长信增利动态策略股票型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

(2010年第1号)

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司

长信增利动态策略股票型证券投资基金(以下简称"本基金")由基金管理人根据中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]180号文核准募集。本基金的基金合同于2006年11月9日正式生效。本基金为股票型契约开放式基金。

【重要提示】

长信增利动态策略股票型证券投资基金(以下简称"本基金")经2006年8月28日中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]180号文核准募集。本基金基金合同于2006年11月9日正式生效。

基金管理人保证本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。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后,基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2010年5月9日,有关财务数据和净值表现自2010年1月1日至2010年3月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国民生银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

基金管理人概况			
名称	长信基金管理有限责任公司		
注册地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼		
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼		
邮政编码	200120		
批准设立机关	中国证券监督管理委员会		
批准设立文号	中国证监会证监基金字[2003]63号		
注册资本	壹亿伍仟万元人民币		
设立日期	2003年5月9日		
组织形式	有限责任公司		
法定代表人	田丹		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	尹克文		
存续期间	持续经营		
经营范围	基金管理业务,发起设立基金,中国证监会批准的其他业务(涉及许可经营的凭许可证经营)		
股权结构	股东名称	出资额	出资比例
	长江证券股份有限公司	7350万元	49%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5万元	34.33%
	武汉钢铁股份有限公司	2500.5万元	16.67%
	总计	15000万元	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人的董事会人员情况

董事会成员			
姓名	职务	性别	简历
田丹	董事长	男	中共党员,硕士。曾任湖北省军区参谋、秘书,中国人民银行湖北省分行金融调研处科长,湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理,三峡证券公司副总经理,湖北证券有限责任公司董事、副总裁,长江证券有限责任公司董事、副总裁、财务负责人,长江证券有限责任公司董事、总裁。现任长信基金管理有限责任公司董事长。
胡运钊	董事	男	中共党员,研究生学历,高级经济师。曾任湖北省经委工业处处长、黄石市人民政府副市长、市委常委、常委副市长、湖北省人民政府副秘书长(正厅)、办公厅主任、办公厅党组副书记。现任长江证券股份有限公司党委书记、董事长。
王亭	董事	男	中共党员,硕士,高级工程师。历任武汉钢铁(集团)公司热轧厂技术员、科长、车间副主任、厂长助理、副厂长、厂长,武汉钢铁(集团)公司总经理助理兼武汉钢铁有限责任公司副总经理,武汉钢铁(集团)公司副总经理兼钢铁公司党委书记、副总经理,现任武汉钢铁股份有限公司董事、总经理。
李国洪	董事	男	硕士,曾在武汉市人民政府工作。曾任长江证券有限责任公司投资银行总部副总经理、资产保全事业部总经理、办公室总经理。现任长江证券股份有限公司副总裁、合规总监。
徐文彬	董事	男	中共党员。历任中国人民解放军273团政委,上海市松江区建设委员会党委书记,上海市松江区小昆山镇党委书记,上海市松江区洞泾镇党委书记。现任上海海欣集团股份有限公司党委书记、总裁。
陈谋亮	董事	男	中共党员,硕士,高级经济师。历任湖北经济学院讲师,扬子石化公司法律顾问,上海交大南洋股份有限公司部门经理兼证券事务代表,上海海欣集团股份有限公司董事会秘书兼战略投资管理部常务副总监、总裁助理。现任上海海欣集团股份有限公司副总裁兼董事会秘书。
蒋学杰	董事	男	经济学硕士,澳大利亚墨尔本大学商学院MBA。曾任中南财经大学财政金融学院财政系教师、武汉科技信托投资公司武昌证券营业部总经理,并兼公司总助,副总等职、Loftus Capital Partners Limited,Australia旗下基金亚洲市场投资组合及私人股权投资的亚洲区域负责人、KVB Kunlun Pty Ltd,Australia金融衍生产品持牌交易投资顾问、长信基金管理有限责任公司副总经理。现任长信基金管理有限责任公司总经理。
朱恒	独立董事	男	中共党员,本科,高级经济师。曾任中国人民银行、中国农业银行上海市奉贤支行副行长,中国农业银行上海市分行副行长,上海浦东发展银行副行长,万国证券公司、申银万国证券公司董事长,上海浦东发展银行党委副书记、副行长,上海轻工控股(集团)公司监事会主席。
余秉立	独立董事	男	中共党员,本科,注册会计师。历任武汉市财政局副科长、武汉市政府财贸办公室副科长、武汉市财政局副科长至副局长、武汉市审计局局长、党组书记,湖北省财政金融贸易办公室副主任、副书记、审计署驻武汉特派办特派员、书记、审计署驻武汉特派办正局级审计员。
黄宪	独立董事	男	中共党员,博士,博士生导师,曾任武汉大学教师、商学院副院长,美国新泽西西东大学访问学者,武汉大学珞珈城市信用社副董事长,中港合资武新公司财务总经理。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师。
宋晓燕	独立董事	女	中共党员,法学博士,律师。曾任武汉大学管理学院国际金融系教师。现任上海财经大学法学院教授。
注:上述人员之间均不存在近亲属关系			

