

同盛证券投资基金 招募说明书

重要提示

发起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审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均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。

基金管理人承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。

	发行价格	面值	发行费用	募集资金
每份基金单位(元)	1.01	1.00	0.01	1.00
合计(亿元)	30.3	30	0.3	30

基金类型：契约型封闭式；存续期为 15 年

投资目标：通过成长价值复合型投资实现基金资产的稳定增长

基金单位发行份额：30 亿份

基金单位面值：1 元人民币

基金单位每份发行价：1.01 元，其中 0.01 元为发行费

募集资金：30 亿元人民币

发行对象：中华人民共和国境内自然人及我国境内依法设立的商业保险公司
(法律、法规及有关规定禁止购买者除外)

发行方式：上网定价发行

发行协调人：中信证券有限责任公司

发行时间：1999 年 11 月 1 日

交易安排：发行成功后将申请在深圳证券交易所上市

基金发起人：中信证券有限责任公司

湖北证券有限责任公司

天津北方国际信托投资公司

安徽省信托投资公司

长盛基金管理有限公司

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行

签署日期：1999 年 9 月 14 日

一、绪言

本招募说明书依据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则等有关法规以及《同盛证券投资基金基金契约》编写而成；全体发起人已批准本招募说明书，确信其中不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

本基金单位是根据本招募说明书所载明的资料申请发行的。本基金发起人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

二、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：指同盛证券投资基金

《基金契约》：指《同盛证券投资基金基金契约》

《暂行办法》：指《证券投资基金管理暂行办法》

本招募说明书：指《同盛证券投资基金招募说明书》

中国证监会：指中国证券监督管理委员会

基金发起人：指中信证券有限责任公司、湖北证券有限责任公司、天津北方国际信托投资公司、安徽省信托投资公司、长盛基金管理有限公司

基金管理人：指长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行

持有人：指本基金单位持有人

三、基金设立

（一）基金设立的依据

本基金由发起人依照《暂行办法》、《基金契约》及其他有关规定，并经中国证监会证监基金字【1999】第30号文批准发起设立。

（二）基金存续期间及基金类型

本基金存续期为15年，类型为契约型封闭式。

（三）基金发起人认购及持有情况

基金发起人认购基金单位总份额的 1%，即 3000 万份，其中：中信证券有限责任公司认购 600 万份，占基金单位总份额的 0.2%；湖北证券有限责任公司认购 600 万份，占基金单位总份额的 0.2%；天津北方国际信托投资公司认购 600 万份，占基金单位总份额的 0.2%；安徽省信托投资公司认购 600 万份，占基金单位总份额的 0.2%；长盛基金管理有限公司认购 600 万份，占基金单位总份额的 0.2%。

本基金发起人认购的基金单位，自基金成立之日起一年内不得转让。一年以后，在本基金存续期间，发起人持有的基金单位不得低于其认购基金单位份额的 50%，即 1500 万份基金单位，并应由每家基金发起人按发起时认购的比例分别持有。

（四）基金契约

基金契约是约定本基金当事人权利、义务的法律文件。基金投资者自取得依本基金契约所发行的基金单位，即成为基金持有人，其持有基金单位的行为本身即表明其对本基金契约的承认和接受，并按照《暂行办法》、本基金契约及有关规定享有权利、承担义务。

基金投资者欲了解基金持有人的权利和义务，应详细查阅《同盛证券投资基金基金契约》。

四、本次发行有关当事人

（一）基金发起人

1、中信证券有限责任公司

法人代表：常振明

注册地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

联系人：金剑华

联系电话：（010）64654818-61174

传真：（010）64661041

2、湖北证券有限责任公司

法人代表：陈浩武

注册地址：武汉市武昌区彭刘杨路 232 号

联系人：张义波

联系电话：（027）88070013

传真：（027）88047921

3、天津北方国际信托投资公司

法人代表：戚文福

注册地址：天津市河西区友谊路北方金融大厦 9-10 层

联系人：王庆

联系电话：（022）28370988

传真：（022）28370088

4、安徽省信托投资公司

法人代表：陈树隆

注册地址：安徽省合肥市宿州路 20 号

联系人：林培富、陆蓓

联系电话：（0551）2632666-1409

传真：（0551）2634609

5、长盛基金管理有限公司

法人代表：王其华

注册地址：北京市朝阳区北三环东路 8 号静安中心 22 层

联系人：王新艳

联系电话：（010）64689198

传真：（010）64689463

（二）基金发行协调人

中信证券有限责任公司

法人代表：常振明

注册地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

联系人：金剑华

联系电话：（010）64654818-61174

传真：（010）64661041

（三）律师事务所和经办律师

信利律师事务所

法定代表人：江山

地 址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 609 室

联系人：谢思敏

电 话：（010）65186980

传 真：（010）65186981

经办律师：谢思敏、丁志钢

（四）会计师事务所和经办注册会计师

安永华明会计师事务所

地 址：北京市东四十条港澳中心写字楼 10 层

法定代表人：葛明

联系人：金馨

电 话：（010）65545577

传 真：（010）65544718

经办注册会计师：葛明、金馨

五、发行安排

（一）发行方式：上网定价发行

（二）发行时间：1999 年 11 月 1 日，如遇重大突发事件，影响本次发行，将在下一个工作日顺延申购。

（三）发行对象：中华人民共和国境内自然人及我国境内依法设立的商业保险公司（法

律、法规及有关规定禁止购买者除外)。

(四) 基金单位总份额为 30 亿份, 其中: 发起人认购 3000 万份; 以不超过基金单位总份额的 30%, 即 9 亿份, 供保险公司申请配售, 每家保险公司可申请配售的数量不超过本基金单位总份额的 10%; 配售后余额向社会公开发行, 公开发行数量的具体情况, 详见 1999 年 10 月 29 日刊登的基金发行公告。

(五) 基金单位每份发行价格为 1.01 元, 其中: 面值 1.00 元, 发行费用 0.01 元。

(六) 基金单位认购的最低限额为 1000 份, 认购的份额必须为 1000 份的整数倍; 每一账户不设申购上限, 可以重复申购, 但每一笔申购委托不得超过 99.9 万份基金单位。

(七) 符合有关条件、拟配售本基金的保险公司, 应在本招募说明书刊登当日中午 12:00 前以传真文件形式向本基金管理人——长盛基金管理有限公司提出配售申请, 由长盛基金管理有限公司根据申请情况进行比例配售。

联系人: 丁卫、王新艳

电 话: (010) 64689198-653, 64689198-636

传 真: (010) 64689471

六、基金成立

本基金发行期限结束时, 如实际募集的资金超过 24 亿元人民币, 即超过本基金批准规模的 80%, 则本基金依法成立; 否则, 本基金不成立, 基金发起人将承担基金募集费用, 已募集的资金并加计银行活期存款利息将在发行期结束后 30 天内退还基金认购人。

本基金成立前, 投资者的认购款项只能存入商业银行, 不作他用。

七、基金投资

(一) 投资目标

本基金属于成长价值复合型基金, 主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价格被低估的价值型上市公司, 利用成长型和价值型两种投资方法的复

合效果更好地分散和控制风险，实现基金资产的稳定增长。

（二）投资理念

成长价值复合型投资是国际上通行的一种基金管理风格，将部分资产投资于成长型股票，另一部分资产投资于价值型股票，并根据市场情况的变化调整二者的投资比例，使复合投资的结果更适应市场环境的变化。

