

长盛同丰分级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：中国银行股份有限公司

重要提示：

本基金 2012 年 11 月 19 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1543 号文核准募集。

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。

本基金基金合同生效后 18 个月内（含 18 个月）为基金分级运作期，同丰 A 自基金合同生效日起于同丰 A 的开放日接受申购赎回，同丰 B 封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。基金分级运作期届满，本基金转为长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）。

总体来看，本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其长期预期收益和平均风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。从投资者具体持有的基金份额来看，在分级基金运作期内，本基金经过基金份额分级后，同丰 A 为低风险、收益相对稳定的稳健收益特征的基金份额，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；同丰 B 为较高风险、较高收益的增强收益特征的基金份额，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：市场

风险、信用风险、流动性风险、操作风险、管理风险、合规性风险、本基金的特定风险及其他风险，等等。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，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。

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人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2013 年 6 月 27 日。有关财务数据和净值表现截止日为 2013 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效的日期：2012 年 12 月 27 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 2013 年 6 月 27 日，基金管理人

共管理两只封闭式基金、二十七只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理多只专户理财产品。

（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。

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。

钱正先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽省人大常委会办公厅副处长、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。

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。

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。

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。

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。

邓永明先生，监事，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。现任长盛基金管理有限公司权益投资部副总监，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。

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

杨衡先生，1975年10月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理。自2012年10月26日起任长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理，自2012年11月29日起兼任长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理，自2012年12月27日起兼任长盛同丰分级债券型证券投资基金（本基金）基金经理，自2013年3月13日起兼任长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

（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。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等职务。现任公司总经理助理，权益投资部总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

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。现任国际业务部总监，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、长盛同禧信用增利债券型证券投资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，监事，学士。同上。

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，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等职务。现任社保组合组合经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

行长：李礼辉

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截至 2013 年 6 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选 LOF、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化先行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、

国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证 500 沪市交易型开放式指数、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证 300 指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利 30 天理财债券型、信诚理财 7 日盈债券型、长盛添利 60 天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财 21 天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票 50 指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、汇添富理财 21 天债券型发起式、国泰国证房地产业指数分级、招商央视财经 50 指数、嘉实中证中期企业债指数、大成中证 100 交易型开放式指

数、长盛纯债债券型、华夏双债增强债券型、泰达宏利信用合利定期开放债券型、招商安润保本混合型、长盛上证市值百强交易型开放式、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接、南方中债中期票据指数债券型发起式、嘉实中证金边中期国债交易型开放式、嘉实中证金边中期国债交易型开方式指数证券投资基金联接、国投瑞银中高等级债券型、上投摩根成长动力混合型、嘉实丰益纯债定期开放债券型、大成景兴信用债债券型、海富通养老收益混合型、广发聚鑫债券型、泰达宏利高票息定期开放债券型、长盛季季红 1 年期定期开放债券型、诺安信用债券一年定期开放债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普 500 等权重指数(QDII)、长信标普 100 等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球自然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型(QDII)、建信全球资源股票型(QDII)、恒生交易型开放式指数(QDII)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接(QDII)、广发纳斯达克 100 指数(QDII)、工银瑞银标普全球自然资源指数证券投资基金(LOF-QDII)、嘉实美国成长股票型证券投资基金(QDII)等 214 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

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

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 20 层

法定代表人：凤良志

邮政编码：100088

电话：(010) 82019799、82019795

传真：(010) 82255981、82255982

联系人：张莹、张晓丽

2. 代销机构

(1) 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

行长：李礼辉

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

(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：王嘉朔

电话：010-67596220

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(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

联系人：张作伟

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(4) 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

(5) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：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：高阳

电话：010—85109219

传真：010—85109219

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(6) 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

(7) 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

公司网站：www.cib.com.cn

(8) 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

(9) 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

(10) 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

公司网址：www.chinastock.com.cn

(11) 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

(12) 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

(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) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 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：上海市静安区新闸路 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、95525