2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
郭自祥	监事会主席	男	硕士,曾任武钢二钢厂宣传部部长、武钢工会副书记、副主席,武汉钢铁(集团)公司办公室主任。现任武汉钢铁集团公司企业管理部部长。
柳杨	监事	男	硕士,审计师。曾任长江证券有限责任公司财务总部会计员、核算部经理、总经理助理,现任长江证券股份有限公司财务负责人、财务总部总经理。
王罗洁	监事	女	大学本科,高级会计师,曾任核工业部国营792矿统计员、计划科长,上海海欣股份有限公司财务副经理、经理、财务副总监等职,现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。
覃波	监事	男	中共党员,大学本科。曾任长江证券有限责任公司债券基金事业部市场部主管、长信基金管理有限责任公司市场开发部区域经理、营销策划部副总监、总经理助理兼市场开发部总监。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼专户理财部总监。
刘耘	监事	女	中共党员,硕士。曾任湖北经贸实业公司暨大通(中国)国际运输有限责任公司湖北分公司会计主管、深圳蓝天基金管理公司暨武汉蓝天房地产发展有限公司财务部经理、武汉国有资产经营公司资产财务部副经理、长信基金管理有限责任公司基金事务部总监、市场开发部副总监。现任长信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。
注:上述人员之间均不存在近亲属关系			

3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
蒋学杰	总经理	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	金融学硕士,EMBA。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理,长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理,长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。现任长信基金管理有限责任公司督察长。
注:上述人员之间均不存在近亲属关系			

4、本基金基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
曾芒	本基金的基金经理、长信恒利优势股票基金的基金经理,投资管理部总监	2006年11月9日至今	经济学博士。曾就职于上海海通证券公司武汉营业部、上海智盛企业管理咨询有限公司、武汉华正投资顾问有限公司,先后从事自营、证券投资管理、企业研究等工作,有较丰富的证券投资管理经验和良好的投资管理业绩。2005年7月加入长信基金管理有限责任公司投资管理总部担任高级研究员。现任长信基金管理有限责任公司投资管理部总监。自2006年11月9日起,担任本基金的基金经理,2009年7月30日起担任长信恒利优势股票基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
蒋学杰	总经理
叶琦	总经理助理、金融工程部总监、国际业务部总监
曾芒	投资管理部总监、长信增利动态策略股票基金的基金经理、长信恒利优势股票基金的基金经理
李小羽	固定收益部总监、长信利丰债券基金的基金经理
骆泽斌	研究发展部总监
注:上述人员之间均不存在近亲属关系	

(三)内部组织结构及员工情况

内部组织结构及员工情况			
股东会是公司的最高权力机构,下设董事会和监事会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制,总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。			
公司经营管理层下设的委员会	内部控制委员会、投资决策委员会、特定客户资产投资决策委员会等三个委员会		
公司内部组织结构	金融工程部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、交易管理部、基金事务部、市场开发部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、专户理财部、国际业务部		
分支机构	北京分公司、武汉办事处		
员工总数	98人(截至2010年5月9日)		
员工学历构成	学历	人数	占比
	博士	7人	7%
	硕士	46人	47%
	本科	37人	38%
	专科	6人	6%
	其它	2人	2%
	总计	98人	100%

二、基金托管人

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")

住所: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

成立时间:1996年2月7日

基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号

组织形式:股份有限公司(上市)

注册资本:18,823,001,989元人民币

存续期间:持续经营

电话:010-58560666

联系人:关悦

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销中心:长信基金管理有限责任公司	
注册地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心九楼	
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心九楼	
法定代表人:田丹	联系人:孙赵辉
电话:021-61009916	传真:021-61009917
客户服务专线:400-700-5566	公司网站:ww.cxfund.com.cn

