

# 长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金

## 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：兴业银行股份有限公司**

### **重要提示：**

本基金 2016 年 9 月 20 日经中国证券监督管理委员会证监许可（2016）2160 号文注册募集。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，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，和由于本基金股票资产投资占基金资产的比例为 0%-95% 的特定风险等。本基金将中小企业私募债纳入到投资范围中，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债券的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

投资有风险，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。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。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 2017 年 10 月 25 日。有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

**一、基金合同生效的日期：2016 年 10 月 25 日**

## **二、基金管理人**

（一）基金管理人基本情况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D

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：周兵

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 18900 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 2017 年 10 月 25 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金和六只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人董事会成员

周兵先生，董事长，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、总经理。现任长盛基金管理有限公司董事长，兼任长盛基金（香港）有限公司董事长。

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董事、总裁、党委副书记。现任国元证券股份有限公司董事长、党委书记，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、安徽安元投资基金有限公司董事长。

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。

陈健元先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括高盛(亚洲)有限责任公司、巴克莱银行。现任星展银行（香港）有限公司董事总经理兼北亚洲区私人银行业务主管。

钱力先生，董事，博士。曾任安徽省政府办公厅综合调研室干部、科员、副主任科员、秘书一室主任科员、副调研员、副主任（副处、正处级）；安徽省政府金融工作办公室综合处处长、副主任、党组成员；淮南市政府副市长、党组成员；现任安徽省信用担保集团党委书记、总经理。

陈翔先生，董事，博士。曾任安徽省六安行署办公室秘书、副科长、科长、副主任，安徽省政府办公厅综合调研室助理调研员、副主任、调研员，安徽省政府办公厅一处处长、助理巡视员兼秘书一室主任、副主任、党组成员，安徽省政

府副秘书长、安徽省政府办公厅党组成员，安徽省委统战部副部长、安徽省工商联党组书记、第一副主席、安徽省委非公有制经济和社会组织工作委员会副书记。现任安徽省投资集团控股有限公司董事长、党委书记。

林培富先生，董事，硕士，高级经济师。曾任安徽省信托投资公司国际业务部科长、副经理、投资银行总部副经理、经理，国元证券有限责任公司基金公司筹备组负责人。2005年1月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司人力资源部总监、总经理助理、副总经理，长盛创富资产管理有限公司执行董事。现任长盛基金管理有限公司总经理，兼任长盛基金（香港）有限公司董事、长盛创富资产管理有限公司董事长。

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，香港国际资本管理有限公司董事长。现任香港骏程投资有限公司负责人。

张仁良先生，独立董事，博士，公共政策讲座教授。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、香港浸会大学工商管理学院院长。现任香港教育大学校长、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。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、博士生导师、安徽大学经济与社会发展高等研究院执行院长、校学术委员会委员，安徽省政府决策咨询专家委员会委员，全国资本论研究会常务理事，全国马经史学会理事，安徽省经济学会副会长。

张良庆先生，独立董事，博士。曾任安徽省政府办公厅秘书室主任、副秘书长，安徽省农信联社理事长，安徽省财政厅研究所所长，安徽省第十一届、第十二届人大代表，安徽省人大财经工委副主任。

## 2、监事会成员

刘锦峰女士，监事会主席，工学及经济学双学士。曾任国元证券有限责任公司投资银行部副总经理、国元证券股份有限公司投资银行总部副总经理、业务三

部总经理兼资本市场部总经理、国元证券股份有限公司证券事务代表。现任国元证券股份有限公司董事会秘书、董事会办公室主任、机构管理部总经理，兼任国元股权投资有限公司董事。

吴达先生，监事，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，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，长盛创富资产管理有限公司总经理。现任长盛基金管理有限公司国际业务部总监，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，兼任长盛基金(香港)有限公司副总经理，长盛创富资产管理有限公司董事。

魏斯诺先生，监事，英国雷丁大学硕士。历任中国人寿资产管理有限公司投资组合经理、高级组合经理，合众资产管理有限公司组合管理部总经理。2013 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，现任社保业务管理部总监，社保组合组合经理。

### 3、管理层成员

周兵先生，董事长，经济学硕士。同上。

林培富先生，董事、总经理，硕士，高级经济师。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，特许另类投资分析师 CAIA。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，兼任长盛基金(香港)有限公司董事、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。

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、长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理、长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，社保组合组合经理。

蔡宾先生，中央财经大学硕士，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，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置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，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛同享保本混合型证券投资基金基金经理。

#### 4、本基金基金经理

王超先生，1981年9月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。自2011年12月6日起任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理，自2015年5月22日起兼任长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）基金经理，自2015年6月16日起兼任长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，自2015年6月18日起兼任长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，自2016年9月12日起兼任长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年12月22日起兼任长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年2月22日起兼任长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，自2017年5月18日起兼任长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，自2017年5月18日起兼任长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理，自2017年9月13日起兼任长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2017年10月9日起兼任长盛同

