

长信恒利优势股票型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2011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：中国建设银行股份有限公司

长信恒利优势股票型证券投资基金经2009年5月27日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】439号文核准募集。本基金的基金合同于2009年7月30日正式生效。本基金为股票型契约开放式基金。

重要提示

长信基金管理有限责任公司(以下简称“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。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

投资有风险,本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人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,包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券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,由于基金投资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基金管理风险等。

投资有风险，投资者申购基金时请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

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。因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原始投资。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为 2011 年 1 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2010 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国建设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 | | |
| 成立日期 | 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成员情况

| 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，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司董事长，兼长江证券股份有限公司第六届监事会召集人。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。 |
| 胡运钊 | 董事 | 男 | 中共党员，在职研究生学历，高级经济师。现任长江证券股份有限公司董事长、党委书记。曾任湖北省经委工业处副处长、处长，黄石市人民政府副市长，中共黄石市委常委、常务副市长，湖北省人民政府副秘书长，省政府副秘书长兼办公厅主任、办公厅党组副书记，长江证券有限责任公司党委书记。 |
| 王岑 | 董事 | 男 | 中共党员，硕士，高级工程师。曾任武汉钢铁（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 | 硕士研究生学历，现任长江证券股份有限公司合规总监，长江期货有限公司监事会主席。曾担任长江证券股份有限公司投资银行部业务主管，法律事务部经理，债权债务中心总经理，资产保全事业部总经理，办公室总经理，副总裁。 |
| 徐文彬 | 董事 | 男 | 中共党员，本科学历。曾任步兵 273 团政治处主任，步兵 271 团政委，上海松江区建委书记，松江区小昆山镇和洞泾镇党委书记，上海海欣集团股份有限公司监事会主席、副总裁、总裁。现任上海海欣集团股份有限公司董事长、党委书记。 |
| 陈谋亮 | 董事 | 男 | 中共党员，博士，高级经济师，高级商务谈判师。曾任湖北经济学院讲师；扬子石化化工厂、总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部，集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表；上海交大南洋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、总裁助理、战略投资管理部常务副总监、总监。现任上海海欣集团股份有限 |

| | | | |
|-------------------|------|---|---|
| | | | 公司常务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。曾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 | 中共党员，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 | 硕士研究生学历，现任长江证券股份有限公司财务负责人兼财务总部主管。曾担任长江证券股份有限公司财务总部经理、总经理助理、副总经理、 |

| | | | |
|--------------------------|----|---|--|
| | | | 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。 |
| 李毅 | 监事 | 女 | 中共党员，硕士。曾任长信基金管理有限责任公司综合管理部副总监。现任长信基金管理有限责任公司零售服务部（筹）负责人。 |
| 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副总监。 |
| 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 | 经济学硕士，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。 |
| 付勇 | 副总经理 | 男 | 金融学博士，北京大学金融学专业博士研究生毕业，具有基金从业资格。曾任中国建设银行个人金融业务部主任科员、华龙证券投资银行北京总部副总经理、东北证券北京总部总经理助理、东方基金副总经理。2006 年 1 月至 2010 年 2 月任东方基金公司东方精选混合型证券投资基金的基金经理，2008 年 6 月至 2010 年 2 月任东方基金公司东方策略成长股票型证券投资基金的基金经理。2010 年 3 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，兼任长信金利趋势证券投资基金的基金经理。 |
| 覃波 | 副总经理 | 男 | 硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。曾在长江证券公司从事资产管理和债券承销发行工作。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划 |

| | | | |
|-------------------|--|--|--|
| | | | 部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理，现任长信基金管理有限责任公司副总经理。 |
| 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 |
| 李枝蓬 | 基金经理 | 2009/7/30-至今 | 应用化学博士，具有基金从业资格。曾就职于湘财证券有限责任公司研究发展中心，从事石油及化工行业研究和相关板块上市公司研究。2006年7月加入本公司，任高级研究员，负责化工行业研究工作，现任本基金基金经理。 |
| 曾芒 | 基金经理 | 2009/7/30-2010/8/26 | 经济学博士，具有基金从业资格。曾就职于上海海通证券武汉营业部、上海智盛企业管理咨询公司、南京智昊投资管理公司、武汉华正投资顾问公司，先后从事证券自营、证券投资管理和研究等工作。2005年7月加入本公司，曾任本公司投资管理部总监、长信增利基金基金经理和本基金基金经理。 |

