www.htsec.com

(14) 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

公司网址：www.95579.com

(15) 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

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943237

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

公司网址：www.newone.com.cn

(16) 华福证券有限责任公司

住所：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：张腾

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

(17) 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

联系人：李清怡

电话：021-54033888

传真：021-54035333

客户服务电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.sywg.com

(18) 第一创业证券股份有限公司

住所：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：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人：刘学民

联系人：崔国良

电话：(0755) 25832852

传真：(0755) 25831718

客户服务电话：4008881888

公司网址：www.fcsc.com

(19) 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：陈有安

联系人：田薇

电话：(010) 66568430

传真：(010) 66568536

客服电话：400-888-8888

公司网站：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：万建华

联系人：芮敏祺

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

(21) 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

(22) 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

联系人: 安岩岩

开放式基金咨询电话: 4006000686

开放式基金业务传真: (0431) 85096795

公司网址: www.nesc.cn

(23) 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: 牟冲

电话: 010-5832-8112

客户服务热线: 400-887-8827

公司网址: www.ubssecurities.com

(24) 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

客户服务热线: 400-8866-567

公司网址: www.avicsec.com

(25) 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

客服电话：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

（26）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

开放式基金业务传真：0755-82400862

客服电话：95511—8

公司网址：www.pingan.com

（27）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

公司网址：www.qlzq.com.cn

（28）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

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

(29) 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

(30) 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：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(31) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：95503

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

(32) 中国国际金融有限公司

住所：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：李剑阁

联系人：罗春蓉，武明明

联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部

公司网站：www.cicc.com.cn

(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

联系人：程高峰

电话：025-84457777-893

传真：025-84579763

客户咨询电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(34) 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

公司网址：www.ecitic.com

(35) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：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

(266061)

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(36) 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

客服服务热线：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(37) 中信证券（浙江）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

(38) 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

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：李春芳

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000 400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

(39) 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：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

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

统一客服电话：4008001001

公司网址：www.essence.com.cn

（40）国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦

办公地址：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

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

（41）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

客服热线：4006 19 8888

公司网址：www.msyzq.com

（42）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

客服电话 400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

（43）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：雷波

联系人姓名：王丹

联系人电话：028-86690125

联系人传真：028-86690126

客服电话：028-95105111

公司网址：www.gjq.com.cn

（44）华龙证券有限责任公司

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、96668

公司网址：www.hlzqgs.com

（45）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：张宇宏

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.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：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：洪家新

联系人姓名：陈敏

联系人电话：021-64339000

联系人传真：021-64333051

客户服务电话：021-32109999、029-68918888

公司网址：www.cfsc.com.cn

(47) 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 A 座三、五层

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三、五层

法定代表人：宋德清

联系人：陶颖

电话：010-58568040

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

公司网址：www.hrsec.com.cn

(48) 深圳众禄基金销售有限公司

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：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：汤素娅

联系电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(49) 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：021-38509700

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

3. 场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员可办理本基金的场内申购、赎回业务。具体名单如下：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：（010）59378888

传真：（010）66210938

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：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：黎明

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、张晓艺

五、基金的名称

本基金名称：长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

六、基金的类型

基金类型：契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值

控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，以实现中证 800 指数的有效跟踪。

八、基金的投资范围

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）、权证、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）。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，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%。

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。

九、基金的投资策略

本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证800指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。

1. 资产配置策略

本基金采用两层资产配置策略，首先确定基金资产在股票和现金之间的配

置比例，再进一步以抽样复制基准指数的方法，确定抽样组合中各股票的配置比例。本基金股票资产原则上不低于基金资产净值的90%，在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

2.股票投资组合构建

本基金通过抽样复制指数的方法，在综合考虑个股的自由流通市值规模、个股流动性、行业代表性、波动性以及抽样组合与标的指数的相关性等因素的基础上，采用“分层抽样+优化抽样”的方法，选择标的指数成份股票或被选成份股票构建基金的抽样股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股配置比例。

（1）股票筛选

本基金在抽样复制指数投资时，首先进行样本成份股初步筛选，通常初步筛选的股票样本为标的指数全部成份股和备选成份股，作为下一步分层抽样的基础。但在特殊情况下，如指数成份股调整、长期停牌或样本个股流动性极差时，则相应调整股票初选股票样本或剔除流动性极差的股票样本。

（2）分层抽样

在标的指数成份股中初选出样本股票的基础上，首先按照通用的行业分类方法进行类别划分，然后根据每个行业中个股的流通市值权重、所在行业中的权重比例、个股收益波动性和行业收益相关性进行抽样选取，原则上优先抽取收益波动与标的指数高度相关的个股。

在分层抽样中，首先控制约束抽样股票组合中的行业比例及收益风险特征代表性与标的指数一致，且控制抽样组合中的行业内样本个股与行业整体的收益风险特征高度相关。

（3）优化抽样

对于分层抽样后的股票样本组合，采用进一步优化方法并确定个股的权重，考虑标的指数总体收益和风险的特征情况，基于标的指数的跟踪误差限制为约束指标，通过投资组合优化模型构建基金的股票资产组合。

（4）最终组合

对于“分层抽样+优化抽样”方法得到的股票组合，将被用来构建本基金的最最终股票组合。为了能够更好的跟踪标的指数，如果今后由于基准指数成份股结

构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告，并阐明变更抽样复制方法的原因。

3. 股票组合调整

(1) 组合调整原则

本基金为抽样复制的指数型基金，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、配股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(2) 组合调整方法

①跟踪调整

A、定期性调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的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。