2、场外代销机构

(1)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:项俊波	联系人:蒋浩
电话:010-85109219	传真:010-85109219
客户服务电话:95599	网址:www.abchina.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	
客户服务电话:95566	网址:www.boc.cn

(3)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:郭树清	联系人:张静
电话:010-66275654	传真:010-66275654
客户服务电话:95533	网址:www.ccb.com

(4)交通银行股份有限公司	
注册地址:上海市银城中路188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:曹榕
电话:021-58781234	传真:021-58408483
客户服务电话:95559	网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司	
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦	
法定代表人:秦晓	联系人:马强
电话:0755-83198888	传真:0755-83195109
客户服务电话:95555	网址:www.cmbchina.com

(6)上海浦东发展银行股份有限公司	
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500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:徐伟、虞谷云
电话:021-61618888	传真:021-63604199
客户服务电话:95528	网址:www.spdb.com.cn

(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:福州市湖东路154号中山大厦	
法定代表人:高建平	联系人:曾鸣
电话:0591-87839338	传真:0591-87841932
客户服务电话:95561	网址:www.cib.com.cn

(8)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、吴海鹏
电话:010-58351666	传真:010-83914283
客户服务电话:95568	网址:www.cmbc.com.cn

(9)中信银行股份有限公司	
注册地址:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
办公地址:北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座	
法定代表人:孔丹	联系人:黎珊
电话:010-65557018	
客户服务电话:95558	公司网址:bank.ecitic.com

(10)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	
法定代表人:牛冠兴	联系人:俞江
电话:0755-82558305	传真:0755-28558355
客户服务电话:4008-001-001	网址:www.essence.com.cn

(11)长城证券有限责任公司	
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层	
办公地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层	
法定代表人:黄耀华	联系人:匡婷
电话:0755-83516289	传真:0755-83516199
客户服务电话:400-6666-888	网址:www.cgws.com

(12)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	
办公地址: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
电话:027-65799999	传真:027-85481900
客户服务电话:4008-888-999或027-85808318	网址:www.95579.com

(13)大通证券股份有限公司	
注册地址:辽宁省大连市中山区人民路24号	
办公地址:辽宁省大连市中山区延安路1号保嘉大厦15-16层	
法定代表人:于宏民	联系人:谢立军
电话:0411-39673202	传真:0411-39673219
客户服务电话:4008-169-169	网址:www.daton.com.cn

(14)德邦证券有限责任公司	
注册地址:上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼	
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼	
法定代表人:方加春	联系人:罗芳
电话:021-68761616	传真:021-68767981
客户服务电话:400-8888-128	网址:www.tebon.com.cn

(15)东方证券股份有限公司	
注册地址:上海市中山南路318号新源广场2号楼22-29层	
办公地址:上海市中山南路318号新源广场2号楼21-29层	
法定代表人:潘鑫军	联系人:吴宇
电话:021-63325888	传真:021-63326786
客户服务电话:95503	网址:www.dfzq.com.cn

(16)东吴证券有限责任公司	
注册地址:苏州工业园区翠园路181号	
办公地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层	
法定代表人:吴永敏	联系人:方晓丹
电话:0512-65581136	传真:0512-65588021
客户服务电话:0512-33396288	网址:www.dwzq.com.cn

(17)光大证券股份有限公司	
注册地址: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
电话:021-22169999	传真:021-22169134
客户服务电话:4008888788、10108998	网址:www.ebscn.com

(18)广发华福证券有限责任公司	
注册地址: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、8、10层	
法定代表人:黄金琳	联系人:张腾
电话:0591-87841160	传真:0591-87841150
客户服务电话:0591-96326	网址:www.gfhfzq.com.cn

(19)广发证券股份有限公司	
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼	
办公地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼	
法定代表人:王志伟	联系人:肖中梅
电话:020-87555888转各营业网点	传真:020-87557985
客户服务电话:95575或致电各地营业部	网址:www.gf.com.cn

(20)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楼10层	
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9楼10层	
法定代表人:王少华	联系人:黄静
电话:010-84183389	传真:010-84183311-3389
客户服务电话:400-818-8118	网址:www.guodu.com

(21)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:冉云	联系人:金喆
电话:028-86690126	传真:028-86690126
客户服务电话:4006600109	网址:www.gjzq.com.cn