5、投资决策委员会成员

| 姓名 | 职务 |
|-------------------|--|
| 蒋学杰 | 总经理 |
| 付勇 | 副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利基金的基金经理 |
| 叶琦 | 总经理助理、金融工程部总监、国际业务部总监 |
| 胡志宝 | 公司投资总监、投资决策委员会执行委员、长信银利基金的基金经理、长信增利基金的基金经理 |
| 钱斌 | 研究发展部总监、长信双利基金的基金经理 |
| 李洪书 | 交易管理部副总监 |
| 李小羽 | 固定收益部总监、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券基金的基金经理、长信中短债基金的基金经理 |
| 张大军 | 专户理财部总监、投资决策委员会执行委员 |
| 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 | | | |
|--|---|-----------|-----------|
| <p>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。</p> | | | |
| 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 | | |
| 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、产品开发部 | | |
| 分支机构 | 北京分公司、武汉办事处 | | |
| 员工总数 | 105 人（截至 2011 年 1 月 30 日） | | |
| 员工学历构成 | 学历 | 人数 | 占比 |
| | 博士 | 4 人 | 4% |
| | 硕士 | 53 人 | 50% |
| | 本科 | 42 人 | 40% |
| | 专科 | 4 人 | 4% |
| | 其它 | 2 人 | 2% |
| | 总计 | 105 人 | 100% |

二、基金托管人

（一）、基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

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

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:233,689,084,000股(包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股)。

截至2010年9月30日，中国建设银行实现净利润1106.41亿元，较上年同期增长31.47%。手续费及佣金净收入486.81亿元，较上年同期增长36.12%。年化平均资产回报率为1.46%，年化加权平均净资产收益率为24.87%；净利息收益率为2.45%。信贷资产质量继续稳定向好，不良贷款较上年末实现“双降”，拨备覆盖率大幅提高至213.48%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约及胡志明市设有分行，在悉尼设有代表处，设立了安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行4家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)37,487台，拥有员工约30万人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年上半年共获得50多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第2位，为中资银行之首；在美国《福布斯》杂志公布的“2010中国品牌价值50强”列第3位；荣获英国《金融时报》颁发的“中国最佳渠道银行”；被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉

外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室，现有员工 130 余人。2008 年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会 (AICPA) 颁布的审计准则公告第 70 号 (SAS70) 进行的内部控制审计，安永会计师事务所为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的 SAS70 国际专项认证的托管银行。

2、主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2010 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 178 只证券投资基金，其中封闭式基金 6 只，开放式基金 172 只。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010 年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

| | |
|-------------------------------|------------------------|
| 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 |
| 客户服务电话：400-700-5566 | 公司网站：www.cxfund.com.cn |
| 2、场外代销机构 | |
| (1) 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 | |
| 办公地址：北京市西城区金融大街 3 号金鼎大厦 6 层 | |
| 法定代表人：刘安东 | 传真：010-68858116 |
| 客户服务电话：95580 | 网址：www.psbc.com |
| (2) 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：滕涛 |
| 电话：010-85108229 | 传真：010-85109219 |
| 客户服务电话：95599 | 网址：www.abchina.com |
| (3) 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 | |
| 办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号 | |
| 法定代表人：姜建清 | |
| 客户服务电话：95588 | 网址：www.icbc.com.cn |
| (4) 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 |
| (5) 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 | |
| 客户服务电话：95533 | 联系人：张静 |
| 传真：010-66275654 | 网址：www.ccb.com |
| (6) 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 |
| | |
| (7) 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：傅育宁 | 联系人：邓炯鹏 |
| 电话：0755-83198888 | 传真：0755-83195109 |
| 客户服务电话：95555 | 网址：www.cmbchina.com |
| | |
| (8) 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 |
| | |
| (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 | |
| 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 |
| | |
| (10) 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 | |
| 电话：010-65557083 | 联系人：丰靖 |
| 客户服务电话：95558 | 公司网址：bank.ecitic.com |
| | |
| (11) 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 号华夏银行大厦 | |
| 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦 | |
| 法定代表人：吴建 | 联系人：郑鹏 |
| 电话：010-85238667 | 传真：010-85238419 |
| 客户服务电话：010-95577 | 公司网址：www.hxb.com.cn |
| | |
| (12) 汉口银行股份有限公司 | |