在成长价值复合型投资中，成长型投资注重公司发展前景，主要投资于业绩能够长期保持高速增长的股票，收益主要通过公司的高速成长来实现，属“进取型”风格；价值型投资注重公司股票市价，主要投资于市场价值被低估的股票，收益主要通过公司价值的发现和回归来实现，属“防守型”风格。成长价值复合型投资是将成长型与价值型这两种特性不同的投资结合起来，这种复合投资最大的优点就在于利用其二者相关度低的特点，有效地把握市场偏好、趋势变化时所产生的机会，体现主动、灵活的管理原则并更好地分散与控制风险，实现稳定增长的投资目标。

国内一些上市公司有管理、资金、技术和人才等各方面的优势，是各行业发展的核心力量，这些公司业绩的持续高速增长将为投资者带来较好的投资收益。同时在目前的市场环境下，还有很多上市公司的实际价值未被市场认识或被市场低估、市盈率和市净率水平相对偏低，随着投资者专业化水平和市场效率的不断提高，这些公司的价值必然会被市场发现并实现价值回归。基于这样的考虑，本基金主要进行成长型和价值型股票的复合型投资，使投资者在可能得到较高资本利得和相应投资收益的前提下，可以较好地分散和控制风险。

（三）投资范围

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其股票投资部分将主要投资于成长型股票和价值型股票。

（四）投资组合

1、本基金投资组合的原则

（1）本基金的投资组合将本着流动性、安全性、收益性的原则，综合宏观经济、行业企业和证券市场的因素，确定投资组合，达到分散和降低投资风险，确保基金资产安全，谋求基金长期稳定收益的目的。

（2）本基金为成长价值复合型基金，其股票投资包括两部分，一部分为成长型投资，另一部分为价值型投资。成长型和价值型投资的比例关系，根据市场情况的变化进行调整，但不论对成长型亦或价值型上市公司的投资最低均不得低于股票投资总

额的 30%，最高均不得高于股票投资总额的 70%。

本基金投资的成长型上市公司应能在较长时间内保持业绩高速增长，虽然有些公司可能当期市盈率或市净率水平较高，但市场预期其未来盈利前景良好。具体来说，成长型上市公司具有以下主要特点：

- a、公司发展前景良好，主营产品或服务的市场有充分的成长空间；
- b、预计公司净利润在未来几年内可保持较高增长幅度，且股本扩张速度较快；
- c、公司业绩的增长主要来源于主营业务收入（包括与主营业务性质相同或相似的投资收益）的增长；
- d、预期公司发展将发生积极变化（如购并和重组等）从而使未来盈利能力得到实质性改善；
- e、公司有优于同行业其他公司的某种竞争优势。

本基金所投资的价值型上市公司内在价值被市场低估，但其价值的低估并非由于公司基本面情况不佳，而是由于某些短期因素的影响或市场的过度反应，主要表现在：

- a、与同行业平均市盈率水平或公司自身的盈利能力相比，市盈率水平偏低；或
- b、与同行业平均市净率水平或公司自身的盈利能力和资产质量相比，市净率水平偏低；或
- c、公司具有某项有形资产或专利、专有技术、品牌、特许权等无形资产（包括新形成、购入的资产的使用与交易）的实际价值未被市场认识或被市场低估；或
- d、并购与资产重组已经成功，业绩实现突变并预期可以稳定，按重组后预期市盈率水平尚低于新进入行业的平均水平。

（3）本基金亦部分投资债券，以调节投资股票可能带来的收益波动，分散风险，使基金的收益表现更加稳定。

2、本基金的投资组合必须符合以下规定：

（1）本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；

（2）本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%，

（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金（目前本基金管理人管理的基金是同益证券投资基金）持有一家公司的证券总和，不得超过该证券总股本的 10%；

（4）本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；债券回购的资金余额不得超过基金净资产的 40%；

（5）遵守中国证监会规定的其他比例限制。

（五）投资策略

1. 资产配置策略

投资决策委员会根据市场发展情况，确定在一段时间内市场发展的总体趋势，并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。当判断后市多头特征明显时，成长型股票最多可增持至股票投资总额的 70%，相应地，价值型股票可减持到股票投资总额的 30%；反之，当判断后市空头特征明显时，价值型股票最多可增持到股票投资总额的 70%，相应地，成长型股票可减持到股票投资总额的 30%。

2. 股票投资策略

成长型股票的主要特征是业绩保持高速增长，因此本基金在选择成长型股票进行投资时主要考虑以下几方面：

- （1） 预期未来几年公司净利润的增长速度高于同行业平均水平；
- （2） 公司主营业务利润（含与主营业务性质相同或相似的投资收益）占利润总额的比例大于 70%；
- （3） 在保持一定净资产收益率的前提下，预期公司未来几年的股本扩张速度高于市场平均水平；
- （4） 属于 ST 及低价重组板块，但预期其发展将发生积极变化，从而使公司未来盈利能力有实质性改善；
- （5） 公司在管理、科研开发、营销网络、对资源或市场的垄断等方面具有优势。

价值型股票的主要特征是市场价值被低估，因此本基金在选择价值型股票进行投资时主要考虑以下几方面：

- （1） 相对于公司自身的盈利能力或资产质量，公司账面价值与市场价值之比大于市场平均水平（即市净率小于市场平均水平）；
- （2） 公司市盈率低于行业或市场平均水平，但价值被低估并非由于公司基本面情况的不利变化，而是由于某些突发事件或不利传言等短期因素的影响；
- （3） 具有隐蔽资产（有形或无形资产）。

根据对上市公司上述若干方面的分析，确定成长型和价值型股票的初选范围，并在此基础上，对每只股票进行个案分析，确定其基本投资价值（成长/价值投资特征）。在投资时，按投资决策委员会确定的成长型投资和价值型投资的配置比例，分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。

由于我国证券市场发展时间较短，相关数据的数量和可比性均不理想，很难像西方成熟市场运用大量的统计数据对成长型和价值型股票进行严格的定量分析，因此本基金主要运用经验的、定性的标准来对成长型股票和价值型股票进行界定；但在实际操作中，也将会尽可能建立起量化指标体系。

（六）投资决策

1、决策依据

- （1）国家宏观经济环境；
- （2）国家有关法律、法规和本基金契约的有关规定；
- （3）货币政策、利率走势；
- （4）地区及行业发展状况；
- （5）上市公司研究；
- （6）证券市场的走势；

2、决策程序

本基金管理人内部设立同益基金经理部、同盛基金经理部、研究发展部、集中交易室、监察稽核部以及由总经理和相关人员组成的投资决策委员会和风险控制委员会，基金管理实行基金经理负责制。投资决策程序如下：

（1）研究发展部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告，并在此基础上进行投资论证，作出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的依据。

（2）基金经理对研究发展部提交的投资建议进行初步筛选，形成股票初选方案，提交投资决策委员会。

（3）投资决策委员会依照研究发展部提供的研究分析报告和基金经理提交的股票初选方案，制定投资决策，其中包括确定投资原则与方向，确定股票、国债和现金的配置比例，确定股票投资的备选范围等。