(22)国泰君安证券股份有限公司	
注册地址:上海市浦东新区商城路618号	
办公地址:上海市银城中路168号上海银行大厦29楼	
法人代表人:祝幼一	联系人:芮敏祺
电话:021-38676161	传真:(021)62583439
客户服务热线:4008888666	网址:www.gtja.com

(23)海通证券股份有限公司	
注册地址:上海市淮海中路98号	
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
电话:021-23219000	传真:021-23219100
客户服务电话:400-8888-001或95553	网址:www.htsec.com

(24)宏源证券股份有限公司	
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦	
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号宏源证券	
法定代表人:冯戎	联系人:李巍
电话:010-88085858	传真:010-88085195
客户服务电话:4008-000-562	网址:www.hysec.com

(25)华宝证券有限责任公司	
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层	
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦23层	
法定代表人:陈林	联系人:楼斯佳
电话:021-50122222	传真:021-50122078
客户服务电话:021-38929908	网址:www.cnhbstock.com

(26)华龙证券有限责任公司	
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号	
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号	
法定代表人:李晓安	联系人:李昕田
电话:0931-4890100	传真:0931-4890118
客户服务电话:0931-8730264	网址:www.hlzqgs.com

(27)华泰联合证券有限责任公司	
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层	
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层	
法定代表人:马昭明	联系人:盛宗凌
电话:0755-82492000	传真:0755-82492962
客户服务电话:95513、400-8888-555	网址:www.lhzq.com

(28)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:徐世旺
电话:0451-82336863	传真:0451-82287211
客户服务电话:400-666-2288	网址:www.jhzq.com.cn

(29)江南证券有限责任公司	
注册地址:南昌市抚河北路291号	
办公地址:南昌市抚河北路291号	
法定代表人:姚江涛	联系人:余雅娜
电话:0791-6768763	传真:0791-6789414
客户服务电话:400-8866-567	网址:www.scstock.com

(30)齐鲁证券有限公司	
注册地址:山东省济南市经十路20518号	
办公地址:山东省济南市经十路20518号	
法定代表人:李玮	联系人:吴阳
电话:0531-81283938	传真:0531-81283900
客户服务电话:95538	网址:www.qlzq.com.cn

(31)上海证券有限责任公司	
注册地址:上海市西藏中路336号上海证券	
办公地址:上海市西藏中路336号	
法定代表人:郁忠民	联系人:张瑾
电话:021-53519888	传真:021-53519888
客户服务电话:4008918918、021-962518	网址:www.962518.com

(32)天相投资顾问有限公司	
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701	
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层	
法定代表人:林义相	联系人:莫晓丽
电话:010-66045529	传真:010-66045500
客户服务电话:010-66045678	网址:www.txsec.com

(33)西藏证券经纪有限责任公司	
注册地址:拉萨市罗布林卡路6号	
办公地址:上海市辉河路118号	
法定代表人:贾绍君	联系人:刘宇
电话:021-65526481	传真:021-65526481
客户服务电话:400-8811-177	网址:www.xzsec.com

(34)湘财证券有限责任公司	
注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼	
办公地址:上海银城中路188号交银金融大厦	
法定代表人:陈学荣	联系人:杜颖灏
电话:021-68634518	传真:021-68865938
客户服务电话:400-888-1551	网址:www.xcsc.com

(35)兴业证券股份有限公司	
注册地址:福建省福州市湖东路99号标力大厦	
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	
客户服务电话:400-8888-123	网址:www.xyzq.com.cn

(36)招商证券股份有限公司	
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层	
办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层	
法定代表人:宫少林	联系人:林生迎
电话:0755-82960223	传真:0755-82943121
客户服务电话:95565或400-8888-111	网址:www.newone.com.cn

(37)中国民族证券有限责任公司	
注册地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层	
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层	
法定代表人:赵大建	联系人:姜建平
电话:010-59355543	传真:010-66553791
客户服务电话:40088-95618	网址:www.e5618.com

(38)中国银河证券有限责任公司	
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	
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:顾伟国	联系人:田薇
电话:010-66568888	传真:010-66568536
客户服务电话:4008-888-888	网址:www.chinastock.com.cn

(39)中信建投证券有限责任公司	
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼	
办公地址:北京市朝阳门内大街188号	
法定代表人:张佑君	联系人:权唐
电话:010-85130588	传真:010-65182261
客户服务电话:400-8888-108	网址:www.csc108.com

3、场内销售机构
场内代销机构是指有资格的上证所会员,名单详见上海证券交易所网站:http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjjt.jsp