公司网址：www.ebscn.com

(19) 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

(20) 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

（21）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

（22）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

（23）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

(24) 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

(25) 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

公司网址：www.dfzq.com.cn

(26) 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

(27) 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

（28）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

（29）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

（30）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：金立群

联系人：罗春蓉，武明明

联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部

公司网址： www.cicc.com.cn

(31) 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

(32) 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

全国统一服务热线：4006-600109 地区服务热线：95105111（四川）

公司网址：www.gjzq.com.cn

(33) 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

(34) 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
客服电话：021-32109999、029-68918888
公司网址：www.cfsc.com.cn

(35) 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：张同亮
电话：021-68405273
传真：021-68405181
客户服务电话：0471-4961259
公司网址：www.cnht.com.cn

(36) 渤海证券股份有限公司

住所：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：杜庆平
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
客户服务电话：400-651-5988
公司网址：www.bhzq.com

(37) 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

（38）东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：汪汇

开放式基金咨询电话：95531、400-8888-588

开放式基金业务传真：(021) 58319590

公司网址：www.longone.com.cn

（39）华安证券有限责任公司

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

（40）财通证券有限责任公司

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

(41) 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

(42) 山西证券股份有限公司

办公(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

法定代表人: 侯巍

联系人: 郭熠

联系电话: 0351-8686659

传真: 0351-8686619

客服电话: 400-666-1618、95573

公司网址: www.i618.com.cn

(43) 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

(44) 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

公司地址：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

(45) 浙商证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7

法定代表人：吴承根

联系人：李凌芳

电话：021-64718888

传真：021-64713795

客户服务电话：0571967777

公司网址：www.stocke.com.cn

(46) 东莞证券有限责任公司

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：0769-221100155

传真：0769-22119426

客户服务电话：0769-961130

公司网址：www.dgzq.com.cn

(47) 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

公司网址：www.gf.com.cn

（48）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

（49）湘财证券有限责任公司

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

办公地点：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

电话：021-68634510-8620

传真：021-68865680

联系人：赵小明

客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

（50）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：010-6655

客服电话：4008888993

公司网址：www.dxzq.net

(51) 国都证券有限责任公司

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

法定代表人：常喆

联系人：黄静

总机：010-84183333

传真：010-84183311

客服热线：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

(二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

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) 59378907

联系人：朱立元

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：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(特殊普通合伙)

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：长盛同丰分级债券型证券投资基金

六、基金的类型

基金类型：契约型。

本基金基金合同生效之日起18个月内，同丰A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次，同丰B封闭运作并上市交易；本基金基金合同生效后18个月届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

七、基金份额的分级

（一）基金份额分级

本基金基金合同生效之日起18个月内，本基金的基金份额划分为同丰A、同丰B两级份额，所募集的基金资产合并运作。

1. 基金份额配比

同丰A、同丰B的份额配比原则上不超过7：3。

本基金募集设立时，同丰A、同丰B的份额配比将不超过7：3。

本基金在分级基金运作期内，同丰A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次，同丰B封闭运作并上市交易。在同丰A的每次开放日，基金管理人将对同丰A进行基金份额折算，同丰A的基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的同丰A份额数按折算比例相应增减。为此，在同丰A的单个开放日，如果同丰A没有赎回或者净赎回份额极小，同丰A、同丰B在该次开放日后的份额配比可能会出现大于7：3的情形；如果同丰A的净赎回份额较多，同丰A、同丰B在该次开放日后的份额配比可能会出现小于7：3的情形。

2. 同丰A的运作

（1）收益分配

同丰 A 的约定年化基准收益率为 4.25%，其应得收益的金额采用单利计算，年化收益率及收益均以基金份额的认购面值为基准进行计算。

本基金净资产优先分配予同丰 A 的本金及约定应得收益，剩余净资产分配予同丰 B；在分级运作期内每个开放日，如本基金净资产等于或低于同丰 A 的本金及约定应得收益的总额，本基金净资产全部分配予同丰 A 后，仍存在额外未弥补的同丰 A 本金及约定收益总额的差额，则不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证每个开放日同丰 A 份额持有人的约定应得收益，即如在分级运作期间本基金资产出现极端损失情况下，同丰 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金受损的风险。