（4）基金经理根据投资决策委员会的投资决策，制定相应的投资组合方案，报投资决策委员会审议批准。

（5）投资组合方案经投资决策委员会批准后，由基金经理制定具体的操作计划并以投资指令的形式下达至集中交易室。

（6）集中交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

（7）风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提出总结报告。

（七）投资限制

本基金投资范围仅限于债券和国内依法公开发行、上市的股票。

本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、从事任何形式的证券承销业务；
- 4、动用银行信贷资金从事基金投资；
- 5、从事证券信贷业务；
- 6、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 7、从事证券信用交易；
- 8、以基金资产进行房地产投资；
- 9、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 10、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 11、中国证监会规定禁止从事的其他行为。

（八）基金经理

本基金由同盛基金经理部负责基金的日常投资运作，主要成员有：

杨赤忠先生，基金经理，31岁，本科学历，在读研究生，经济师。6年证券从业经历，6年基金管理经验。历任深圳蓝天基金投资部经理、研究部经理、投资与研究部经理、长盛基金管理公司研究发展部副总经理。

李志嘉先生，基金经理助理，24岁，本科学历，助理经济师，2年证券从业经历。曾任职于深圳市中大投资管理公司，现在长盛基金管理有限公司从事证券投资业务。

王新艳女士，基金经理助理，26岁，经济学硕士，2年证券从业经历。曾在万盟投资咨询公司、中信证券基金部工作，现在长盛基金管理有限公司从事证券研究工作。

（九）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全和增值；
- 3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益；
- 4、基金管理人按照有关规定代表基金行使股东权利。

八、基金专用交易席位的选用

（一）选择使用交易席位的证券经营机构的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其专用交易席位。选择的标准是：

- 1、资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- 2、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- 3、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

- 4、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

- 5、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

- 6、研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

代理证券买卖的证券经营机构由基金管理人根据上述标准考察后确定。基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，报证监会备案并公告。

（二）席位使用期限及更换方式

席位使用期限暂定为半年。使用期满后，基金管理人将根据证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价，包括：

- 1、提供的研究报告的数量和质量；
- 2、研究报告被基金采纳的情况；
- 3、因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- 4、因采纳其报告为基金运作避免或减少的损失；
- 5、由基金管理公司提出课题，由证券经营机构提供研究论文；
- 6、开放证券经营机构的资料库。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中，管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行评价排名，同时亦关注并接受暂未使用席位的证券经营机构的研究报告和信息资讯，为半年后的席位更换作准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及信息服务不符合管理人的要求，管理人有权提前终止使用其交易席位。

（三）席位运作方式

根据《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》的要求，基金通过一个证券经营机构买卖证券的年成交量，不得超过本基金买卖证券年成交量的30%。基金管理

人将根据该项规定并结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量，分配基金在各席位买卖证券的交易量。

（四）其他事宜

基金管理公司将根据有关规定，在基金中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露，并向中国证监会报告。

九、风险揭示

本基金投资存在的风险主要有：

（一）市场风险

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化，产生风险，主要有：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策等）发生变化，导致市场波动而产生的风险。

2、经济周期风险。随着经济运行的周期性变化，市场的平均收益水平也呈周期性波动，基金所投资证券的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率波动会导致证券市场价格和收益率的变动，其直接影响国债价格和收益率，影响企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，收益水平亦会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。作为成长型公司，如果经营没有达到预期的良好状况，可能出现成长性不足而导致股票价格下跌或股息、红利减少；作为价值型公司，如果公司基本面情况发生不利变化，原来价格低估的判断可能在重新评判后不复存在，或者因为预期更坏的情况出现都可能使股票价格下跌或股息、红利减少，给基金投资者带来风险。

5、购买力风险。基金的收益主要通过现金的形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

（二）管理风险

基金管理运作过程中由于管理人的主观因素，会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

对于成长型投资，由于判断公司能否成为成长型公司一般依据其历史表现，但股票的投资收益主要决定于公司未来实际的成长性和盈利能力，因此用历史表现估计预期收益存在一定的风险。公司实际成长水平与预期成长能力之间的轻微差异，都可能使股票原有的高市盈率无法保持。对于价值型投资，由于价值型投资获利与否的关键在于被投资股票的价值能否实现回归，因此投资价值型股票最大的风险是对公司内在价值判断失误。对于作为成长价值复合型基金，还可能因为管理者对证券市场的认识和判断上的偏差，使得成长型和价值型两种投资类型的复合效果逊于单纯的成长型和价值型基金。

同时本基金管理人管理的基金超过一只，因此本基金在进行具体投资操作时可能会受到其他基金投资所带来的影响，尽管基金管理人内部有严格的交易规则来避免不同基金投资的利益冲突，但无法保证完全避免该影响的产生。

（三）其他风险

基金受其它不可抗力（如战争、自然灾害等）的影响，可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险。

十、基金资产

（一）基金资产总值

基金资产总值包括基金购买的股票、债券和银行存款本息的总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去按照国家有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

（三）基金资产的账户

本基金资产以“同盛证券投资基金专用账户”的名义在中国银行开立基金专用银行存款账户及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户相独立。

（四）基金资产的处分

本基金资产独立于管理人和托管人的资产，并由托管人保管。管理人、托管人以其自有的资产承担相应的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据《暂行办法》、本基金契约及其他有关规定处分外，基金资产不得

被处分。

十一、基金资产估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值。

（二）估值日

每日对基金资产进行估值。

（三）估值方法

- 1、上市证券按当日平均价计算；该日无交易的证券，以最近一日的平均价计算；
- 2、未上市的股票以其成本价计算；
- 3、未上市债券及银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额计算；
- 4、如遇特殊情况而无法或不宜以上述规定确定基金资产价值时，基金管理人应依据主管机关的有关规定办理。

（四）估值对象

基金依法拥有的股票、债券和银行存款本息等资产。

（五）估值程序

基金的日常估值由管理人进行。用于公开披露的基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按照基金契约规定的估值方法、时间与程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

- 1、基金投资涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因其他不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

十二、基金费用

（一）基金费用的种类：

- 1、基金管理人的报酬；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金上市费用；
- 4、证券交易费用；
- 5、基金信息披露费用；
- 6、基金持有人大会费用；
- 7、会计师费用和律师费用等。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的报酬

基金管理人的报酬由两部分组成，一部分是基金管理费，以基金资产净值的 1.5% 年费率计提；另一部分是业绩报酬，当基金的可分配净收益年率高于同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上，且当年基金资产净值增长率高于同期证券市场平均收益率时，按一定比例计提。

具体计算方法如下：

（1）基金管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计算，本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法为：

$$H = E \times 1.5\% \times 1 / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日基金资产净值（扣除本基金持有现金比例超过 20% 部分的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）业绩报酬

业绩报酬根据基金全年的经营业绩情况，在满足以下几个基本条件下每年计提一次，直接用于奖励基金管理人员：

- a 、基金年平均单位资产净值不能低于面值；
- b 、基金可分配净收益年率超过同期银行一年定期储蓄存款利率 20% 以上；
- c 、基金资产净值增长率超过证券市场平均收益率；
- d 、基金收益分配后其每单位资产净值不能低于面值。

在满足以上条件的情况下，基金业绩报酬计算方法为：

业绩报酬=调整后期初资产净值×MIN[M,N]×5%

其中, M=基金可分配净收益率-1.2×同期银行一年定期储蓄存款利率(如果年内利率发生变动,则按时间段进行加权平均调整);

N=基金资产净值增长率-证券市场平均收益率;