智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 10 月 23 日兼任长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 10 月 23 日兼任长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理。

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、长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。自 2016 年 7 月 13 日起兼任长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 16 日兼任长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 25 日兼任长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 11 月 10 日兼任长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 11 月 18 日兼任长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 1 月 13 日兼任长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 13 日兼任长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 16 日兼任长盛盛泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 16 日兼任长盛盛兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 23 日兼任长盛盛淳灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 24 日兼任长盛盛享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 2 月 27 日兼任长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 2 日兼任长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 3 日起兼任长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 20 日起兼任长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 20 日起兼任长盛盛乾灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 20 日起兼任长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 5 月 2 日起兼任长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

王宁先生，副总经理，EMBA。同上。

蔡宾先生，副总经理，中央财经大学硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

吴达先生，监事，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，特许金融分析师 CFA。同上。

魏斯诺先生，监事，英国雷丁大学硕士。同上。

乔林建先生,经济学硕士。历任新华人寿保险公司研究员、投资经理，新华资产管理公司高级投资经理，建信基金管理公司资深投资经理、基金经理助理、基金经理。2015年6月加入长盛基金管理有限公司，现任权益投资部执行总监，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理,长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

乔培涛先生，清华大学硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011年8月加入长盛基金管理有限公司，现任研究部副总监，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合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）基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福州市湖东路154号

办公地址：上海市江宁路168号

法定代表人：高建平

成立时间：1988年8月22日

注册资本：207.74亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字〔2005〕74号

托管部门联系人：刘峰

电话：021-52629999

传真：021-62159217

#### （二）发展概况及财务状况



兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2016 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 6.09 万亿元，实现营业收入 1570.60 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 538.50 亿元。

### （三）托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理及产品研发处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### （四）基金托管业务经营情况

兴业银行于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字〔2005〕74 号。截止 2017 年 6 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 183 只，托管基金财产规模 5741.64 亿元。

## 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：吕雪飞、张晓丽

#### 2、代销机构

##### （1）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 26 楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 26 楼

法定代表人：其实

联系人：丁姗姗

联系电话：010-65980380

传真：010-65980408

客服电话：400-1818-188

公司网站：<http://www.1234567.com.cn>

(2) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼  
B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户服务电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(3) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：4006199059

公司网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(二) 注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼10D

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：周兵

电话：(010) 82019988

传真：(010) 82255988

联系人：龚珉

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所

注册地址：上海市华阳路 112 号 2 号楼东虹桥法律服务园区 302 室

办公地址：上海市东方路 69 号裕景国际商务广场 A 座 15 层

负责人：颜学海

电话：(021) 58773177

传真：(021) 58773268

联系人：张兰

经办律师：张兰、周淑贞

(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）

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

执行事务合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办会计师：陈玲、张振波

联系人：张振波

## 五、基金的名称

本基金名称：长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金

## 六、基金的类型

基金类型：契约型开放式

## 七、基金的投资目标

通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市

场和债券市场的投资机会，在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。

## 八、基金的投资范围

本基金的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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、权证、股指期货、国债期货、债券回购、货币市场工具、同业存单、资产支持证券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）。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。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

## 九、基金的投资

### （一）大类资产配置

在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标，包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等；（3）市场指标，包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等；（4）政策因素，包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。

本基金将通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。

### （二）股票投资策略

在股票投资方面，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基

金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘股票内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑行业景气程度、企业竞争优势等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。

### 1、行业配置策略

本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。关注指标包括：

(1) 产业政策变化：分析与各个细分领域相关的扶持或压制政策，判断政策对行业前景的影响；

(2) 景气状况：判断各子领域的景气特征，选取阶段性景气度较高的细分领域重点配置；

(3) 相对盈利和估值水平：动态分析各细分领域的相对盈利和估值水平，提高阶段性被市场低估的、盈利预期较高子领域配置比例，降低阶段性被市场高估、盈利预期较低的子行业配置比例；

(4) 二级资产市场情况：根据二级资本市场情况，在市场处于趋势性下降通道态势时，提升偏向防御性的子行业配置；在市场景气度提升或出现明显反转、上升信号时，提升偏周期性的子行业配置。

### 2、个股配置策略

在行业配置的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选具备较大投资价值的上市公司。

(1) 定性分析：本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据，主要包括以下几个方面：

A、市场优势，包括上市公司的市场地位和市场份额；在细分市场是否占据领先地位；是否具有品牌号召力或较高的行业知名度；在营销渠道及营销网络方面的优势等；

B、资源和垄断优势，包括是否拥有独特优势的物资或非物质资源，比如市场资源、专利技术等；

C、产品优势，包括是否拥有独特的、难以模仿的产品；对产品的定价能力

等；

D、其他优势，例如是否受到中央或地方政府政策的扶持等因素。

本基金还对上市公司经营状况和公司治理情况进行定性分析，主要考察上市公司是否有明确、合理的发展战略；是否拥有较为清晰的经营策略和经营模式；是否具有合理的治理结构，管理团队是否团结高效、经验丰富，是否具有进取精神等。

