长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)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:招商银行股份有限公司

重要提示:

本基金2010年5月14日经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]646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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动而波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。投资本基金的风险包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险,本基金根据股票与债券市场的波动趋势灵活配置股票与债券的投资比例,在系统研究基础上判断股票市场与债券市场的未来趋势,有可能发生判断失误的风险等。投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2011年8月4日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效的日期:2010年8月4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%;安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截至2011年8月4日,基金管理人共管理两只封闭式基金、十四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,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(黄山有限公司)董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理(主持工作)、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。

杜长棣先生,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。现为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(塞班)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(黄山有限公司)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。现为星展银行(中国)有限公司执行董事兼行政总裁。

周兵先生,董事,硕士,经济师。历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,现为公司总经理。

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。现为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)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,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,现为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、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,历任野村证券高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,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、管理层成员

凤良志先生,董事长,博士,高级经济师。同上。

周兵先生,总经理,硕士,经济师。同上。

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,历任社保业务管理部总监、固定收益部总监、总经理助理、副总经理等职,现为长盛基金管理有限公司常务副总经理、社保组合组合经理。

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)。2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,现为公司副总经理。

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。2004年10月起加入长盛基金管理有限公司,现为公司督察长。

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、基金经理助理等职务。现任金融工程与量化投资部副总监,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

朱剑彪先生,金融学博士,常务副总经理,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。

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,现任研究发展部总监,同盛证券投资基金基金经理。

张苄女士,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。

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,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)基金托管人概况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")
设立日期:1987年4月8日
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
注册资本:215.77亿元
法定代表人:傅育宁
行长:马蔚华
资产托管业务批准文号:证监基字[2002]83号
电话:0755—83199084
传真:0755—83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截止2011年3月31日,招商银行总资产2.585万亿元人民币,核心资本充足率7.66%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务支持室、产品管理室、运营室、监察稽核室4个职能处室,现有员工52人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可,被境内外权威媒体评为"中国最佳托管专业银行"、"中国资产托管市场创新客户满意首选品牌"。6S资产托管综合业务平台荣获"深圳市金融创新奖二等奖第一名"。

经过八年发展,招商银行资产托管规模快速壮大。2010年,招商银行实现托管利润8.11亿元,托管费收入3.21亿元,托管资产突破3200亿元,托管日均存款突破300亿元,托管产品数量、托管资产规模和托管费收入稳居中小托管银行第一,基金托管新增规模居行业首位,内部控制连续四年通过SAS70国际认证。

(二)主要人员情况

傅育宁先生,招商银行董事长和非执行董事,英国布鲁诺尔大学博士学位。1999年3月开始担任本公司董事。2010年8月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司(香港联合交易所上市公司)主席,利和经销集团有限公司(香港联合交易所上市公司)及信和置业有限公司(香港联合交易所上市公司)独立非执行董事,香港港口发展局董事,香港证券及期货事务监察委员会成员等;中国南山开发(集团)股份有限公司董事长,招商局能源运输股份有限公司(上海证券交易所上市公司)董事长,及中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司(深圳证券交易所上市公司)董事长,及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

马蔚华先生,招商银行执行董事、行长兼首席执行官,1999年1月加入本公司。经济学博士学位,高级经济师。第十一届全国政协委员。1999年1月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自1999年9月、2003年9月、2007年11月及2008年10月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长,并自2002年7月起担任招商局集团有限公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生,招商银行副行长,吉林大学本科毕业,高级经济师。1995年5月加入本公司,历任沈阳分行副行长,深圳管理部副主任,兰州分行行长,上海分行行长,深圳管理部主任,总行行长助理,2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生,招商银行资产托管部总经理,大学本科,高级经济师。1993年10月进入招商银行工作;历任招商银行总行计划资金部副总经理,总行资金交易部总经理,招银国际金融有限公司总裁;招商银行济南分行党委书记、行长,2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

胡家伟先生,大学本科学历,现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历,已获得基金从业人员资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长,中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

(三)基金托管业务经营情况

截至2011年7月31日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金),招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴业合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金、诺安保本混合证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券基金、中银上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金共38只开放式基金及其它托管资产,托管资产为4537.17亿元人民币。

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
地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20层
邮政编码:100088
电话:(010)82019799、82019795
传真:(010)82255981、82255982
联系人:张莹、张晓丽

2、代销机构

(1)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
电话:0755-83077278
传真:0755-83195050
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

(2)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

(3)中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
客户服务电话:95599
网址: www.abchina.com

(4)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
法定代表人:郭树清
电话:010-67597114
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(5)中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号A座
法定代表人:刘安东
客户服务电话:95580
联系人:陈春林
传真:010- 68858117
网址:www.psbc.com