MIN[M,N]为M、N中较小者;

基金可分配净收益率=当期可分配净收益/调整后期初资产净值;

调整后期初资产净值=上年度末基金资产净值-上年度已分配收益;

基金资产净值增长率=(期末基金资产净值-调整后期初基金资产净值)/调整后期初基金资产净值;

证券市场平均收益率=[(期间深综指涨跌幅×深市平均总市值+期间沪综指涨跌幅×沪市平均总市值)/(深市平均总市值+沪市平均总市值)]×80%+同期国债收益率×20%;

深市平均总市值=(期末深市总市值+期初深市总市值)/2;

沪市平均总市值=(期末沪市总市值+期初沪市总市值)/2;

业绩报酬每个会计年度末计算,由基金托管人于次个会计年度前20个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的2.5‰的年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月最后一个工作日(遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日)由基金托管人从基金资产中一次性支取。

3、上述3—7项费用按所签协议或有关规定计算,由基金托管人从基金资产中支付。

(三) 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资产的损失,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。

(四) 基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理人报酬和基金托管费,此项调整不需要召开基金持有人大会。

十三、基金税收

本基金及本基金持有人依据国家有关规定依法纳税。

十四、基金收益与分配

（一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

（三）收益分配原则

- 1、基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；
- 2、基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- 3、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 4、基金投资当年亏损，则不进行收益分配；
- 5、每一基金单位享有同等分配权。

（四）收益分配方案

基金收益方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

（五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 5 个工作日内公告。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 3、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 4、本基金独立建账、独立核算；
- 5、本基金管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 6、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案；
- 3、基金管理人（或托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经托管人（或管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在 5 个工作日内公告。

十六、交易安排

本基金成立之后，将根据《暂行办法》及有关规定，申请在深圳证券交易所上市。上市时间预计在基金发行后一个月内。

十七、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《暂行办法》、《证券投资基金信息披露指引》、基金契约及其他有关规定。本基金信息披露事项必须在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告。

（一）定期报告

定期报告包括年度报告、中期报告、投资组合公告、基金资产净值公告。

- 1、基金管理人应当在每个基金会计年度结束后 90 日内编制完成年度报告，并

刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，同时一式五份分别报送中国证监会和基金上市的证券交易所备案。基金年度报告的格式与内容应符合《年度报告的内容与格式》的规定，其中财务报告须经过审计。

2、基金管理人应当在每个会计年度的前6个月结束后60日内编制完成中期报告，并刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，同时一式五份分别报送中国证监会和基金上市的证券交易所备案。基金中期报告的格式与内容应符合《中期报告的内容与格式》的规定。

3、投资组合公告每季公布一次，应披露基金投资组合分类比例，及基金投资按市值计算的前十名股票明细。公告截止日后15个工作日内，基金管理人应编制完成投资组合公告，经基金托管人复核后予以公告，同时分别报送中国证监会和基金上市的证券交易所备案。

4、基金资产净值至少每周公告一次。基金管理人应于每次公告截止日后第一个工作日计算并公告基金资产净值及每一基金单位资产净值，同时分别报送中国证监会和上市的证券交易所备案。基金管理人在计算基金资产净值时，基金所持股票应当按照公告截止日当日平均价计算。

在计划分配收益确定后，资产净值应扣除此部分；在基金收益未经审计之前同时公布未扣除与拟扣除计划分配收益的两项净值，收益经审计后仅公布已扣除计划分配收益的净值。

（二）临时报告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当于第一时间报告中国证监会及基金上市的证券交易所，并编制临时报告书，经上市的证券交易所核准后予以公告，同时报中国证监会。

重大事件是指可能对基金持有人权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事件，包括下列情况：

- 1、基金持有人大会决议；
- 2、基金管理人或基金托管人变更；
- 3、基金管理人的董事长、总经理、基金托管人的总经理变动；
- 4、基金管理人的董事一年内变更超过50%；
- 5、基金管理人或基金托管人主要业务人员一年内变更超过30%；
- 6、基金管理人或基金托管人受到重大处罚；
- 7、重大诉讼、仲裁事项；
- 8、基金提前终止；
- 9、其他重要事项。

（三）澄清公告与说明

在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动时，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报送中国证监会和基金上市交易的证券交易所。

（四）信息事务管理

- 1、基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息管理工作。
- 2、基金托管人须对基金管理人编制的定期报告中有关内容进行复核，并就此向基金管理人出具书面文件。
- 3、上市公告书、年度报告、中期报告在编制完成后，应放置于基金管理人所在地、基金托管人所在地、上市交易的证券交易所、有关销售机构及其网点，供公众查阅。

十八、基金持有人

（一）基金持有人的权利与义务

1、基金持有人权利

- （1）出席或者委派代表出席基金持有人大会；
- （2）取得基金收益；
- （3）监督基金经营情况，获取基金业务及财务状况的资料；
- （4）转让基金单位；
- （5）取得基金清算后的剩余资产；
- （6）基金契约规定的其他权利。

每份基金单位具有同等的合法权益。

2、基金持有人义务

- （1）遵守基金契约；
- （2）交纳基金认购款项及规定的费用；
- （3）承担基金亏损或者终止时的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动。

（二）基金持有人大会

1、召开事由

有以下情形之一的，召开基金持有人大会：

- (1) 修改基金契约;
- (2) 提前终止基金;
- (3) 更换基金管理人;
- (4) 更换基金托管人;
- (5) 延长基金期限;
- (6) 变更基金类型;
- (7) 中国证监会规定的其他情形。

2、召集方式

- (1) 在正常情况下，基金持有人大会由基金管理人召集;
- (2) 在更换基金管理人或基金管理人无法行使召集权的情况下，由基金托管人召集基金持有人大会;
- (3) 在基金管理人和基金托管人均无法行使召集权的情况下，由本基金发起人召集基金持有人大会。

3、通知

召开基金持有人大会，召集人于会议召开前 10 天，在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告。基金持有人大会通知将至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点;
- (2) 会议拟审议的主要事项;
- (3) 权利登记日;
- (4) 投票代理委托书送达时间和地点;
- (5) 会务常设联系人姓名、电话。

4、出席方式

- (1) 现场开会。由基金持有人本人出席或以授权委托书委派代表出席;
- (2) 书面开会。如采取书面开会的方式，召集人将事先报请中国证监会同意。书面开会以通讯表决方式进行表决。

5、议事内容与程序

(1) 议事内容：关系基金持有人利益的重大事项，如修改基金契约、提前终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、延长基金期限、变更基金类型以及召集人认为需提交基金持有人大会讨论的其他事项。

(2) 议事程序：

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会批准后公告。

在书面开会的方式下，首先由召集人提前 10 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议，报经中国证监会批准后

公告。

6、表决

(1) 基金持有人所持每份基金单位有一票表决权；

(2) 基金持有人大会决议须经出席会议的基金持有人所持表决权的半数以上通过，但更换基金管理人或托管人应由持有半数以上基金单位的基金持有人通过；

(3) 基金持有人大会决议对所有基金持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

7、公告

基金持有人大会决议报中国证监会批准后 5 个工作日内公告。

十九、基金发起人

(一) 基金发起人情况

1、中信证券有限责任公司

法人代表：常振明

注册地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

邮政编码：100004

组织形式：有限责任公司

注册资本：3 亿元人民币

设立日期：1995 年 10 月 25 日

经营范围：发行和代理发行各种有价证券；自营和代理买卖各种有价证券；有价证券的代保管、鉴证和过户；代理还本付息、分红派息等权益分派业务；证券抵押融资业务；基金和资产管理业务；企业重组、收购与兼并业务；投资咨询、财务顾问业务；金融期货自营业务；外币证券业务；中国人民银行批准的其他业务。

