长盛量化红利策略股票型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金由基金管理人经中国证券监督管理委员会2009年9月10日证监许可〔2009〕927号文核准募集。本基金的基金合同于2009年11月25日正式生效。

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预示其未来表现。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2010年11月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效的日期

2009年11月25日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

1、基本信息

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：北京市海淀区北大平庄路18号城建大厦A座21层

法定代表人：凤良志

电话：010-82255818

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字〔1999〕6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）占注册资本的41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省信用担保集团有限公司（原安徽省创新投资有限公司）占注册资本的13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截至2010年11月25日，基金管理人共管理两只封闭式基金、十三只开放式基金和六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，博士，高级经济师。历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、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、安徽省政府驻香港窗口公司（筹）有限公司董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理（挂职工作）、安徽国元控股（集团）有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长。现为国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）董事长。

陈平先生，副董事长，硕士。曾任教于合肥工业大学管理系，历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理、国元证券有限责任公司副总裁。2004年10月始任长盛基金管理有限公司董事。

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。现为安徽省信用担保集团有限公司总经理。

杜长棵先生，董事，学士。历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有限责任公司党委书记、总经理。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国（纽约）分公司任财务经理，历任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司（筹）有限公司总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理。现为国元证券股份有限公司（原国元证券有限责任公司）董事、总裁。

何玉珠女士，董事，学士。历任JP摩根证券（亚洲）有限公司副总裁、瑞银集团董事总经理。现为星展资产管理有限公司首席执行官、新加坡财富管理学院资深顾问。

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。

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，美国密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，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）高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及上海复旦大学顾问教授，香港城市大学讲座教授。现为香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署转下的《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。

梁兆祥先生，独立董事，教授。曾任安徽大学校经济学院副院长、院长。现为安徽大学教授、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，博士毕业，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，中国科技大学管理学院商务智能实验室主任。

2、基金管理人监事会成员：

陈锦光先生，监事会主席，学士，特许金融分析师。曾任职于美国银行直投伙伴公司私募股权投资部门，历任野村证券商科技产业研究分析师、野村证券上海办事处及证券研究部门负责人、星展资产管理有限公司研究总监以及投资亚洲和中国国内市场的投资经理人。现为星展资产管理有限公司股票投资团队总监。

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。现为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，历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理。现为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。现为安徽省投资集团有限责任公司总经济师。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计、大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和财务会计部总监。现为长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

3、基金管理人高级管理人员

凤良志先生，董事长，博士，高级经济师。同上。

陈礼华先生，硕士，高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员，华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理，南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监，长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

周长宏先生，硕士，经济师。历任中国银行石家庄分行计划部副主任科员、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（期间兼任南京中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等职。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

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）。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

朱剑彪先生，金融学博士。历任广东商学院投资金融系教师、党支部书记；广州证券有限公司宏观与策略研究员、投资银行部项目经理、基金部经理；金鹰基金管理有限公司筹备组成员、董事会秘书、研究总监、投研副总监兼研究总监和督察长。2007年4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、研究发展部总监、社保组合组合经理。

叶金松先生，大学，会计师。历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、经理等职。现任长盛基金管理有限公司督察长。

4、本基金基金经理

刘斌先生，1979年6月出生。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、基金经理助理等职务。自2009年11月25日起任长盛量化红利策略股票型证券投资基金（本基金）基金经理，自2010年8月4日起兼任长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理。

（本招募说明书基金经理任职日是指公司批准日或公司公告日。）

5.投资决策委员会成员

陈礼华先生，硕士，总经理，同上。

朱剑彪先生，金融学博士，副总经理，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，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部执行总监，长盛成长价值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。

张平女士，清华大学经济学硕士、法国工程师学院MBA，美国特许金融分析师CFA。历任中国银河证券债券研究员、中国人保资产债券投资主管、高级研究员等职务。现任长盛基金管理有限公司社保业务管理部和固定收益部总监，社保组合组合经理。

白仲光先生，金融工程专业工学博士，2003年加入长盛基金管理有限公司，历任研究员、高级金融工程师、基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部总监，长盛中证100指数基金基金经理。

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，历任星展集团亚太区业务经理助理、星展增裕基金经理；新加坡华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。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币334,018,850,026元