(2) 开放日

同丰 A 在基金合同生效后每满 6 个月开放一次，接受投资者在场外的申购与赎回，同丰 A 的开放日为自基金合同生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日自不可抗力或其他情形影响因素消除之日起顺延。

同丰 A 的第一次开放日为基金合同生效日至 6 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第二次开放日为基金合同生效之日起至 12 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第三次开放日为基金合同生效之日起至 18 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日。

例如，假设本基金基金合同于 2012 年 5 月 10 日（周四）生效，基金合同生效之日起满 6 个月、满 12 个月、满 18 个月的日期分别为 2012 年 11 月 9 日（周五）、2013 年 5 月 9 日（周四）、2013 年 11 月 9 日（周六）。由于 2013 年 11 月 9 日为非工作日，在其之前的最后一个工作日为 2013 年 11 月 8 日（周五），因此，同丰 A 的第一次、第二次、第三次开放日分别为 2012 年 11 月 9 日、2013 年 5 月 9 日和 2013 年 11 月 8 日。

(3) 基金份额折算

本基金基金合同生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日，基金管理人将对同丰 A 进行基金份额折算，同丰 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人持有的同丰 A 份额数按折算比例相应增减。

同丰 A 的基金份额折算基准日与开放日为同一天工作日。

同丰 A 的基金份额折算具体见本招募说明书第“九、同丰 A 的基金份额折算”以及基金管理人届时发布的相关公告。

(4) 规模限制

本基金在分级运作期内，同丰 A 的份额余额原则上不得超过 7/3 倍同丰 B 的份额余额。

3. 同丰 B 的运作

(1) 同丰 B 封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。

同丰 B 的封闭期为自基金合同生效之日起至 18 个月后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时在最后一个开放日开放同丰 A 的申购与赎回的，同丰 B 的封闭期届满日也一并顺延。

接前例，假设本基金基金合同于 2012 年 5 月 10 日（周四）生效，则基金合同生效之日起 18 个月后对应日为 2013 年 11 月 10 日（周日）。由于该对应日为非工作日，则同丰 B 的封闭期至 2013 年 11 月 11 日（周一）止。

(2) 本基金基金合同生效后 3 个月内，在符合上市条件的情况下，同丰 B 将申请在深圳证券交易所上市交易。

(3) 本基金在扣除同丰 A 的本金及应计收益后的全部剩余资产归同丰 B 享有，亏损以同丰 B 的资产净值为限由同丰 B 承担。

4. 基金份额发售

同丰 A、同丰 B 将分别通过各自发售机构的销售网点独立进行公开发售。其中同丰 A 将通过基金管理人直销网点及本基金场外代销机构的代销网点公开发售，同丰 B 将通过场外、场内两种方式公开发售。

5. 基金份额净值计算

本基金的基金份额净值计算公式如下：

$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日闭市后的基金资产净值} / T \text{ 日基金份额的余额数量}$

本基金在分级基金运作期内，T 日基金份额的余额数量为同丰 A 和同丰 B 的份额总额；本基金根据基金合同的约定转换为上市开放式基金（LOF）后，T 日基金份额的余额数量为该 LOF 基金的份额总额。

本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五

入，由此产生的误差计入基金财产。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

6. 同丰A和同丰B的基金份额净值计算

本基金基金合同生效后，在同丰A的开放日计算同丰A的基金份额净值；基金转型时的份额转换基准日分别计算同丰A和同丰B的基金份额净值。

(1) 同丰A的基金份额净值计算

假设：

T日：同丰A的某一开放日或基金转型时的份额转换基准日

T_a ：自同丰A上一次开放日次日至T日的运作天数；如T日为第一次开放日，则为自基金合同生效日至T日的运作天数（天数的计算规则按算头算尾原则，下同）

F_{aT} ：T日同丰A的份额余额

NV_T ：T日闭市后的基金资产净值

NAV_{aT} ：T日同丰A的基金份额净值

r ：同丰A约定年化收益率4.25%

则T日同丰A的基金份额净值计算公式为：

①如果T日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00元乘以T日同丰A的份额余额加上T日全部同丰A份额应计收益之和”，则T日同丰A的基金份额净值为：