财务状况：中信证券有限责任公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

2、湖北证券有限责任公司

法定代表人：陈浩武

注册地址：武汉市武昌区彭刘杨路 232 号

邮政编码：430061

组织形式：有限责任公司

注册资本：3.02 亿元人民币

设立日期：1991 年 3 月 18 日

经营范围：证券的承销；证券的自营买卖；证券交易的代理；证券抵押融资；基金和资产管理；证券投资咨询；公司财务顾问；企业重组、收购和兼并。

财务状况：湖北证券有限责任公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

3、天津北方国际信托投资公司

法人代表：戚文福

注册地址：天津市河西区友谊路5号北方金融大厦9-10层

邮政编码：300201

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.0679亿元人民币

成立日期：1987年10月13日

经营范围：信托存贷款、投资业务；委托存贷款、投资业务；房地产投资业务；有价证券业务；金融租赁业务；代理财产保管与处理业务；代理收付业务；经济担保和信用见证业务；经济咨询业务；外汇信托存款、放款、投资；外汇放款、投资；外汇借款；发行或代理发行外币有价证券；代客外汇买卖；贸易结算；外汇租赁；外汇担保；外汇资信调查、咨询、见证业务。

财务状况：天津北方国际信托投资公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

4、安徽省信托投资公司

法人代表：陈树隆

注册地址：安徽省合肥市宿州路20号

邮政编码：230001

组织形式：国有独资

注册资本：3.316亿元人民币

成立日期：1991年10月10日

经营范围：信托存款、投资业务；委托存款、投资业务；有价证券业务；金融租赁业务；代理财产保管与处理业务；代理收付业务；经济担保和信用见证业务；经济咨询业务；中国人民银行批准经营的其他金融业务。

财务状况：安徽省信托投资公司财务状况良好，最近三年连续盈利。

5、长盛基金管理有限公司

法人代表：王其华

注册地址：北京市朝阳区北三环东路8号静安中心22层

邮政编码：100028

组织形式：有限责任公司

注册资本：8,000万元人民币

成立日期：1999年3月26日

经营范围：基金管理业务；发起设立基金。

主要股东：中信证券有限责任公司、湖北证券有限责任公司、天津北方国际信托

投资公司、安徽省信托投资公司

（二）基金发起人的权利与义务

1、基金发起人的权利

- （1）申请设立基金；
- （2）按基金发起人协议书的约定认购基金单位；
- （3）出席或委派代表出席基金持有人大会；
- （4）取得基金收益；
- （5）依法转让基金单位；
- （6）监督基金经营情况，获取基金业务及财务状况的资料；
- （7）参与基金清算，取得基金清算后的剩余资产；
- （8）法律、法规认可的其他权利。

2、基金发起人的义务

- （1）按基金发起人协议书规定的认购比例及数额在募集期间以现金缴纳基金认购数额及规定的费用；
- （2）在基金设立时认购和在存续期间持有符合规定比例的基金单位；
- （3）遵守基金契约；
- （4）承担基金亏损或者终止时的有限责任；
- （5）不从事任何有损基金及其他基金持有人利益的活动；
- （6）基金不能成立时及时退还所募集资金本息和按比例承担费用；
- （7）法律、法规规定的其他义务。

二十、基金管理人

（一）基金管理人情况

- 1、名称：长盛基金管理有限公司
- 2、设立日期：1999年3月26日
- 3、法定代表人：王其华
- 4、注册资本：8,000万元人民币
- 5、注册地址：北京市朝阳区北三环东路8号静安中心22层
- 6、设立概况：由中信证券有限责任公司、湖北证券有限责任公司、天津北方国际信托投资公司、安徽省信托投资公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字【1999】6号文批准成立。
- 7、主要人员情况：

王其华先生，董事长、法定代表人。41岁，硕士学历，高级统计师。1988年至1993年在天津财经学院任教，任统计系教研室主任、副教授。1993年至1994年在天津证券交易中心工作。1994年起就职于天津北方国际信托投资公司，历任投资银行部经理、开信基金管理部经理、副总经济师、副总经理等职。

王忆华女士，副董事长。53岁，中共党员，硕士学历，高级经济师。1970年至1978年在天津化工进出口公司商情科工作。1981年至1990年就职于中国国际信托投资公司财务部租赁处及中信实业银行租赁部，历任处长、经理。1990年至1993年在招商银行总行工作，任副行长。1993年至今就职于深圳市中大投资管理有限公司，任董事总经理。

常振明先生，董事。42岁，中共党员，硕士学历，高级经济师。1983年至1989年在中信实业银行资金部任副经理。1989年起任中国国际信托投资公司纽约代表处副代表，并获纽约保险学院金融专业硕士。1992年至1993年任中信实业银行行长助理、副行长。1993年任中国国际信托投资公司协理，1995年起任副总经理，并兼任中信证券有限责任公司董事长。

陈浩武先生，董事。46岁，中共党员，博士学历，高级经济师。1974年至1990年就职于中国人民银行湖北省分行，历任办公室科长、调研处副处长、金融研究所所长。1991年受命组建湖北证券有限责任公司，先后出任总经理、副董事长等职，现任董事长，兼任中国证券业协会副监事长、上海证券交易所常务董事。

陈树隆先生，董事。34岁，中共党员，大学学历，会计师。1987年至1989年任教于安徽省财贸学院会计系。1989年至1993年在安徽省财政厅综合处工作，任主任科员。1993年至1997年任安徽省国债服务中心主任。1998年起任安徽省信托投资公司总经理。

李格平先生，董事。32岁，硕士学历，高级经济师。1987年起任教于中南财经大学经济学系。1992年起加入湖北证券有限责任公司，历任董事会秘书、上海业务部副经理、深圳业务部总经理、公司总裁助理、兼任资产管理事业部总经理、研究所所长等职，现任公司副总裁，兼任投资银行总部总经理、研究所所长。

张佑君先生，董事、总经理。33岁，中共党员，硕士学历。1990年至1992年就职于平安保险公司管理本部证券部，任经理。1992年至1994年在中信实业银行证券

部任经理。1994年进入中信证券有限责任公司，历任深圳管理总部总经理、交易部总经理、公司襄理、董事副总经理等职。

木利民先生，监事会召集人。40岁，中共党员，大学学历，高级经济师。1982年至1991年任安徽省财政厅副处长。1991年起就职于安徽省信托投资公司，现任副总经理。

戚文福先生，监事。52岁，中共党员，大学学历，高级经济师。1976年至1987年在军事医学科学院工作，任团总支书记。1987年进入天津北方国际信托投资公司，现任董事长兼总经理。

滕运先生，监事、总经理助理。39岁，硕士学历，工程师。1983年至1987年在首都钢铁公司研究所任工程师。1990年至1991年就任于美国纽约库伯乐贸易公司。1991年进入中信贸易公司，任出口部经理。1995年起任中信证券有限责任公司基金部副总经理。