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金份额,并及时公告。

(二)与本基金有关的注册登记机构、律师事务所、会计师事务所信息:

信息类型	注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限责任公司	上海源泰律师事务所	毕马威华振会计师事务所
注册地址	北京西城区金融大街27号投资广场23层	上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室	北京东长安街1号东方广场东2座8层
办公地址	北京西城区金融大街27号投资广场23层	上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室	上海南京西路1266号恒隆广场50楼
法定代表人	陈耀先	廖海(负责人)	萧伟强
联系电话	010-58598839	021-51150298	021-22122888
传真	010-58598907	021-51150398	021-62881889
联系人	朱立元	廖海、吴军娥(已离职)	彭成初(黄小熠、王国蓓为经办注册会计师)

四、基金的名称

长信增利动态策略股票型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

本基金对上市公司股票按照价值型与成长型进行风格划分,通过对证券市场未来走势的综合研判灵活配置两类风格的股票,从而在风险适度分散并保持组合流动性的基础上超越比较基准,获得长期增值回报。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行并上市的股票(含新股配售与增发)、权证、债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票包括所有在交易所上市的A股;债券包括国债、金融债、企业债、可转债等;货币市场工具包括各种回购、央行票据、短期融资券、同业存款以及剩余期限在1年以内的短期债券等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金采用目前国外比较流行的风格轮换策略,以经过品质筛选的沪深A股为基本股票池,根据股票风格管理系统对个股进行风格分类,在量化分析的基础上对价值型和成长型两类风格股票进行主动投资,以获得超过比较基准的持续回报。

投资策略方面,本基金采用自上而下和自下而上相结合的策略结构。基金投资策略体系自上而下分为3个层面:战略配置、风格配置和个股选择。本基金为股票型基金,在整个投资体系中,本基金将重点放在风格配置和个股选择层面,这两个层面对基金收益的贡献程度约占80%,战略配置对基金收益的贡献程度约占20%。在风格配置和个股选择层面,本基金将以风格轮换策略为主,辅以多层次个股选择,形成基金最后的投资组合。在投资过程中,本基金的股票风格管理系统和风险控制绩效量化管理平台将提供量化分析方面的决策支持。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%

如果将来出现更合适的业绩比较基准,本基金将根据实际情况适当调整业绩比较基准,并在报送监管机构后予以公布。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年4月19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。

本投资组合报告所载数据截至2010年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)本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	2,329,043,055.42	63.35
	其中:股票	2,329,043,055.42	63.35
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	1,018,685,585.87	27.71
6	其他资产	328,715,095.10	8.94
7	合计	3,676,443,736.39	100.00

(二)股票投资组合

1、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	9,986,129.70	0.27
B	采掘业	27,710,891.20	0.76
C	制造业	1,342,099,734.91	36.87
C0	食品、饮料	85,224,600.00	2.34
C1	纺织、服装、皮毛	44,426,726.99	1.22
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	334,714,217.93	9.20
C5	电子	35,583,000.00	0.98
C6	金属、非金属	308,210,902.32	8.47
C7	机械、设备、仪表	533,940,287.67	14.67
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	107,671,869.82	2.96
E	建筑业	2,525,308.28	0.07
F	交通运输、仓储业	386,671,809.87	10.62
G	信息技术业	55,089,683.16	1.51
H	批发和零售贸易	27,439,398.45	0.75
I	金融、保险业	253,112,187.28	6.95
J	房地产业	41,379,772.41	1.14
K	社会服务业		
L	传播与文化产业	75,341,435.34	2.07
M	综合类	14,835.00	0.00
	合计	2,329,043,055.42	63.99

2、基金投资前十名股票明细

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	002202	金风科技	7,578,369	261,605,297.88	7.19
2	000059	辽通化工	14,899,679	187,586,958.61	5.15
3	000422	湖北宜化	7,080,000	142,378,800.00	3.91
4	000012	南玻A	6,109,790	133,132,324.10	3.66
5	000401	冀东水泥	7,470,153	129,980,662.20	3.57
6	600582	天地科技	4,180,000	123,519,000.00	3.39
7	601919	中国远洋	8,800,000	112,024,000.00	3.08
8	601989	中国重工	16,000,000	111,680,000.00	3.07
9	000001	深发展A	4,500,000	104,400,000.00	2.87
10	601601	中国太保	3,800,000	102,600,000.00	2.82