联系电话：010-66105799

联系人：蔡松云

（二）主要人员情况

截至2010年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工121人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年开展托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，严格履行资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、先进的业务营运系统和专业的托管服务团队，为广大投资者、众多资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。建立了包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、收支账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、银行理财产品等门内齐全的托管产品体系。截至2010年9月，中国工商银行共托管证券投资基金177只，其中封闭式8只，开放式169只。2010年，中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《金球托管人》、香港《财资》和美国《环球金融》评选为“2009年度中国最佳托管银行”，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。”

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

①长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市海淀区北大平庄路18号城建大厦A座20层

邮政编码：100088

电话：010-82255818转263、288

传真：010-82255981、82255982

联系人：张元

②长盛基金管理有限公司上海分公司

地址：上海浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1601室

电话：021-68889056、021-68889206

传真：021-68889156

联系人：冯岩

③长盛基金管理有限公司华南营销中心

地址：深圳市福田区福中三路1006号诺德中心8层GH单元

电话：0755-88267980

传真：0755-82022118

联系人：林瑛

2、代销机构

①中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：010-66104230

传真：010-66108013

联系人：龚孟迪

客户服务电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

②中国建设银行股份有限公司

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：郭树清

电话：010-67597114

联系人：何毅

客户服务电话：95533

网站：www.ccb.com

③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

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

银行网站：www.boc.cn

④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：项俊波

客户服务电话：95599

网址：www.95599.cn

⑤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：秦晓

电话：0755-83077278

传真：0755-83195050

联系人：邓炯鹏

咨询电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

⑥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

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

⑦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

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

网站：www.cmbc.com.cn

⑧华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

联系人：刘丰

电话：010-85238421

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

⑨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

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：齐丹丹

电话：010-65557072

传真：010-65550827

网址：http://bank.ecitic.com

⑩中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人：刘安东

传真：010-66415194

联系人：陈春林

客户服务电话：11185

网址：www.psbc.com

（11）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

电话：021-61618888

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、虞谷云

客户服务热线：95528

网站：www.spdb.com.cn

（12）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

法定代表人：高建平

联系人：曾鸣

电话：021-52629999

客户服务电话：95561，或拨打当地咨询电话

公司网站：www.cib.com.cn

（13）广东发展银行股份有限公司

注册地址：广州市东风东路水荫路83号

法定代表人：李若虹

客户服务电话：020-3832 2222

网址：www.gdb.com.cn

（14）国元证券股份有限公司

住所：合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

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：0551-2634400-3612

联系人：李蓉

（15）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：金芸

联系电话：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客服电话：400-8888-001、021-962503

公司网址：http://www.htsec.com/

（16）招商证券证券股份有限公司

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：霍经一

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

联系人：芮敏祺

公司网址：http://www.gtja.com/

（17）中信万通证券有限责任公司

证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区香港东路316号

办公地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

联系电话：0532-5022026

传真：0532-5022026

联系人：丁韶燕

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（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：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼

法定代表人：徐浩明

联系人：刘俊

联系电话：021-50818887-281

客户咨询电话：021-68823685

公司网址：www.ebscn.com

（19）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

电话：021-54033888

传真：021-54035333

联系人：李清怡

公司网址：www.sw2000.com.cn

（20）中信金通证券有限责任公司

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

（21）第一创业证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25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层