杨光启先生，副总经理。31岁，硕士学历，经济师。1992年至1993年在中国人民银行深圳经济特区分行证券管理处从事证券管理工作。1993年至1998年在深圳市证券管理办公室从事证券管理工作，历任副科长、科长、副处长。1998年进入博时基金管理有限公司，任总经理助理兼资产管理部总经理，从事证券投资工作。

杨鸫女士，副总经理。43岁，大学学历，高级经济师。1983年至1987年任中国银行国际金融研究所襄理。1987年至1990年在香港中银集团经济研究部任经理级副经济研究员。1991年进入招商银行总行，任证券部总经理。1994年至1998年就职于深圳市中大投资管理有限公司，任董事常务副总经理。

李燕敏女士，督察员。35岁，大学学历，会计师。1986至1998年就职于中国国际信托投资公司，任财务部会计处副处长。1998年进入中信证券有限责任公司任计财部副总经理。

8、部门设置及人员情况

长盛基金管理有限公司设立六个部门：同益基金经理部、同盛基金经理部、研究发展部、集中交易室、监察稽核部、综合管理部；此外，还设立投资决策委员会和风险控制委员会。

（1）投资决策委员会

为公司非常设决策机构，由公司总经理、副总经理、基金经理、研究发展部总监及相关人员组成，其主要职责是依据各基金经理部和研究发展部所提供的信息与调查研究结论制定基金投资的原则与方向，确定股票、债券、现金资产的投资比例，最终确定投资组合，同时投资决策委员会负责各基金之间的投资协调工作。

（2）风险控制委员会

为公司非常设议事机构，由公司总经理、副总经理、督察员和有关专家组成，其主要职责是负责基金投资过程中的风险评估与防范，制定控制基金投资风险的措施，并在市场发生重大变化的情况下，依据风险控制的要求对投资组合作出有效调整，从而降低投资的风险，保证基金资产的安全。

（3）同益基金经理部

由同益基金经理和基金经理助理组成，负责同益基金的日常投资运作。基金经理对研究发展部的投资建议形成股票初选方案，根据投资决策委员会的投资决策，制定相应的投资组合方案，报投资决策委员会批准后制定具体的操作计划并以投资指令的形式下达至集中交易室。

（4）同盛基金经理部

由同盛基金经理和基金经理助理组成，负责同盛基金的日常投资运作。部门职能与同益基金经理部相同。

（5）研究发展部

主要职能是围绕公司的基金资产管理提供研究信息上的支持并提出投资建议，主要包括各类信息的采集、宏观经济的研究、行业、地区经济的研究、上市公司的深入调研、撰写研究调查报告、提出投资建议，并承担新业务的开发与研究等。

（6）集中交易室

负责执行各基金经理部的投资指令并将执行结果反馈给各基金经理部。集中交易室的交易员一般以“时间优先、价格优先”的原则，执行各基金经理下达的交易指令，对由不同基金下达的投资对象相同且价格相近、数量较大的投资指令，由集中交易室负责人协调。在某些特定情况下，集中交易室负责人应提请投资决策委员会协调解决。

（7）监察稽核部

监察稽核部独立于公司其他部门，直属总经理领导。其职责是以独立、客观、公正的精神执行内部的监控工作。该部门主要负责制定公司内部各项控制管理制度，检查各部门执行国家有关法律、法规、金融政策情况；检查监督各部门执行公司各项规章制度；审查财务收支的合法性、合规性和合理性；调查内部的经济违法违规案件；审查公司所管理的基金资产的营运情况；进行基金投资风险分析与评价；提出风险控

制的方案以供决策部门参考；处理各种风险事项；基金的信息披露工作；总经理授权的其他事项。

（8）综合管理部

综合管理部的主要职能有：基金的会计核算和交易清算、公司的财务管理和资金使用计划安排、办公电脑软硬件的配置、维护，交易系统的日常维护、以及人事和劳资管理、文件档案管理、公司后勤保障等。

基金管理公司现有员工 28 人，其中 82%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，71%以上具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

9、内部风险控制、督察员、监察及稽核、财务及人事管理制度建立情况

建立健全管理公司的规章制度是基金管理公司的基础性工作，也是保护基金投资者的重要措施。除《公司章程》外，长盛基金管理有限公司还制定了以下制度：

（1）内部风险控制制度

a. 内部风险控制遵循的原则：

全面性原则：内部风险控制必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

独立性原则：公司设立独立的监察稽核部，监察稽核部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门内部风险控制工作进行稽核和检查；

相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上；

定性和定量相结合原则：建立完备风险控制指标体系，使风险控制更具客观性和可操作性。

b. 内部风险控制的内容：

内部风险控制制度的内容由一系列的具体制度构成，包括：岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度和独立的稽核制度等。

为保证各部门的相对独立性，应建立明确的岗位分离制度。同时实行空间隔离制度，建立中国墙，充分保证信息的隔离和保密。

各部门应本着合理、高效、尽可能减小错误发生的可能性的原则，制定本部门的作业流程。

基金投资运作实行集中交易制度，建立集中交易室，所有基金投资必须在集中交易室完成。

制定规范的信息披露管理办法，建立完善的信息资料保全系统，建立完整的会计、统计和各种业务资料的档案。

实行独立的稽核检查制度，监察稽核部有权对公司各业务部门工作进行稽核检查，并保证稽核的独立性和客观性。

（2）督察员制度

公司设督察员，全权负责管理公司的监察稽核工作。督察员由公司总经理提名，经董事会聘任或者解聘。督察员的任免须报中国证监会核准。

公司督察员可列席公司会议，对基金运作、内部管理、制度执行及遵守法规情况进行内部监察、稽核，每月应独立出具稽核报告，报送中国证监会和公司董事长。

如发现公司有重大违规行为，应立即向中国证监会和公司董事长报告。

（3）监察稽核制度

监察稽核部的监察稽核职责：

监察稽核部门依据国家的有关法律法规、公司的内部控制制度，在所赋予的权限内，按照所规定的程序和适当的方法，对监察稽核对象进行公正客观的检查和评价。

监察稽核部负责调查、评价公司有关部门执行国家有关法律法规的情况和执行公司各项规章制度的情况；进行日常风险监控工作；负责调查评价公司内控制度的健全性、合理性和有效性；评价各项内控制度执行的有效性，对内控制度的缺失提出补充建议；负责调查、评价投资决策与执行情况；评价基金资产情况；负责公司基金经理、财务负责人离任前的审计；调查公司内部的经济违法案件等。

监察稽核部的监察稽核权限：

监察稽核部有权向有关部门获取文件和材料，查阅合同、协议及相关附件，检查会计凭证、账册、报表及相关的交易记录资料，核查实物资产；有权穿越公司为控制风险和实施保密制度而设立的有形隔离和无形隔离，亦指通称的防火墙或中国墙；有权要求各业务部门提供有关经营管理计划及其执行情况，提供报表、制度、规定、办法等文件资料。经总经理同意，有权参加公司业务会议；监察公司员工遵守执业行为准则，保密制度的情况，有权要求相关人员提供相关资料和口头或书面说明；监察部对被审部门或个人正在进行的违法、违规行为有权提请被查对象注意，在报公司领导同意后有权予以制止。