(三)债券投资组合

1、按投资品种分类的债券投资组合

本报告期末未持有债券。

2、基金投资前五名债券明细:

本报告期末未持有债券。

(四)权证投资组合

本基金本报告期末未持有权证。

(五)资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(六)报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

2、本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,440,249.02
2	应收证券清算款	324,939,364.17
3	应收股利	-
4	应收利息	304,703.77
5	应收申购款	30,778.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	328,715,095.10

4、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。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩部分

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。

基金2010年第一季度及历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2007年	152.23%	1.92%	98.52%	1.61%	53.71%	0.31%
2008年1月1日至2008年12月31日	-52.72%	2.36%	-50.46%	2.13%	-2.26%	0.23%
2009年1月1日至2009年12月31日	42.98%	1.59%	62.82%	1.43%	-19.84%	0.16%
2010年1月1日至2010年3月31日	-4.94%	1.13%	-3.98%	0.91%	-0.96%	0.22%

自合同生效之日(2006年11月9日)至2010年3月31日期间,本基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比:

注:1、图示日期为2006年11月9日至2010年3月31日。

2、按基金合同规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时,本基金的各项投资比例已符合基金合同中关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定:股票类资产占基金资产总净值比例为60%-95%,债券类资产占基金资产总净值比例为0-35%,货币市场工具占基金资产总净值比例为5-40%。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按该基金资产净值的1.5%年费率计提:

基金	管理费率(%)
长信增利动态策略基金	1.5%

管理费计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提:

基金	托管费率(%)
长信增利动态策略基金	0.25%

计算方法如下:

H=E×2.5‰÷当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

申购金额(M,含申购费)	前端申购费率
M<100万	1.50%
100万≤M<500万	1.00%
M≥500万	1000元

上述费率为2008年6月2日开始的调整后的费率,详见2008年5月20日发布的《长信基金管理有限责任公司关于调整旗下股票基金交易手续费费率的公告》。

投资者也可以采用后端收费模式,费率如下:

持有时间(N,年)	后端申购费率
N<1年	1.8%
1年≤N<3年	1.2%
3年≤N<5年	0.6%
N≥5年	0

本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内,基金管理人可决定实际执行的申购、赎回费率,并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时,应最迟于新的费率开始实施前3个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

基金申购费用计算公式:

(1)前端收费模式:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

(2)后端收费模式:

申购份额=申购金额/T日基金份额净值

2、赎回费用

赎回费率如下:

持有时间(N,年)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.3%
N≥2年	0

(1)前端收费模式:

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

(2)后端收费模式:

赎回总额=赎回份额×T日基金份额净值

后端申购(认购)费用=赎回份额×申购日基金份额净值(基金份额面值)×后端申购(认购)费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端申购(认购)费用-赎回费用

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取,扣除注册登记费和其他手续费后的余额为赎回费总额的25%,归入基金财产。

本基金自2007年9月1日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时,将在开始实施前3个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

3、基金的转换费

本公司已开通了长信增利动态策略股票基金与长信利息收益货币基金、长信银利精选股票基金、长信金利趋势股票基金、长信双利优选混合基金、长信利丰债券基金、长信恒利优势股票基金之间实现双向转换。同时实行前端收费基金和前端收费基金互转,前后端收费基金不得互转。

(1)根据中国证监会[2009]32号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定,本公司从2010年4月23日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下:

1)投资者进行基金转换时,转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时,费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额;当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时,不收取费用补差。

2)转换份额的计算公式:

a、非货币基金之间转换

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时,补差费为零)

b、货币基金转至非货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益

补差费=转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(货币基金份额净值为1.00元,没有赎回费)

(2)本基金自2007年9月1日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时,将在开始实施前3个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金原招募说明书(《长信增利动态开放式证券投资基金招募说明书》)进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"部分,对内部组织结构和员工情况进行了更新;

2、在"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料;

3、在"五、相关服务机构"部分,增减和更新了代销机构的基本资料;

4、在"八、基金的申购、赎回与转换"部分,更新了基金的转换的内容;

5、在"十、基金的投资、十一、基金的业绩"部分,更新了最近一期投资组合报告的内容和基金的投资业绩;

6、在"二十二、对基金份额持有人的服务"部分,更新并完善了相应的服务;

7、在"二十三、其他应披露事项"部分,披露了本次更新以来涉及本基金的相关公告事项。

长信基金管理有限责任公司

2010年6月23日