(6)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:田国立
客服电话:95558
联系人:赵树林
电话:010-65557046
传真:010-65550827
网址:http://bank.ecitic.com

(7)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:虞谷云
客户服务热线:95528
网站:www.spdb.com.cn

(8)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)66104235
传真:(010)66107914
联系人:郭越人
客户服务电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

(9)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
网址:www.cmbc.com.cn

(10)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:林芳
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(11)国元证券股份有限公司
住所:合肥市寿春路179号
办公地址:合肥寿春路179号
法定代表人:凤良志
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
联系人:祝丽萍

(12)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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑军
开放式基金咨询电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:(010)65182261
联系人:权唐

(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
联系电话:021-53594566-4125
传真:021-53858549
联系人:李笑鸣
客服电话:400-8888-001、(021)962503

(14)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:4008-888-999或027-85808318
联系人:李良
电话:021-63219781
传真:021-51062920
长江证券长网网址:www.95579.com

(15)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

(16)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:0755-82943237
联系人:林生迎
客户服务热线:4008888111、(0755)26951111

(17)广发证券股份有限公司
住所: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、41和42楼
法定代表人:林治海
统一客户服务热线:95575
开放式基金业务传真:(020)87555305
联系人:黄岚
公司网站:www.gf.com.cn

(18)国信证券有限责任公司
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1010号国际信托大厦9楼
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
联系人:林建闽
网址:www.guosen.com.cn
客户服务电话:95536

(19)广发华福证券有限责任公司
住所:福州市新天地大厦8层
办公地址:福州市新天地大厦8层
法定代表人:黄金琳
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
联系人:张腾
公司网址:www.gfhfzq.com.cn

(20)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

(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
联系电话:0755-25832686
网址:www.fcsc.cn

(22)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:顾伟国
电话:(010)66568430
传真:(010)66568536
联系人:田薇
客服电话:400-888-8888
公司网站:www.chinastock.com.cn

(23)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
电话:(021)62580818-213
传真:(021)62569400
联系人:芮敏祺

(24)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:刘晨
联系电话:021-50818887-281
客户咨询电话:021-68823685
公司网址:www.ebscn.com

(25)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

(26)平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626391
客户服务热线:95511转8
网址:www.pingan.com

(27)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:潘锴
公司网址:www.nesc.cn

(28)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
公司网址:www.tebon.com.cn

(29)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:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63081000
客户服务热线:400-800-8899@网址:www.cindasc.com

(30)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
电话:010-84864818
传真:010-84865560
联系人:张于爱
公司网址:www.ecitic.com

3.场内代销机构

本基金办理场内认购业务的代销机构为具有基金代销业务资格的深交所会员。具有中国证监会认定的基金代销业务资格且符合风险控制要求的深交所会员单位可以办理本基金的场内申购业务;具有中国证监会认定的基金代销业务资格的深交所会员单位可以办理本基金的场内赎回业务(具体办理场所以《基金开放申购、赎回公告》为准)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:陈耀先
电话:(010)59378888
传真:(010)66210938
联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:吕红
经办律师:吕红、安冬

(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:薛竞、张鸿

七、基金的名称

本基金名称:长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

八、基金的类型

1、基金的类型:股票型基金。
2、基金的运作方式:上市契约型开放式。
3、基金存续期间:不定期。

九、基金的投资目标

本基金采取指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%,以实现对基准指数的有效跟踪。

八、基金的投资范围

本基金为股票指数型基金,投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票资产投资比例不低于基金资产净值的90%,投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%;保持不低于基金资产净值5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券。

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

九、基金的投资策略与程序

(一)投资策略

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

当成份股发生分红、配股、增发等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为3个月,本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

1、资产配置策略

本基金首先确定基金资产中股票和现金之间的配置比例,再进一步以抽样复制基准指数的方法,确定抽样组合中各行业及个股的配置比例。本基金股票资产不低于基金资产净值的90%,在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下,管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后,及时将股票配置比例调整至合理水平。

2、股票组合构建

本基金采用抽样复制基准指数的方法,在综合考虑个股的自由流通市值规模、个股流动性、行业代表性、波动性以及抽样组合与标的指数的相关性等因素的基础上,采用"分层抽样+优化抽样"的两阶段抽样方法,选择标的指数成份股票或被选成份股票构建基金的抽样股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股配置比例。

(1)股票筛选

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

(2)分层抽样

在初选出的样本股票的基础上,首先按照行业分类方法进行行业类别划分,然后根据每个行业类别在标的指数中的权重、个股在行业类别中的权重、个股收益波动性和所在行业收益相关性进行抽样选取,并优先抽取收益波动与标的指数高度相关的个股。

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

(3)优化抽样

对于分层抽样后的股票样本组合,采用进一步优化方法并确定个股的权重,考虑标的指数总体收益和风险的特征情况,通过投资组合优化模型构建基金的股票资产组合,同时保证较小的调整频率和追踪成本。