| | |
|--|-----------------------|
| 注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦 | |
| 办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号 | |
| 法定代表人：陈新民 | 联系人：骆芸 |
| 电话：027-82656224 | 传真：027-82656236 |
| 客户服务电话：(027) 96558, 4006096558 | 公司网址：www.hkbchina.com |
| | |
| (13) 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 |
| | |
| (14) 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 |
| | |
| (15) 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：95579 或 4008-888-999 | 网址：www.95579.com |
| | |
| (16) 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 |
| | |
| (17) 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 |
| | |
| (18) 第一创业证券有限责任公司 | |

| | |
|---------------------------------------|----------------------------|
| 注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 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、26 层 | |
| 法定代表人：刘学民 | 联系人：魏颖 |
| 电话：0755-25832852 | 传真：0755-82485081 |
| 客户服务电话：400-888-1888 | 网址：www.firstcapital.com.cn |
| (19) 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 |
| (20) 东莞证券有限责任公司 | |
| 注册地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 | |
| 办公地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 | |
| 法定代表人：张运勇 | 联系人：梁健伟、张巧玲 |
| 电话：0769-22100159 | 传真：0769-22119423 |
| 客户服务电话：0769-961130 | 网址：www.dgzq.com.cn |
| (21) 东吴证券股份有限公司 | |
| 注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 | |
| 办公地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 | |
| 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 |
| (22) 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 |
| (23) 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 至 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 |
| (24) 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：黄岚 |
| 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 |
| | |
| (25) 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：常喆 | 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 |
| | |
| (26) 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 |
| | |
| (27) 国联证券股份有限公司 | |
| 注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号 | |
| 办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6-8 楼 | |
| 法定代表人：雷建辉 | 联系人：徐欣 |
| 电话：0510-82831662 | 传真：0510-82830162 |
| 客户服务电话：4008885288 | 网址：www.glsc.com.cn |
| | |
| (28) 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：上海市浦东新区银城中路 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：021-38676666 | 传真：021-38670666 |
| 客户服务热线：4008888666 | 网址：www.gtja.com |
| | |
| (29) 国信证券股份有限公司 | |
| 注册地址：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 | |
| 办公地址：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 | 联系人：齐晓燕 |
| 电话：0755-82130833 | 传真：0755-82133952 |
| 客户服务电话：95536 | 网址：www.guosen.com |
| | |
| (30) 国元证券股份有限公司 | |

| | |
|--------------------------------------|----------------------|
| 注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号 | |
| 办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号 | |
| 法定代表人：凤良志 | 联系人：李蔡 |
| 电话：05551-2615542 | 传真：0551-2634906 |
| 客户服务电话：955784008-888-777 | 网址：www.gyzq.com.cn |
| | |
| (31) 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 |
| | |
| (32) 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 |
| | |
| (33) 华安证券有限责任公司 | |
| 注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号 | |
| 办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24-32 层 | |
| 法定代表人：李工 | 联系人：甘霖 |
| 电话：0551-5161666 | 传真：0551-5161600 |
| 客户服务电话：96518、400-80-96518 | 网址：www.hazq.com |
| | |
| (34) 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 27 层 | |
| 办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层 | |
| 法定代表人：陈林 | 联系人：陈康菲 |
| 电话：021-50122222 | 传真：021-50122218 |
| 客户服务电话：400-820-9898 | 网址：www.cnhbstock.com |
| | |
| (35) 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 |
| | |
| (36) 华泰联合证券有限责任公司 | |

| | |
|--|---------------------|
| 注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 | |
| 办公地址：深圳市福田区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 | 联系人：盛宗凌、庞晓芸 |
| 电话：0755-82492000 | 传真：0755-82492962 |
| 客户服务电话：95513 | 网址：www.lhzq.com |
| (37) 华泰证券股份有限公司 | |
| 注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 | |
| 办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 | |
| 法定代表人：吴万善 | 联系人：樊昊 |
| 电话：0086-25-84457777 | 传真：0086-25-84579763 |
| 客户服务电话：95597 | 网址：www.htsc.com.cn |
| (38) 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：张宇宏 |
| 电话：0451-82336863 | 传真：0451-82287211 |
| 客户服务电话：400-666-2288 | 网址：www.jhzq.com.cn |
| (39) 中航证券有限公司 | |
| 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：杜航 | 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.avicsec.com |
| (40) 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 |
| (41) 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 |