法定代表人：刘学民

开放式基金咨询电话：0755-25832686

开放式基金业务传真：0755-25831718

联系人：杨柳

公司网址：http://www.firstcapital.com.cn/

（22）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

法定代理人：陈林

联系人：楼剑佳

联系电话：021-50122107

客户咨询电话：021-50122222

公司网址：www.cnhbstock.com

（23）齐鲁证券有限公司

地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283938

传真：0531-81283735

联系人：傅咏梅

（24）广发华福证券有限公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦8层

法定代理人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客服热线：0591-87383333

公司网站：http://www.gfhfzq.com.cn/

（25）中航证券有限公司

注册地址：南昌市抚河北路291号

法定代表人：杜航

联系人：戴雷

电话：0791-6768763

客户服务热线：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

（26）中国建银投资证券有限责任公司

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层至20层

法定代表人：杨明辉

联系人：杨瑞芳

电话：0755-82026511

传真：0755-82026521

客户服务热线：4006-008-008

中投证券网站：http://www.cjis.cn/

（27）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

法定代表人：顾伟国

电话：010-66568047

传真：010-66568116

联系人：李洋

客服电话：400-888-8888

公司网址：http://www.chinastock.com.cn/

（28）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

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

客户服务热线：95565

公司网址：http://www.newone.com.cn/

（29）万国证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558323

传真：0755-82558355

联系人：余江

公司网址：http://www.essence.com.cn/

（30）东北证券股份有限公司

住所：长春市人民大街138-1号

办公地址：长春市人民大街138-1号

法定代表人：李树

开放式基金咨询电话：0431-96688-0、0431-5096733

开放式基金业务传真：0431-5680032

联系人：潘俊

公司网址：www.nesc.cn

（31）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

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：0755-33680000 400 6666 888

公司网站：www.cc168.com.cn

（32）华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

联系人：盛宗凌

客户服务电话：95513

公司网站：www.lhzq.com

（33）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

法定代表人：况雨林

联系人：王敏

电话：0871-3577011

客户服务电话：0871-3577930

公司网址：www.hongtazq.com

（34）中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝内大街188号

法定代表人：张佑军

联系人：权丽

电话：400-8888-108

传真：010-65182261

公司网址：http://www.csc108.com/

（35）广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼

法定代表人：王志伟

联系电话：020-87555888

传真：020-87557985

联系人：肖中梅

公司网站：www.gf.com.cn

（36）民业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

联系电话：021-38565785

客服电话：400-888-8123

公司网站：www.xyzq.com.cn

（37）信信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（38）德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建大厦26楼

法定代表人：方加春

电话：021-68761616

传真：021-68767981

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

客户服务电话：400-888-8128

（39）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

电话：025-84457777-893

传真：025-84579763

联系人：程高峰

（二）注册登记机构

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：北京市海淀区北大平庄路18号城建大厦A座21层

法定代表人：凤良志

电话：010-82255818

传真：010-82255988

联系人：戴君棉

（三）法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：吕红

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

注册地址：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：马颖脆、张鸿

五、基金的名称

本基金名称：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

六、基金的类型

基金类型：契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。

八、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融投资工具，包括股票、债券等。此外，本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金资产配置比例为：股票类资产占基金资产的比例为60%-95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的80%。债券类资产占基金资产的比例为0%-40%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，现金或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的程序后，可以将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略与程序

本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。

a）大类资产配置策略

本基金综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，在规定范围内合理确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高资产配置效率。

b）股票投资策略

1. 红利风格股票池

本基金的股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。红利股票具有如下特征：

①行业竞争优势明显，企业属于国民经济增长中的重点支柱行业，或受国家政策鼓励扶持的优势行业，具有较强的核心竞争优势；

②行业发展状况良好，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性；

③企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高，现金流创造能力强，资产盈利水平较高；企业财务状况良好，各项指标健康；

④企业分红派息率较高，企业历年的分红派息率较高，特别是现金分红能力强且分红期率较高。

上市公司的分红派息、利润增长和盈利能力是红利股票特征的基本量化指标。因此，红利风格股票初选标准如表1所示：

表1：红利风格股票池的初选标准

股票筛选指标	指标条件
分红能力	上一年度的现金股息率大于0。
利润增长	过去三年的EPS平均增长率在全市场排名前50%
盈利能力	过去三年的累计净利润大于0。

在上述初选的基础上，本基金按照预期股息率对初选股票进行排序，选取排名前70%的股票构成最终的红利风格股票池。其中，预期股息率采用一致预期净利润增长率和前三年上市公司历史平均现金股利发放率作为测算依据。

此外，根据对上市公司基本面研究，结合宏观经济、行业经济发展周期性的研究判断，每半年对红利股票池进行调整。

2.股票组合的构建

本基金在数量化股票选择模型所生成的红利风格股票池的基础上，采用核心-卫星策略配置股票资产。

①核心股票组合的构建

本基金核心股票组合以量化方法和模型进行构建，是基金股票资产配置的核心内容。核心股票组合是保证基金股票投资收益的稳健性并使基金资产具有明显红利收益的风格特征。

核心股票组合构建是通过对红利风格股票池中的股票再进一步量化筛选，并根据多因子指标来对红利风格股票池中的股票进行评分，选取评分排名在前50%的股票为所选择投资的红利核心股票。其中，多因子指标包括预期股息率、PB、PE、PCF、净利润增长率、ROE等指标，采用等权重法确定股票评分。

通过上述多因子量化评分及筛选方法选出核心红利股票后，采用股票组合优化模型来确定个股权重，从而构建基金股票资产的红利核心股票组合。其中，股票组合的优化目标是使核心组合的风险调整后收益最大化。