本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合，将每季度末根据上述抽样复制方法调整股票组合及个股配置比例。

B、不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、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，并根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。

C、基于流动性及法律法规限制的调整

如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素或法律法规规定的投资限制，使得基金管理人无法顺利购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循“同行业基础上价格相关性”原

则，对于需要进行替代的股票，其替代股票将从标的指数样本或被选成份股中选取，具体将在考虑股票流动性等因素的前提下，在同行业范围内，选取相关性较大的股票进行替代。

D、在其他不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，对基金资产组合进行适当的调整。

4. 债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

5. 权证投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则对权证进行投资，即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。

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准=95%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够有效地反映本基金的风险收益特征。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推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准。本基金变更业绩比较基准应报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒体上及时公

告。

十一、基金的风险收益特征

本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

从本基金所分拆的两类基金份额来看，由于基金收益分配的安排，同庆 A 份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；同庆 B 份额则表现出高风险、预期收益相对较高的特征。

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——中国建设银行股份有限公司根据本基金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《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2012 年度第 3 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	4,222,570,411.43	93.46
	其中：股票	4,222,570,411.43	93.46
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	276,184,441.65	6.11
6	其他资产	19,421,472.51	0.43
7	合计	4,518,176,325.59	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 指数投资部分

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	40,025,244.35	0.90
B	采掘业	377,285,722.00	8.45
C	制造业	1,649,498,258.87	36.94
C0	食品、饮料	305,380,972.24	6.84
C1	纺织、服装、皮毛	40,374,647.04	0.90
C2	木材、家具	2,947,095.69	0.07
C3	造纸、印刷	5,747,683.94	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	159,876,857.65	3.58
C5	电子	124,080,907.91	2.78
C6	金属、非金属	303,375,309.12	6.79
C7	机械、设备、仪表	460,313,764.21	10.31
C8	医药、生物制品	234,588,939.26	5.25
C99	其他制造业	12,812,081.81	0.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	109,665,771.52	2.46
E	建筑业	113,506,089.11	2.54
F	交通运输、仓储业	126,564,616.82	2.83
G	信息技术业	160,029,243.81	3.58
H	批发和零售贸易	140,918,457.08	3.16
I	金融、保险业	1,027,627,530.78	23.02
J	房地产业	296,449,152.35	6.64
K	社会服务业	59,022,642.40	1.32
L	传播与文化产业	35,252,357.99	0.79
M	综合类	85,558,580.35	1.92
	合计	4,221,403,667.43	94.54

(2) 积极投资部分

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	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	1,166,744.00	0.03
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,166,744.00	0.03

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

(1) 报告期末指数投资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	601318	中国平安	2,342,448	98,242,269.12	2.20
2	000002	万科 A	10,885,141	91,761,738.63	2.06
3	600016	民生银行	15,681,011	88,597,712.15	1.98
4	600036	招商银行	8,555,947	86,928,421.52	1.95
5	601328	交通银行	16,719,109	71,223,404.34	1.60
6	600519	贵州茅台	286,120	70,328,296.00	1.58
7	601398	工商银行	17,704,448	66,391,680.00	1.49
8	601166	兴业银行	5,226,691	62,772,558.91	1.41
9	600000	浦发银行	7,769,317	57,337,559.46	1.28
10	600030	中信证券	4,794,158	56,523,122.82	1.27

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000089	深圳机场	312,800	1,166,744.00	0.03

注：截止本报告期末本基金仅持有一只积极投资股票。

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

8.1 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。

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。

8.2 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。

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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,284,784.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	944,328.24
4	应收利息	48,938.48
5	应收申购款	14,143,421.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,421,472.51

9. 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处于转股期的可转换债券。

10. 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

11. 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

12. 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

原长盛同庆基金成立以来的业绩如下：

阶段	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	超额收益率
2009年5月12日(原长盛同庆基金基金合同生效日)至2009年12月31日	10.90%	21.63%	-10.73%
2010年度	-4.06%	-7.50%	3.44%
2011年度	-24.06%	-16.47%	-7.59%
2012年1月1日至2012年5月11日	8.91%	9.11%	-0.20%
2009年5月12日(原长盛同庆基金基金合同生效日)至2012年5月11日	-12.00%	2.54%	-14.54%

自基金转型以来的业绩如下：

阶段	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	超额收益率
2012年5月12日(长盛同庆中证800指数分级基金基金合同生效日)至2012年9月30日	-10.78%	-12.54%	1.76%

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. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格

确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 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，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

（四）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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公

告。

（六）基金税收

基金和基金份额持有人根据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，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

（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）在“释义”中更新了有关本基金基金份额的释义。

（三）更新了“三、基金管理人”中基金管理人的相关信息。

（四）更新了“五、相关服务机构”中相关服务机构的相关信息。

（五）在“六、基金的历史沿革”中新增了有关本基金封闭期到期转换的相关信息。

（六）删除了原招募说明书中的“八、原长盛同庆基金封闭期到期后基金份额的转换”中的相关内容。

（七）在“八、分级运作期基金份额的分类与参考净值计算规则”中，更新了相关内容。

（八）在“九、基金份额的上市交易”中，更新了相关内容。

（九）在“十、长盛同庆份额的申购与赎回”中，更新了相关内容。

（十）在“十一、基金份额的配对转换”中，更新了相关内容。

（十一）在“十三、基金的投资”中，更新了“（十三）投资组合报告”的相关内容。

（十二）更新了“十四、基金的业绩”的相关内容。

（十三）增加了“二十八、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2012年11月16日签署。

长盛基金管理有限公司

二〇一二年十一月二十七日