$$NAV_{aT} = 1.00 \times \left(1 + \frac{r}{365} \times T_a \right)$$

“T日全部同丰A份额应计收益”计算公式如下：

$$\text{T日全部同丰A份额应计收益} = F_{aT} \times 1.00 \times \frac{r}{365} \times T_a$$

②如果T日闭市后的基金资产净值小于“1.00元乘以T日同丰A的份额余额加上T日全部同丰A份额应计收益之和”，则T日同丰A的基金份额净值为：

$$NAV_{aT} = \frac{NV_T}{F_{aT}}$$

(2) 同丰 B 的基金份额净值计算：

假设：

T 日：基金转型时的份额转换基准日

NAV_{bT} ：同丰 B 在 T 日的基金份额净值

NAV_{aT} ：同丰 A 在 T 日的基金份额净值

F_{bT} ：T 日同丰 B 的份额余额

则 T 日同丰 B 的基金份额净值计算公式如下：

$$NAV_{bT} = \frac{NV_T - NAV_{aT} \times F_{aT}}{F_{bT}}$$

同丰 A、同丰 B 的基金份额净值的计算结果保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

接前例，假设 2013 年 5 月 9 日为同丰 A 的第二次开放日，自同丰 A 第一次开放日次日 2012 年 11 月 10 日（含）的运作天数为 181 天。在 2013 年 5 月 9 日当日，基金资产净值为 33 亿元，同丰 A、同丰 B 的份额余额分别为 21 亿份和 9 亿份，同丰 A 的约定年化收益率为 4.25%。则同丰 A、同丰 B 的基金份额净值计算如下：

同丰 A 的基金份额净值

$$= 1.00 \times [1 + (4.25\% / 365) \times 181] = 1.021 \text{ 元}$$

同丰 B 的基金份额净值

$$= (3,300,000,000.00 - 1.021 \times 2,100,000,000.00) / 900,000,000.00 \\ = 1.284 \text{ 元}$$

7. 同丰 A 和同丰 B 的基金份额参考净值计算

本基金在分级基金运作期内，基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算并公告同丰 A 和同丰 B 的基金份额参考净值；其中，同丰 A 的基金份额参考净值计算日不包括同丰 A 的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

(1) 同丰 A 的基金份额参考净值计算

假设：

T 日：同丰 A 的非开放日

T_a ：为自同丰 A 上一次开放日次日至 T 日的运作天数；如果 T 日之前同丰 A 尚未进行开放，则为自基金合同生效日至 T 日的运作天数

F_{aT} ：T 日同丰 A 的份额余额

NV_T ：T 日闭市后的基金资产净值

NAV_{aT} ：T 日同丰 A 的基金份额净值

r ：同丰 A 约定年化收益率 4.25%

本基金在分级运作期内，同丰 A 的基金份额参考净值计算公式为：

①如果 T 日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00 元乘以 T 日同丰 A 的份额余额加上 T 日全部同丰 A 份额应计收益之和”，则 T 日同丰 A 的基金份额净值：

$$NAV_{aT} = 1.00 \times \left(1 + \frac{r}{365} \times T_a \right)$$

“T 日全部同丰 A 份额应计收益”计算公式如下：

$$\text{T 日全部同丰 A 份额应计收益} = F_{aT} \times 1.00 \times \frac{r}{365} \times T_a$$

②如果 T 日闭市后的基金资产净值小于“1.00 元乘以 T 日同丰 A 的份额余额加上 T 日全部同丰 A 份额应计收益之和”，则 T 日同丰 A 的基金份额净值：

$$NAV_{aT} = \frac{NV_T}{F_{aT}}$$

(2) 同丰 B 的基金份额参考净值计算

假设：

NAV_{bT} ：同丰 B 在 T 日的基金份额参考净值

F_{bT} ：T 日同丰 B 的份额余额

T 日同丰 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

$$NAV_{bT} = \frac{NV_T - NAV_{aT} \times F_{aT}}{F_{bT}}$$

上式中，在同丰 A 的非开放日， NAV_{aT} 为同丰 A 的基金份额参考净值；在同丰 A 的开放日， NAV_{aT} 为同丰 A 的基金份额净值。

同丰 A、同丰 B 的基金份额参考净值的计算结果保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的同丰 A 和同丰 B 的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