优化方法是基于样本组合与标的指数的跟踪误差限制,即以跟踪误差最小化为目标函数,并以样本组合内个股集中度,组合资产规模和交易成本为附加约束条件,采用二次规划优化算法和模型,确定抽样组合及组合中个股的权重。

(4)最终组合

对于"分层抽样+优化抽样"的两阶段抽样方法得到的股票组合,将被用来构建本基金的最终股票组合。由于指数成份股的周期性变动,以及成份股的权重的变化,抽样组合将不定期进行有效跟踪,并进行相应的调整样本组合,即再"分层+优化"抽样,以保证样本组合与标的指数的跟踪误差最小化。

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

3、股票组合调整

(1)组合调整原则

本基金为抽样复制的指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、配股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(2)组合调整方法

①跟踪调整

A、定期性调整

本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案,在考虑跟踪误差风险的基础上,对股票投资组合进行相应调整。

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

B、不定期调整

根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,并根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。

C、基于流动性及法律法规限制的调整

如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素或法律法规规定的投资限制,使得基金管理人无法顺利购买某成份股,本基金管理人将视当时市场情况,综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化,决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循"同行业基础上价格相关性"原则,对于需要进行替代的股票,其替代股票将从标的指数样本或被选成份股中选取,具体将在考虑股票流动性等因素的前提下,在同行业范围内,选取相关性较大的股票进行替代。

D、在其他不影响指数复制的情况下,本基金管理人可以根据市场情况,在跟踪误差最小化的条件下,对基金资产组合进行适当的调整。

4、债券投资策略

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

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

5、权证投资策略

在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则对权证进行投资,即根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即"估值差价"以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。

(二)投资决策依据与交易机制

1、投资决策依据

有关法律法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策,以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整等决策。

3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合,构成了本基金的投资管理程序。

(1)研究。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台,整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果,开展标的指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告,定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会议,对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议,做出基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建。结合研究报告,基金经理主要采取抽样复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金抽样股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下,基金经理可采取适当的方法,提高投资效率,降低交易成本,控制投资风险。

(4)交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行,交易部同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估,并撰写相关的绩效评估报告,确认基金组合是否实现了投资预期,投资策略是否成功,并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略,如果需要,亦对投资组合进行相应的调整。

(6)组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况,结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申购赎回的现金流量情况,以及基金投资绩效评估结果等,对基金投资组合进行动态监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,根据环境的变化和基金实际投资的需要,有权对上述投资程序做出调整,并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

本基金认为,该业绩比较基准目前能够有效地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准。经与基金托管人协商一致,本基金变更业绩比较基准应报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒体上及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金是一只股票指数型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

十二、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据取自长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)2011年第2季度报告,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	197,511,123.37	90.91
	其中:股票	197,511,123.37	90.91
2	固定收益投资	709,965.60	0.33
	其中:债券	709,965.60	0.33
	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	18,326,491.26	8.43
6	其他资产	722,867.12	0.33
7	合计	217,270,447.35	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)指数投资部分

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	717,606.49	0.34
B	采掘业	24,108,785.28	11.46
C	制造业	70,169,059.26	33.36
C0	食品、饮料	11,014,347.47	5.24
C1	纺织、服装、皮毛	740,409.18	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,040,813.85	2.40
C5	电子	1,475,480.54	0.70
C6	金属、非金属	19,208,380.16	9.13
C7	机械、设备、仪表	24,855,477.97	11.82
C8	医药、生物制品	6,984,683.91	3.32
C99	其他制造业	849,466.18	0.40
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,858,393.43	2.31
E	建筑业	6,888,606.35	3.27
F	交通运输、仓储业	8,434,979.11	4.01
G	信息技术业	6,969,517.61	3.31
H	批发和零售贸易	6,334,815.81	3.01
I	金融、保险业	52,146,726.14	24.79
J	房地产业	10,163,990.84	4.83
K	社会服务业	1,634,571.33	0.78
L	传播与文化产业	241,767.94	0.11
M	综合类	4,842,303.78	2.30
	合计	197,511,123.37	93.89

(2)积极投资部分

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

3、报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	1,161,967	6,658,070.91	3.17
2	601318	中国平安	124,936	6,030,660.72	2.87
3	600000	浦发银行	502,607	4,945,652.88	2.35
4	601166	兴业银行	346,183	4,666,546.84	2.22
5	601328	交通银行	757,906	4,198,799.24	2.00
6	601088	中国神华	125,396	3,779,435.44	1.80
7	600030	中信证券	271,206	3,547,374.48	1.69
8	600519	贵州茅台	14,378	3,057,194.14	1.45
9	000002	万 科A	352,204	2,976,123.80	1.41
10	601398	工商银行	593,627	2,647,576.42	1.26