（4）财务管理制度

基金财务与公司财务在管理内容、办法、岗位设置与人员安排上进行严格的区分。财务管理的目的在于有效地提高基金管理的效益，增加公司的资金积累，妥善处理基金持有人与基金管理人、公司和公司股东之间的经济利益关系，提高基金运作和公司经营管理水平，确保基金资产和公司财产安全、完整和增值。主要内容：编制财务计划；管理公司实收资本和营运资金；管理固定资产；管理公积金、公益金；管理公司

的经营收入、支出，基金费用的提取和支付；管理税金解缴、基金收益分配和公司利润分配；制定完善财务制度、负责财务分析、编制财务决算。

(5) 人事管理制度

公司人事制度是为建立正常的经营管理秩序，规范公司员工的行为，提高员工的素质和工作效率，保护员工的正当权利，促进公司的发展，根据国家有关法律法规而制定的。主要内容包括：招收录用，劳动合同，职位设置与职务任免，岗位聘任制度，人事考核，考勤制度，薪资福利，教育与培训，奖惩，辞职与辞退，退休和档案管理。

10、经营状况

截止 1999 年 9 月 30 日，本基金管理人管理的其他基金仅有一家，其基本情况如下：

(1) 基本情况

基金名称：同益证券投资基金

基金成立日期：1999 年 4 月 8 日

基金单位总份额：20 亿份

(2) 截止 1999 年 9 月 30 日数据

基金单位资产净值：1.3901 元

基金净值增长率：39.01%

(3) 同益证券投资基金主要由同益基金经理部负责，主要成员有：

丁楹先生，基金经理，28 岁，硕士研究生，5 年证券从业经历。曾在中信证券有限责任公司交易部、中信证券有限责任公司地坛营业部工作，历任中信证券有限责任公司交易部总经理助理、经理和长盛基金管理有限公司投资管理部总监。

夏林先生，基金经理助理，28 岁，在读博士研究生，6 年证券从业经历。曾在中国银行信托咨询公司上海证券营业部、投资银行部长期从事证券交易、证券发行等工作。

陈剑平先生，基金经理助理，24 岁，经济学学士，3 年证券从业经历。曾在深圳蓝天基金管理公司从事证券二级市场投资工作。

(二) 基金管理公司章程摘要

第八条 公司的经营宗旨：根据国家法律、法规及其他有关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，以专业经营方式管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展。

第九条 公司的经营范围为：

- 1、基金管理业务；
- 2、发起设立基金。

第十二条 公司股东均以现金出资；各股东的出资及其出资占公司注册资本的比例如下：

- 中信证券有限责任公司：2000 万元人民币，占注册资本总额的 25%；
- 湖北证券有限责任公司：2000 万元人民币，占注册资本总额的 25%；
- 天津北方国际信托投资公司：2000 万元人民币，占注册资本总额的 25%；
- 安徽省信托投资公司：2000 万元人民币，占注册资本总额的 25%。

第二十二條 股东会由全体股东各派一名代表组成，是公司的最高权力机构。股东会依照《公司法》及本章程行使职权。

第三十四条 公司董事不得有以下行为：

- 1、直接或间接买卖股票和基金，或利用公司专有或保密的信息为个人或其亲友谋利。
- 2、兼任其他基金管理公司的董事或高级管理人员。

第五十四条 公司设监事会，监事会向股东会负责，监事会由三名监事组成。经全体监事一致同意，在其成员中推选一名召集人。监事每届任期三年，可以连选连任。

第六十二条 公司设总经理一名，副总经理一至二名。总理由董事长提名，董事会聘任或者解聘；副总经理、督察员由总经理提名，董事会聘任或者解聘；董事（除公司董事长外）可以兼任总经理或其他高级管理人员。

总经理对董事会负责，副总经理协助总经理工作。

总经理、副总经理的任职资格须经中国证监会核准，总经理助理、部门经理的任职须报中国证监会备案。

第六十八条 总经理行使下列职权：

- 1、主持公司的日常经营、行政及财务的管理工作，组织实施董事会决议；
- 2、组织实施公司年度经营计划；
- 3、决定并组织实施基金的投资计划；
- 4、拟订公司内部管理机构的设置；
- 5、拟订公司的具体管理制度；

6、制定公司的基本规章；

7、提请聘任或者解聘由董事会聘任以外的公司其他高级管理人员，但须报中国证监会核准；

8、聘任或解聘除应由董事会聘任或者解聘以外的管理人员，决定聘用或辞退工作人员；

9、按照国家法规和公司管理制度，组织对员工的考核、评议，并决定薪酬奖惩、升降级等；

10、在董事会授权范围内代表公司对外处理重要业务；

11、本章程和董事会授予的其他职权。

第七十七条 公司督察员可列席公司会议，对基金运作、内部管理、制度执行及遵守法规情况进行内部监察、稽核，每月应独立出具稽核报告，报送中国证监会和公司董事长。

如发现公司有重大违规行为，应立即向中国证监会和公司董事长报告。

第八十条 公司不得与任何人订立将公司所管理的基金资产交于该人负责的合同或协议。

（三）基金管理人的更换

1、有下列情形之一的，经中国证监会批准，可以更换基金管理人：

- （1）基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- （2）基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金持有人利益；
- （3）代表 50%以上基金单位的基金持有人要求基金管理人退任；
- （4）中国证监会有充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责的。

基金管理人的更换程序为：

（1）提名

基金托管人提名新任基金管理人；

（2）决议

被提名的新任基金管理人经基金持有人大会通过；

（3）批准

经中国证监会审查批准后，新任基金管理人方可继任，原任基金管理人方可退任；

（4）公告

基金管理人更换后，由基金托管人在获得中国证监会批准后 5 个工作日内公告。

新任基金管理人与原基金管理人办理资产管理的交接手续，并与基金托管人核对资产总值。

（四）基金管理人的禁止行为

基金管理人依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定，诚实信用、勤勉尽责地管理和运用基金资产，不为自己或任何第三者谋取利益。

基金管理人在管理运作基金资产时，不从事以下行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3、从事任何形式的证券承销业务；
- 4、动用银行信贷资金从事基金投资；
- 5、从事证券信贷业务；
- 6、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 7、从事证券信用交易；
- 8、以基金资产进行房地产投资；
- 9、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 10、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 11、中国证监会规定禁止从事的其他行为。

（五）基金管理人受处罚情况

本基金管理人无任何受处罚记录。

（六）基金管理人的权利与义务

1、基金管理人的权利

- （1）依法运用基金资产；
- （2）依本基金契约规定获得基金管理人报酬；
- （3）监督托管人。如认为基金托管人违反了本基金契约及国家有关法律法规，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- （4）依照有关规定，代表基金行使股东权利；
- （5）有关法律、法规规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

- （1）自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- （2）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经

营方式管理和运作基金资产；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

(4) 除依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人运作基金资产；

(5) 接受基金托管人的监督；

(6) 按规定计算并公告基金净值及基金单位每份资产净值；

(7) 严格按照《暂行办法》、基金契约及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(8) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、基金契约及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不向他人泄露；

(9) 按规定向基金持有人分配基金收益；

(10) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(11) 依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定召集基金持有人大会；

(12) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

(13) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(14) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(15) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(16) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿；