| | |
|-------------------------------------|--------------------|
| (42) 申银万国证券股份有限公司 | |
| 注册地址：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 | 联系人：邓寒冰 |
| 电话：021-54033888 | 传真：021-54035333 |
| 客户服务电话：021-962505 | 网址：www.sywg.com.cn |
| (43) 天风证券有限责任公司 | |
| 注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼 | |
| 办公地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼 | |
| 法定代表人：余磊 | 联系人：翟璟 |
| 电话：027-87618882 | 传真：027-87618863 |
| 客服电话：028-86711410 | 网址：www.tfzq.com |
| (44) 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：潘鸿 |
| 电话：010-66045446 | 传真：010-66045500 |
| 客户服务电话：010-66045678 | 网址：www.txsec.com |
| (45) 天源证券经纪有限公司 | |
| 注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼 | |
| 办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼 | |
| 法定代表人：裴东平 | 联系人：关键 |
| 电话：0755-33331188-8101 | 传真：0755-33329815 |
| 客户服务电话：400-65432-18 | 网址：www.tyzq.com.cn |
| (46) 西藏同信证券有限责任公司 | |
| 注册地址：拉萨市北京中路 101 号 | |
| 办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号 | |
| 法定代表人：贾绍君 | 联系人：王伟光 |
| 电话：021-36533016 | 传真：021-36533017 |
| 客户服务电话：400-8811-177 | 网址：www.xzsec.com |
| (47) 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 |

| | |
|---|---------------------------|
| (48) 兴业证券股份有限公司 | |
| 注册地址: 福州市湖东路 268 号 | |
| 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 |
| (49) 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 |
| (50) 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 |
| (51) 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 |
| (52) 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: 北京市朝阳区门内大街 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 |
| (53) 中信金通证券有限责任公司 | |
| 注册地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层 | |
| 办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 4、19、20 层 | |
| 法定代表人: 刘军 | 联系人: 俞会亮 |
| 电话: 0571-85776115 | 传真: 0571-85783771 |
| 客户服务电话: 96598 | 网址: www.bigsun.com.cn |

3、场内销售机构

场内代销机构是指有资格的上交所会员，名单详见上海证券交易所网站：

http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjzt.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，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

长信恒利优势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

把握经济及产业发展趋势和市场运行特征，充分利用产业升级和产业机构调整的机会，挖掘在经济发展以及市场运行不同阶段中优势产业内所蕴含的投资机会，重点投向受益于产业增长和兼具优质品质的个股，力争获取基金资产的长期稳定增值。

七、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，包括国内依法发行的股票、债券、权证、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。

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

本基金投资于股票资产的比例范围是基金资产的 60%-95%，投资于现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围是基金资产的 5%-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金投资优势产业的资产不低于股票资产的 80%。投资于权证、资产支持证券或其它衍生金融工具的比例遵守法律法规或中国证监会的有关规定。

八、基金的投资策略

本基金实行风险管理下的主动投资策略，即采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，自上而下是以战略的角度强调资产配置和组合管理，自下而上是以战术的角度强调精选个股。

具体而言，在资产配置和组合管理方面，利用组合管理技术和金融工程相结合的方法，严格控制及监测组合的风险和保持组合流动性。在股票组合方面，自上而下通过深入研究宏观经济环境、市场环境、产业特征等因素，优选增长前景良好和增长动力充分，具备价值增值优势的产业作为重点投资对象，并结合自下而上的对上市公司的深入分析，投资于精选出来的个股，为投资者获取优势产业增长所能带来的最佳投资收益；

根据本基金对优势产业特征的定义和分析，现阶段本基金重点关注的优势产业为具备以下特征的行业：

- (1) 在全球拥有竞争优势的产业；
- (2) 在经济全球化趋势下具有资源优势的产业；
- (3) 在中国经济增长环境下呈现出具有持续竞争优势，良好成长性和持续盈利增长潜力的产业；这类产业细分为以下三个板块：