接前例，假设在 2012 年 12 月 19 日（周三），该日自同丰 A 第一次开放日次日 2012 年 11 月 10 日（含）的运作天数为 40 天。在 2012 年 12 月 19 日当日，基金资产净值为 30.6 亿元，同丰 A、同丰 B 的份额余额分别为 21 亿份和 9 亿份，同丰 A 的约定年化收益率为 4.25%。则同丰 A、同丰 B 的基金份额参考净值计算如下：

同丰 A 的基金份额参考净值
 $= 1.00 \times [1 + (4.25\%/365) \times 40] = 1.005$ 元

同丰 B 的基金份额参考净值
 $= (3,060,000,000.00 - 1.005 \times 2,100,000,000.00) / 900,000,000.00$
 $= 1.055$ 元

（二）基金合同生效后 18 个月届满时的基金份额转换

本基金基金合同生效后 18 个月届满，本基金将根据基金合同的约定转换为上市开放式基金（LOF），本基金不再进行基金份额分级，同丰 A、同丰 B 的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。

本基金基金合同生效后 18 个月届满日前，基金管理人将提前公告并提示同丰 A 的基金份额持有人可选择在 18 个月内最后一个开放日赎回同丰 A 份额或默认届满日自动转换为上市开放式基金（LOF）份额。

本基金基金合同生效后 18 个月届满时的基金转换见本招募说明书“十二、基金转型与基金份额转换”及基金管理人届时发布的相关公告。

八、基金的投资目标

本基金投资于债券市场，基金管理人通过分析影响债券市场的各类要素，进行积极主动的投资管理，追求基金资产的稳定增值，以最大程度上取得超越业绩比较基准的收益。

九、基金的投资范围

本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、次级债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款等固定收益类金融工具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相关规定。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。

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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合上述相关规定。

十、基金的投资策略

本基金的债券投资理念是以利率风险管理为核心，以久期配置为关键技术，实现债券组合的保值增值，通过合理判断未来利率期限结构的变化，并充分考虑组合流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和债券组合期限结构；结合不同类型债券流动性、税收和信用风险等因素综合确定债券组合的类属配置；利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资运作中，还将运用灵活多样的操作策略，如：换券利差交易策略、凸性套利交易策略以及骑乘收益率曲线策略等，以尽可能地控制风险、获取超额的投资收益。

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。通过全面研究宏观经济变量(包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等),分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策、产业政策、外贸和汇率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,据此对债券组合的平均久期进行调整,提高债券组合的总投资收益。

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,通过配置各期限固定收益品种的比例,达到预期投资收益最大化的目的。

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,分析同期限的国债、央行票据、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,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。

另外,鉴于本基金特有的运作方式,在分级运作期内的同丰A的每个开放日前以及分级运作期到期转换为LOF开放申赎前,本基金将适当提高流动性较好的国债、央行票据、金融债的配置比例,以应对可能发生的大额赎回情况。

3. 信用策略

信用策略主要是根据国民经济运行周期阶段,确定各行业的优先配置顺序;研究债券发行人的产业发展趋势、行业政策、企业市场地位、财务状况、管理水平、债务水平、特殊事件风险等基本面因素,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;利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算债券发行人的违约率及违约损失率;综合发行人各方面分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相

对失衡，选择溢价偏高的品种进行投资。

本基金从以下三个方面来进行信用风险管理：（1）进行独立的发行主体信用分析，不断在实践中完善分析方法和积累分析经验数据；（2）严格遵守信用类债券的备选库制度，根据不同的信用风险等级，按照不同的投资管理流程和权限管理制度，对入库债券进行定期信用跟踪分析；（3）采取分散化投资策略和集中度限制，严格控制组合整体违约风险水平。

4. 期限管理策略

鉴于本基金特有的运作方式，本基金将结合每个开放日基金份额的申赎预估情况，在最大化收益的情况下，确定基金资产在不同剩余期限（6 个月以内、6 个月-1 年、1 年-3 年、3 年-5 年、5 年以上）固定收益类资产上配置比例。