(17) 有关法律、法规规定的其他义务。

(七)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、不谋求对上市公司的控股和直接管理；

2、有利于基金资产的安全和增值；

3、独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

依照有关规定，基金管理人代表基金出席上市公司的股东大会，行使股东权利，履行股东义务。

(八)基金管理人承诺

本基金管理人承诺勤勉尽责、诚实信用、安全有效地管理和运作基金资产，为投

投资者谋求最大的投资收益。

为切实履行上述承诺，保障投资人合法权益，管理人全体员工均已与公司签定了上岗承诺书，保证不从事任何法律法规及公司禁止的活动。公司任何人员，除为公司进行基金投资外，不得直接或间接进行股票交易；不得协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；不得泄露尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。如发现上述行为，公司将根据有关规定进行处罚。

广大投资者如发现本公司员工发生上述行为，请向本公司稽核部联系，联系电话：010-64689198，传真：010-64689475。

二十一、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国银行

设立日期：1912年2月5日

注册资本：1045亿元人民币

法定代表人：王雪冰

注册地址：北京市西城区阜成门内大街410号

2、发展概况：

中国银行是中国历史上最悠久的商业银行，长期以来一直是国家外汇外贸专业银行。自1994年金融体制改革以来，中国银行逐步向国有商业银行转化，锐意改革，强化管理，加强内部控制，各项业务均取得快速发展。中国银行在国内共有分支机构15000多家，员工19万多人；海外分支机构557家，分布在22个国家和地区，海外员工近2万人，是国际化程度最高的国有商业银行，并在外汇、国际结算等国际业务方面占有明显的竞争优势。近年来，中国银行一直是国内同业盈利最多的银行，并连续多年被国际金融界权威机构评为中国国内最佳银行。

4、证券投资基金托管部门设置及员工情况

中国银行总行设立基金托管部，主要业务部门包括清算处、财会处、稽查处、综合处和上海、深圳托管分部，现有员工22人。

4、主要人员情况：

王雪冰先生，男，1952年2月19日生于北京。1976年毕业于中国对外经济贸易大学，同年进入中国银行，曾在总行财会部、资金部、伦敦分行、纽约分行工作。担任过副经理、经理、副总经理等职务，1988年担任中国银行美国地区总经理，1993

年4月任中国光大集团总公司副总经理、常务董事，光大银行副董事长、光大财务公司总经理等职务，1993年11月任中国银行行长、副董事长。1995年5月任中国银行董事长、行长。此外，还担任国际商会中国国家委员会副主席；纽约股票交易所亚太顾问委员会、国际货币会议组织、国际金融公司商业顾问委员会委员；国际金融协会董事；中国红十字基金会副主席、中国田径协会副主席和中国对外经济贸易大学董事。

赵安歌先生，男，1950年6月19日出生，辽宁沈阳人。1976年毕业于中国对外经济贸易大学，同年进入中国银行。曾先后在总行财会处、卢森保分行、总行财会部工作，担任过副经理、经理、副总经理、总经理等职。1995年9月任中国银行副行长，同年11月任中国银行董事会常务董事。

陈儒先生，男，35岁，高级经济师，博士生，中国银行基金托管部负责人。1986年毕业于南开大学，曾参与深圳证券交易所的筹建工作，1992年至1998年9月曾任深圳投资基金管理公司总经理、董事长。1998年10月入中国银行工作。

4、基金托管人除托管本证券投资基金外，已托管景宏证券投资基金。

（二）基金托管人的更换

1、更换托管人的条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国人民银行批准，更换基金托管人：

- （1）基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产的；
- （2）基金管理人认为有充分理由认为更换基金托管人符合基金持有人利益的；
- （3）代表50%以上基金单位的基金持有人要求基金托管人退任的；
- （4）中国人民银行有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责的。

基金托管人的更换程序为：

（1）提名

基金管理人提名新任基金托管人；

（2）决议

被提名的新任基金托管人经基金持有人大会通过；

（3）批准

经中国证监会和中国人民银行审查批准后，新任基金托管人方可继任，原任基金托管人方可退任；

（4）公告

基金托管人更换后，由基金管理人在获得中国证监会和中国人民银行批准后5个工作日内公告。

新任基金托管人与原基金托管人进行资产管理的交接手续，并与基金管理人核对资产总值。

（三）基金托管人禁止行为

基金托管人按照《暂行办法》、基金契约及其他有关规定以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产和监督基金管理人的运作，不为自己或任何第三人谋取利益。基金托管人不从事以下行为：

- 1、从事基金投资；
- 2、挪用本基金资产；
- 3、在本基金信息公开披露前，向他人泄露有关信息。

（四）基金托管人受处罚情况

最近三年内基金托管人及其负责基金托管业务的高级管理人员未受到中国证监会、中国人民银行及工商、财税及其他有关机关的处罚。

（五）基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

- （1）依法保管基金的资产；
- （2）依本基金契约约定获得基金托管费；
- （3）监督基金管理人的投资运作；
- （4）法律、法规规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- （1）以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；
- （2）设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- （3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- （4）除依据《暂行办法》、基金契约及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，不委托第三人托管基金资产；
- （5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- （6）以基金的名义设立证券账户、银行账户等基金资产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责基金名下的资金往来；
- （7）保守基金商业秘密，除《暂行办法》、基金契约及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不向他人泄露；
- （8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及单位基金资产净值；
- （9）按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并上报中国证监会和中国人民银行；

- (10) 建立并保存基金持有人名册，并负责基金单位转让的过户和登记；
- (11) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- (12) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (13) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金持有人支付基金收益；
- (14) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (15) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；
- (16) 因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (17) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (18) 法律、法规规定的其他义务。

二十二、基金的扩募、续期与转型

（一）基金的扩募与续期

本基金的类型为契约型封闭式，如果进行扩募或续期，应当具备下列条件：

- 1、本基金年收益率高于全国证券投资基金平均收益率；
- 2、本基金管理人、托管人最近三年内无重大违法、违规行为；
- 3、基金持有人大会和基金托管人同意扩募或续期；
- 4、中国证监会规定的其他条件。

本基金在具备上述条件后，管理人可以向中国证监会申请基金的扩募或在基金存续期满时申请基金的续期，该申请由中国证监会审查批准。

（二）基金的转型

基金的转型是指本基金由契约型封闭式转变为契约型开放式，基金的转型应当具备下列条件：

- 1、本基金管理人（托管人）必须具备管理（托管）开放式基金所必需的人才、技术、设施等必要条件；
- 2、本基金管理人、托管人最近三年内无重大违法、违规行为；
- 3、基金持有人大会同意基金的转型；
- 4、中国证监会规定的其他条件。

本基金在具备上述条件后，管理人可以在基金存续期内向中国证监会申请基金的转型，该申请由中国证监会审查批准。

二十三、基金终止

有下列情形之一的，基金将终止：

- （一）封闭期满，未被批准续期的；
- （二）基金经批准提前终止的；
- （三）因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的。

二十四、基金清算

（一）基金清算小组

1、自基金终止之日起三个工作日内成立清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（二）清算程序

- 1、基金终止后，由清算小组统一接管基金资产；
- 2、清理并确定基金资产；
- 3、对基金资产进行评估；
- 4、对基金资产进行分配。

（三）清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组从基金资产中支付。

（四）基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后，按基金持有人持有的基金单位比例进行分配。

（五）基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

(六) 清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十五、招募说明书存放及其查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

备查文件

- 1、中国证监会批准同盛证券投资基金设立的文件
- 2、《同盛证券投资基金基金契约》
- 3、法律意见书
- 4、基金发起人的营业执照
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照

长盛基金管理有限公司

一九九九年九月十四日