A、内需增长背景下具有竞争优势的产业

B、国家政策导向和大力扶持的优势产业

C、产业结构变化带来价值增值的优势产业

本基金将捕捉各个产业中各行业发展的不同态势，从而选取优势产业方向中细分的行业进行投资，并且随其变化适时调整，以更好把握经济变化的趋势。

未来，全球产业结构会随着各国社会和经济的发展而变化，中国经济增长也将发生适应自身需求的转变，本基金管理人将根据产业变化的前瞻性的研究和判断，对投资方向作出适合本国经济增长变化的调整。

个股分析是本基金股票投资策略中“自下而上”投资策略的体现，在有效控制风险的前提下，为投资者实现尽可能高的投资回报。在个股分析中采用本公司特有的品质分析模型，结合风险收益特征分析和估值分析来确定股票的投资价值。在优势产业确定的基础上，本基金对个股的投资可以在不同风格类型、不同市值大小和不同行业板块之间进行灵活选择。

九、基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准为上证国债指数，本基金的业绩比较基准为复合指数：

$$\text{沪深 300 指数} * 70\% + \text{上证国债指数} * 30\%$$

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，并在报送有关监管机构后予以公布。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型证券投资基金，属于证券投资基金中较高预期风险和预期收益的证券投资基金产品，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 2 月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 12 月 31 日(摘自本基金 2010 年四季报), 本报告中所列财务数据未经审计。

(一) 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 | 285,595,331.47 | 82.47 |
| | 其中: 股票 | 285,595,331.47 | 82.47 |
| 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 | 60,401,483.31 | 17.44 |
| 6 | 其他资产 | 323,718.39 | 0.09 |
| 7 | 合计 | 346,320,533.17 | 100.00 |

(二) 报告期末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 | 6,587,243.13 | 1.91 |
| B | 采掘业 | 32,057,000.00 | 9.32 |
| C | 制造业 | 115,343,847.36 | 33.52 |
| C0 | 食品、饮料 | 13,241,591.10 | 3.85 |
| 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 | 14,631,000.00 | 4.25 |
| C5 | 电子 | — | — |
| C6 | 金属、非金属 | 26,150,000.00 | 7.60 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 55,341,997.78 | 16.08 |
| C8 | 医药、生物制品 | 5,979,258.48 | 1.74 |
| 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 | 31,896,551.50 | 9.27 |
| G | 信息技术业 | 50,784,105.48 | 14.76 |
| H | 批发和零售贸易 | 3,199,584.00 | 0.93 |
| I | 金融、保险业 | 37,302,000.00 | 10.84 |
| J | 房地产业 | 8,425,000.00 | 2.45 |
| K | 社会服务业 | — | — |

| | | | |
|---|---------|----------------|-------|
| L | 传播与文化产业 | — | — |
| M | 综合类 | — | — |
| | 合计 | 285,595,331.47 | 82.99 |

(三) 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 | 600416 | 湘电股份 | 780,000 | 23,197,200.00 | 6.74 |
| 2 | 002320 | 海峡股份 | 585,000 | 22,932,000.00 | 6.66 |
| 3 | 600498 | 烽火通信 | 528,700 | 21,867,032.00 | 6.35 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 700,000 | 16,030,000.00 | 4.66 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 200,000 | 11,232,000.00 | 3.26 |
| 6 | 600844 | 丹化科技 | 700,000 | 10,619,000.00 | 3.09 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 2,000,000 | 10,040,000.00 | 2.92 |
| 8 | 600376 | 首开股份 | 500,000 | 8,425,000.00 | 2.45 |
| 9 | 600481 | 双良节能 | 500,000 | 8,300,000.00 | 2.41 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 299,950 | 8,188,635.00 | 2.38 |

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(五) 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

本基金本报告期末未持有债券。

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 13,492.44 |
| 5 | 应收申购款 | 60,225.95 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 323,718.39 |

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、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、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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。