②卫星股票组合的构建

本基金在保证核心股票组合风险和收益稳健性的同时，积极利用卫星股票资产的灵活增强配置以获取基金股票组合的超额投资收益。

根据宏观经济波动、行业周期性及上市公司基本面等因素的分析，确定宏观及行业经济变量的变动对股票市场的潜在影响，并根据基金管理人的研究及投资决策判断，增强配置具有超预期增长和深度投资价值的股票作为卫星资产，以此灵活构建卫星股票组合。

③核心-卫星策略的实施

本基金核心-卫星股票组合的比例根据风险预算来确定和配置实施，其中核心股票组合的配置比例不低于股票资产的60%。每季度对基金股票资产中核心-卫星组合进行再平衡和头寸管理，即再平衡核心-卫星资产的比例及组合中个股权重，以使得红利股票组合中的个股在组合中的权重符合风险收益要求，并达到投资目标。

c）债券投资策略

本基金在实际的投资管理运作中，将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略，以获取债券市场的长期稳定收益。

①利率配置策略

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。通过研究分析宏观经济、预测财政政策、货币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。

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，分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平，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。

③信用配置策略

信用策略主要是根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券发行人所处行业发展前景，发行人业务发展状况，企业市场地位，财务状况，管理水平，债务水平等因素，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。对企业债券信用级别的研判与投资，主要是发现信用风险利差上的相对投资机会，而不是绝对收益率的高低。

④相对价值策略

本基金认为市场普遍存在着失效的现象，短期因素的影响就过分夸大。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。

⑤单个债券选择策略

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。

d）权证投资策略

本基金投资权证的原则是有利于基金资产增值和投资风险控制，具体权证投资的策略是：

①考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，利用Black-Scholes模型、二叉树模型及其它权证定价模型计算权证合理价值。

②根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价（Value Price）”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。

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻与实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

1）决策依据

国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定是本基金进行投资的前提；宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势是本基金投资决策的基础；投资对象收益和风险的科学合理配比是本基金维护投资者利益的重要保障。

2）决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的资产配置建议报告对基金的资产配置下达指导性意见，基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责。

1、投资组合的构建

①股票投资组合的构建。通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。

②债券投资组合的构建。在科学预测利率变动的前提下，通过久期管理等策略稳健地进行债券投资，控制债券投资风险。

③权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。

2、交易过程

基金经理通过投资管理系统向交易部下达投资指令。交易部负责交易执行和一线监控。

3、投资组合调整过程

基金经理密切关注宏观经济及市场形势，结合基金申购赎回情况和组合调整情况等，对投资组合进行动态监控和调整。

4、业绩与风险评估过程

基金经理小组和金融工程部按照投资决策委员会指导性方针和投资实施方案对投资业绩进行评估。

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准：75%*中证红利指数+25%*中证综合债指数

十一、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金产品，风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，属于较高风险、较高回报的基金产品。

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——中国工商银行股份有限公司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量化红利股票型证券投资基金2010年第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	资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	676,829,705.25	79.31
	其中：股票	676,829,705.25	79.31
2	固定收益投资	4,977,745.40	0.58
	其中：债券	4,977,745.40	0.58
	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	158,010,766.36	18.52
6	其他资产	13,597,137.26	1.59
7	资产合计	853,415,354.27	100.00

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	676,829,705.25	79.31
	其中：股票	676,829,705.25	79.31
2	固定收益投资	4,977,745.40	0.58
	其中：债券	4,977,745.40	0.58
	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	158,010,766.36	18.52
6	其他资产	13,597,137.26	1.59
7	资产合计	853,415,354.27	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	17,665,623.36	2.09
B	采掘业	36,373,211.04	4.30
C	制造业	423,704,494.73	50.09
C0	食品、饮料	45,030,804.81	5.32
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	49,307,410.03	5.83
C5	电子	25,356,766.02	3.00
C6	金属、非金属	29,147,394.80	3.45
C7	机械、设备、仪表	167,587,743.49	19.81
C8	医药、生物制品	88,796,368.48	10.50
C99	其他制造业	18,478,007.10	2.18
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	14,968,992.64	1.77
G	信息技术业	37,596,611.80	4.44
H	批发和零售贸易	29,488,808.10	3.49
I	金融、保险业	79,387,788.20	9.39
J	房地产业	22,356,679.48	2.64
K	社会服务业	15,287,495.90	1.81
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	676,829,705.25	80.02

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	17,665,623.36	2.09