## （2）定量分析

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的主要财务和估值指标进行定量分析。在对上市公司盈利增长前景进行分析时，本基金将充分利用上市公司的财务数据，通过上市公司的成长能力指标进行量化筛选，主要包括每股收益增长率、净资产增长率等。

在上述研究基础上，本基金将通过定量与定性相结合的评估方法，对上市公司的增长前景进行分析，力争所选择的企业具备长期竞争优势。

## 3、动态调整和组合优化策略

本基金管理将根据经济发展状况、产业结构升级、技术发展状况及国家相关政策因素对配置的行业和上市公司进行动态调整。此外，基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对投资组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。

## （三）债券投资策略

### 1、普通债券投资策略

本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

### 2、中小企业私募债投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管

理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。

#### （四）股指期货投资策略

本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。

#### （五）国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### （六）权证投资策略

本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

#### （七）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用

研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准：

50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率

## 十一、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

## 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。

本基金托管人兴业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截至 2017 年 9 月 30 日，本报告财务资料未经会计师事务所审计。

### 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	33,317,318.68	8.63
	其中：股票	33,317,318.68	8.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	345,633,000.00	89.53
	其中：债券	345,633,000.00	89.53
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	500,000.00	0.13
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-



7	银行存款和结算备付金合计	2,219,899.74	0.57
8	其他资产	4,401,640.85	1.14
9	合计	386,071,859.27	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,984,995.60	0.77
C	制造业	4,898,576.00	1.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,976,586.00	1.03
E	建筑业	1,978,546.31	0.51
F	批发和零售业	1,979,152.58	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	4,044,201.00	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,304,075.00	0.34
J	金融业	9,499,178.70	2.46
K	房地产业	2,652,007.49	0.69
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	33,317,318.68	8.64

### (2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 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

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	601088	中国神华	46,200	967,428.00	0.25
2	600522	中天科技	58,800	840,252.00	0.22
3	600795	国电电力	237,200	787,504.00	0.20
4	601872	招商轮船	152,400	754,380.00	0.20
5	601877	正泰电器	35,100	750,789.00	0.19
6	601398	工商银行	121,000	726,000.00	0.19
7	600166	福田汽车	226,700	702,770.00	0.18
8	601288	农业银行	183,200	699,824.00	0.18
9	601939	建设银行	99,600	694,212.00	0.18
10	600048	保利地产	66,100	687,440.00	0.18

#### 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	19,842,000.00	5.15
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（可交换债）	-	-
8	同业存单	325,791,000.00	84.48
9	其他	-	-
10	合计	345,633,000.00	89.63

#### 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	111716179	17 上海银行 CD179	600,000	59,334,000.00	15.39
2	111705081	17 建设银行 CD081	500,000	49,460,000.00	12.83
3	111711369	17 平安银行 CD369	500,000	49,445,000.00	12.82
4	111720183	17 广发银行 CD183	500,000	49,445,000.00	12.82
5	111710431	17 兴业银行 CD431	400,000	39,556,000.00	10.26
6	179932	17 贴现国债 32	200,000	19,842,000.00	5.15

6、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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、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	16,962.74
2	应收证券清算款	2,003,783.56
3	应收股利	-
4	应收利息	2,380,894.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	4,401,640.85

(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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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。

### 十三、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

#### 长盛盛平混合 A

阶段	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
2016年10月25日(基金 合同生效日)至2016年 12月31日	0.25%	-1.81%	2.06%
2017年1月1日至2017 年9月30日	5.27%	8.15%	-2.88%
2016年10月25日(基金 合同生效日)至2017年9 月30日	5.53%	6.19%	-0.66%

#### 长盛盛平混合 C

阶段	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
2016年10月25日(基金 合同生效日)至2016年 12月31日	0.21%	-1.81%	2.02%
2017年1月1日至2017 年9月30日	5.12%	8.15%	-3.03%

2016年10月25日(基金合同生效日)至2017年9月30日	5.34%	6.19%	-0.85%
---------------------------------	-------	-------	--------

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作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、基金销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易或结算费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，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0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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5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、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

## 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：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

## 3、C 类份额的基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。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。销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第 4—10 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、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；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 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》、《公开募集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截至日期的描述。
- （二）更新了“第三部分、基金管理人”中的相关信息。
- （三）更新了“第四部分、基金托管人”中的相关信息。
- （四）更新了“第五部分、相关服务机构”中的相关信息。
- （五）更新了“第九部分、基金的投资”中的相关内容。
- （六）更新了“第十部分、基金的业绩”中的相关内容。
- （七）更新了“第二十二部分、其他应披露事项”中的相关内容。

#### 十六、签署日期

本招募说明书（更新）于2017年12月1日签署。

长盛基金管理有限公司

2017年12月9日