2010年及历史各时间段基金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 |
|---------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2009年7月30日 (合同生效日) -2009年12月31日 | -2.20% | 1.56% | 1.30% | 1.54% | -3.50% | 0.02% |

| | | | | | | |
|--------------------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 2010年1月1日 -2010年12月31日 | -6.75% | 1.38% | -7.46% | 1.11% | 0.71% | 0.27% |
| 自基金合同生效日起至今(2009年07月30日-2010年12月31日) | -8.80% | 1.43% | -6.26% | 1.25% | -2.54% | 0.18% |

自合同生效之日（2009年7月30日）至2010年12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、本基金基金合同生效日为2009年7月30日，图示日期为2009年7月30日至2010年12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：投资于股票资产的比例范围是基金资产的60%-95%，投资于现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围是基金资产的5%-40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资优势产业的资产不低于股票资产的80%。

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关费用

1、与基金运作有关费用包括：

(1) 基金管理人的管理费；

- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (4) 基金合同生效后的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费；
- (9) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

基金合同终止、本基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提：

| 基金 | 管理费率 (G%) |
|----------|-----------|
| 长信恒利优势基金 | 1.5% |

计算方法如下：

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

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、公休假等，支付日期顺延。

(2) 基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提：

| 基金 | 托管费率 (T%) |
|----------|-----------|
| 长信恒利优势基金 | 0.25% |

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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、公休假等，支付日期顺延。

(3) 上述“1、与基金运作有关费用列示”中(3)－(9)项费用由基金托管人根据有关法律法规及相应协议规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

3、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费用支出或基金财产的损失，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。

基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

4、基金管理费和托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费用与计算公式

投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

1) 投资人选择前端申购费用时，按申购金额采用比例费率。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

表：基金前端申购费率表

| 申购金额 (M, 含申购费) | 前端申购费率 |
|----------------|--------|
| M < 100 万 | 1.5% |

| | |
|-------------------|----------|
| 100 万 ≤ M < 500 万 | 1.0% |
| 500 万 ≤ M | 1000 元每笔 |

注：M 为申购金额

前端收费模式计算公式为：

申购费用 = 申购金额 - 申购金额 / (1 + 申购费率)

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 ÷ T 日基金份额净值

2) 投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率随持有时间的增加而递减，具体费率如下：

表：基金后端申购费率表

| 持有年限 (N) | 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% |
| 5 年 ≤ N | 0 |

注：N 为持有年限

后端收费模式计算公式为：

申购份额 = 申购金额 / T 日基金份额净值

3) 投资人选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

2、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，赎回费率随持有时间的增加而递减，具体费率如下：

表：基金赎回费率表

| 持有时间 (N, 年) | 赎回费率 |
|-------------|------|
| N < 1 年 | 0.5% |

| | |
|------------------|------|
| 1 年 \leq N<2 年 | 0.2% |
| 2 年 \leq N | 0 |

注：N 为持有年限

1) 如果投资人在申购时选择交纳前端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

2) 如果投资人在申购时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日基金份额净值}$$

后端申购费用 = 赎回份额 \times 申购日基金份额净值（基金份额面值） \times 后端申购费率

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{后端申购费用} - \text{赎回费用}$$

3、转换费用与计算方式

本公司已开通了长信恒利优势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、长信增利动态股票基金、长信双利优选混合基金、长信利丰债券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互转，前后端收费基金不得互转。

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：

1) 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)

2) 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)

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, 并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动, 对本基金管理人于 2009 年 6 月 26 日刊登的本基金原招募说明书(《长信恒利优势股票型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、更新了“重要提示”部分“更新内容截止时间、财务数据与净值表现截止日”的相应内容。

2、更新了“三、基金管理人”的“基本情况、主要人员情况和内部组织结构及员工情况”部分的相应内容。

3、根据托管行提供的资料, 更新了“四、基金托管人”的“基金托管人的基本情况”、“主要人员情况”和“基金托管业务经营情况”部分的相应内容。

4、更新了“五、相关服务机构”部分的相应内容, 增加和更新了代销机构的基本资料。

- 5、更新了“八、基金的份额的申购与赎回”部分关于基金转换的内容。
- 6、增加了“十、基金的投资组合报告”部分的相应内容。
- 7、增加了“十一、基金的业绩”部分相应内容，并经托管银行复核。
- 8、更新并完善了“二十二、对基金份额持有人的服务”部分相应的服务。
- 9、增加了“二十三、其它应披露的事项”部分的相应内容，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

二〇一一年三月十六日