报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	709,965.60	0.34
8	其他	-	-
9	合计	709,965.60	0.34

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	110015	石化转债	6,200	668,670.00	0.32
2	110016	川投转债	360	41,295.60	0.02

注:本基金本报告期末仅持有上述两支债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	280,061.04
4	应收利息	4,463.65
5	应收申购款	188,342.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	722,867.12

(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处于转股期的可转换债券。

(5)期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十三、基金的业绩

项目	基金净值增长率(%)	同期业绩比较基准收益率(%)	超额收益率(%)
自基金成立(2010年8月4日)至2010年12月31日	5.70	8.79	-3.09
2011年1月1日至2011年6月30日	-2.23	-2.44	0.21
自基金成立(2010年8月4日)至2011年6月30日	3.34	6.14	-2.80

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。

十四、基金费用与税收

(一)基金费用的种类

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

(二)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E×0.75\%÷当年天数$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,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首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E×0.15\%÷当年天数$

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,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

上述(一)基金费用的种类中第3-8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)与基金销售有关的费用

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书"第九部分基金份额的场外申购、转换与赎回"和"第十部分 基金份额的场内申购与赎回"中的相关规定。不同基金间转换的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。基金申购、赎回费和基金转换费由基金投资者承担,不列入基金财产。

(四)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、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;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用以及其他费用。

(五)费用调整

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

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

(一)在"重要提示"中更新了有关招募说明书更新截止日期的描述。
(二)更新了"三、基金管理人"的相关信息。
(三)更新了"四、基金托管人"中的基本情况及相关业务经营情况。
(四)更新了"五、相关服务机构"中的相关内容。
(五)在"十二、基金的投资"中,更新了"(十一)基金投资组合报告"的相关内容。
(六)更新了"十三、基金的业绩"的相关内容。
(七)在"二十六、其他应披露的事项"中,更新了本次招募说明书更新期间所涉及的相关信息披露。

十六、签署日期

本招募说明书(更新)于2011年8月18日签署。

长盛基金管理有限公司
二○一一年九月六日

关于长盛货币市场基金"中秋节"假期前两个工作日暂停申购(转换转入、定期定额投资)业务的公告

公告送出日期:2011年9月6日

1 公告基本信息

基金名称		长盛货币市场基金
基金简称		长盛货币
基金主代码		080011
基金管理人名称		长盛基金管理有限公司
公告依据		《关于2011年部分节假日放假和休市安排有关问题的通知》
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2011年9月8日
	暂停大额申购起始日	-
	暂停转换转入起始日	2011年9月8日
	暂停大额转换转入起始日	-
	暂停赎回起始日	-
	暂停转换转出起始日	-
	暂停定期定额投资起始日	2011年9月8日
	限制申购金额(单位:人民币元)	-
	限制转换转入金额(单位:人民币元)	-
	暂停(大额)申购(转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资)的原因说明	为保护长盛货币市场基金现有基金份额持有人的利益,根据《长盛货币市场基金基金合同》、《长盛货币市场基金招募说明书》的有关规定。

注:根据国务院办公厅《关于2011年部分节假日安排的通知》(国办发明电[2010]40号)精神及沪深证券交易所休市安排,2011年9月10日(星期六)至2011年9月12日(星期一)休市3天,2011年9月13日(星期二)起照常开市。

2 其他需要提示的事项

1、为保证本基金的稳定运作,保护基金份额持有人利益,根据法律法规和基金合同的规定,本公司决定在"中秋节"假期前2个工作日(2011年9月8日、2011年9月9日)暂停接受本基金的申购业务(含定期定额申购业务)及转换转入业务。2011年9月13日起恢复办理本基金的申购业务及其他开放式基金转换转入本基金的业务,届时不再另行公告。

2、根据中国证监会《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字[2005]41号)第十款的规定"当日申购的基金份额自下一工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一工作日起不享有基金的分配权益",投资者于2011年9月7日申购或转换转入本基金自下一工作日(即2011年9月8日)起享有基金的分配权益;投资者于9月9日赎回或转换转出本基金的份额享有该日和整个假期期间的收益,将于下一工作日(即2011年9月13日)起不享受本基金的分配权益。

3、投资者如节假前或节假期间需要使用资金,请充分考虑资金到账所需时间并提前足够时间提出赎回申请。敬请投资人提前做好交易安排,避免因假期原因,带来不便。

4、投资者可通过以下途径咨询有关详情:

(1)、长盛基金管理有限公司网站:www.csfunds.com.cn
(2)、长盛基金管理有限公司客户服务热线:400-888-2666(免长途通话费用)

长盛基金管理有限公司
2011年9月6日