分级运作期内，为应对同丰 A 每 6 个月的申购、赎回开放，本基金在基金合同生效后的每 6 个月期限里，都将结合最新的同类基金产品的申赎情况，持有相应比例的剩余期限在 6 个月以内的、且具有较好流动性的固定收益类资产，以锁定基础收益并在 6 个月到期基金份额开放申赎时保证流动性。同时，本基金还将结合前述利率、类属配置和信用三种策略，在不同的市场利率走势、信用环境下，动态调整投资组合的剩余期限，进行波段操作，从而提高基金收益。

分级运作期到期转换为 LOF 份额后，本基金将预估 LOF 份额的申赎情况，结合本基金的债券回购比例限制，保持适当比例的现金和流动性较高、风险较低的固定收益资产，以及时应对基金份额申赎带来的流动性风险。

5. 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。

6. 个券选择策略

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。

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。

十一、基金的业绩比较标准

中债综合指数（全价）。

中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。中债综合指数能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

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债券指数时，基金管理人和基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，可以变更本基金业绩比较基准并及时公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其长期预期收益和平均风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

在分级基金运作期内，本基金经过基金份额分级后，同丰 A 为低风险、收益相对稳定的稳健收益特征的基金份额；同丰 B 为较高风险、较高收益的增强收益特征的基金份额。

十三、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取自长盛同丰分级债券型证券投资基金 2013 年第 1 季度报告，报告截止日：2013 年 3 月 31 日。本报告中财务资料未经审计。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,746,474,220.06	86.29
	其中：债券	1,746,474,220.06	86.29
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	174,200,000.00	8.61
	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	64,041,233.03	3.16
6	其他资产	39,140,550.68	1.93
7	合计	2,023,856,003.77	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	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
	合计	-	-

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

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	270,422,153.80	13.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,180,000.00	2.49
	其中：政策性金融债	50,180,000.00	2.49
4	企业债券	1,415,849,066.26	70.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,023,000.00	0.50
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,746,474,220.06	86.63

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010303	03 国债(3)	1,484,510	145,036,627.00	7.19
2	010107	21 国债(7)	1,169,550	122,732,577.00	6.09
3	122009	08 新湖债	554,840	59,828,397.20	2.97
4	122162	12 中孚债	550,070	57,300,791.90	2.84
5	112119	12 恒邦债	549,225	55,960,535.25	2.78

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

(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) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	302,608.06
2	应收证券清算款	5,673,708.31
3	应收股利	-
4	应收利息	33,097,133.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	67,100.62
8	其他	-
9	合计	39,140,550.68

(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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(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。

十四、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

项目	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12月27日(基金合同生效日)至2012年12月31日	0.00%	0.07%	-0.07%
2013年1月1日至2013年3月31日	0.90%	0.77%	0.13%
2012年12月27日(基金合同生效日)至2013年3月31日	0.90%	0.84%	0.06%

十五、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. 基金销售服务费；
4. 因基金的证券交易或结算而产生的费用；
5. 基金合同生效以后的信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
8. 基金资产的资金汇划费用；
9. 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除。

(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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.70% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2. 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，

由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3. 销售服务费

本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令（或双方约定的方式），经基金管理人与基金托管人核对一致后，由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划出，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

4. 本条第（一）款第 4 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十六、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，增加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“释义”中，更新了基金法、销售办法的释义。

（三）在“三、基金管理人”中，更新了基金管理人的相关情况。

（四）在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人的相关情况。

（五）在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的相关信息。

（六）在“七、基金的募集”中，更新了相关内容。

（七）在“八、基金合同的生效”中，更新了相关内容。

（八）在“十、基金份额的申购与赎回”中，更新了相关内容。

（九）在“十四、基金的投资”中，增加了基金投资组合报告。

（十）增加了“十六、基金的业绩”，更新了自基金成立以来的本基金业绩表现数据。

（十一）增加了“二十八、其他应披露事项”，更新了本次招募说明书更新期间所涉及的相关信息披露。

十七、 签署日期

本招募说明书（更新）于2013年7月24日签署。

长盛基金管理有限公司

二〇一三年八月七日