# 长城中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书

长城中小盘成长股票型证券投资基金经2010年11月29日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1721号文批准发起设立。

**重要提示**

(一)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。

(二)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。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,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,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,本基金的特定风险等。

(三)基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

(四)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资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

**基金管理人:长城基金管理有限公司**
**基金托管人:中国银行股份有限公司**
**二〇一〇年十二月**

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作管理办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称"《销售管理办法》")等有关法律法规及《长城中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")编写。

本招募说明书阐述了长城中小盘成长股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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《基金法》、基金合同及其他规定享有权利、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。

## 二、释义

本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

| | |
|---|---|
| 基金或本基金: | 指长城中小盘成长股票型证券投资基金; |
| 基金合同或本基金合同: | 指《长城中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充; |
| 招募说明书: | 指《长城中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》及其定期更新; |
| 发售公告: | 指《长城中小盘成长股票型证券投资基金基金份额发售公告》 |
| 托管协议 | 指《长城中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充; |
| 中国证监会: | 指中国证券监督管理委员会; |
| 中国银监会: | 指中国银行业监督管理委员会; |
| 《基金法》: | 指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订; |
| 《销售办法》: | 指2004年6月25日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订; |
| 《运作办法》: | 指2004年6月29日由中国证监会公布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订; |
| 《信息披露办法》: | 指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订; |
| 元: | 指人民币元; |
| 基金管理人: | 指长城基金管理有限公司; |
| 基金托管人: | 指中国银行股份有限公司; |
| 注册登记业务: | 指本基金登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等; |
| 注册登记机构: | 指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为长城基金管理有限公司或接受长城基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构; |
| 投资者: | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者; |
| 个人投资者: | 指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人; |
| 机构投资者: | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织; |
| 合格境外机构投资者: | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者; |
| 基金份额持有人大会: | 指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议; |
| 基金募集期: | 指基金合同和招募说明书中载明,并经中国证监会核准的基金份额募集期限,自基金份额发售之日起最长不超过3个月; |
| 基金合同生效日: | 指募集结束,基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的,基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后,中国证监会的书面确认之日; |
| 存续期: | 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限; |
| 工作日: | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日; |
| 认购: | 指在基金募集期内,投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为; |
| 申购: | 指在本基金合同生效后的存续期间,投资者申请购买本基金基金份额的行为; |
| 赎回: | 指在本基金合同生效后的存续期间,基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为; |
| 基金转换: | 指基金份额持有人按基金管理人规定的条件,申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为; |
| 转托管: | 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为; |
| 指令: | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时,向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令; |
| 代销机构: | 指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托,代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构; |
| 销售机构: | 指基金管理人及本基金代销机构; |
| 基金销售网点: | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点; |
| 指定媒体: | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站; |
| 基金账户: | 指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户; |
| 交易账户: | 指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户; |
| 开放日: | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日; |
| T日: | 指投资者向销售机构提出申购、赎回或其他业务申请的交易日; |
| T+n日: | 指T日后(不包括T日)第n个工作日,n指自然数; |
| 基金收益: | 指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入; |
| 基金资产总值: | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项以及以其他资产等形式存在的基金资产的价值总和; |
| 基金资产净值: | 指基金资产总值减去基金负债后的价值; |
| 基金份额净值 | 指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值; |
| 基金资产估值: | 指计算、评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程; |
| 法律法规: | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充; |
| 不可抗力: | 指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。 |

## 三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1、名称:长城基金管理有限公司

2、住所:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

3、办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

4、法定代表人:杨光裕

5、组织形式:有限责任公司

6、设立日期:2001年12月27日

7、电话:0755-23982338 传真:0755-23982328

8、联系人:袁柳生

9、管理基金情况:目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金十一只基金

10、客户服务电话:400-8868-666

11、注册资本:壹亿伍仟万元

12、股权结构:

| 持股单位 | 占总股本比例 |
|---|---|
| 长城证券有限责任公司 | 47.059% |
| 东方证券股份有限公司 | 17.647% |
| 中原信托有限公司 | 17.647% |
| 北方国际信托股份有限公司 | 17.647% |
| 合计 | 100% |

(二)基金管理人主要人员情况

1、董事、监事及高管人员介绍

①董事

杨光裕先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任,长城证券有限责任公司副总裁,现任长城基金管理有限公司董事长。

叶烨先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任交通部秦皇岛港务局计划处科员,君安证券有限责任公司投资银行部高级经理、石家庄营业部总经理、公司副总裁,国泰君安证券股份有限公司北京分公司常务副总经理、武汉分公司总经理、资产委托管理总部总监,长信基金管理有限责任公司总经理。现任长城证券有限责任公司总经理、党委副书记。

张志红女士,中共党员,复旦大学经济学博士。曾任上海金融高等专科学校教师,上海市证管办科员、副主任科员、主任科员,上海证监局机构监管处副处长、处长,上海证监局上市公司监管一处处长,现任长城证券有限责任公司首席合规官。

梁宇峰先生,中共党员,复旦大学经济学博士。历任东方证券股份有限公司研究发展总部经理助理、办公室主任助理、研究所副所长,2006年4月至今任东方证券股份有限公司研究所所长。

姬宏俊先生,中共党员,大学本科学历。历任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长,发展计划委员会财政金融处副处长,国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。现任中原信托有限公司副总经理。

陆妍女士,1991年毕业于天津理工学院管理信息系统专业,获工学学士学位,1997年毕业于天津大学管理学院,获工学硕士学位。曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券投资部项目经理、北方国际信托股份有限公司证券管理总部总经理,现任北方国际信托股份有限公司副总经理。

任俊杰先生,大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融机构同业协会首任秘书长、赛格投资有限公司(香港注册)董事总经理、祥安证券有限公司(香港联交所会员)董事、中国投资环境协会副理事长、深圳怀新企业投资顾问有限公司副总经理,现任深圳施得普汇投资顾问有限公司董事长。

万建华先生,中共党员,工商管理博士,高级经济师。历任中国人民银行货币政策司处长、招商银行总行副行长、党委副书记、常务副行长、中国银联筹备组组长、党委书记、副董事长、总裁,现任上海国际集团党委副书记、副董事长、总裁。

谢志华先生,中共党员,经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商业学校教师、北京商学院(现北京工商大学)副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘杉先生,经济学博士。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报财经新闻部主任,中国人民银行深圳分行金融早报社总编辑,中华工商时报社总编辑助理,现任中华工商时报社副总编辑,兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

关林戈先生,中共党员,经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任,中共天津市委领导同志秘书,南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理,长城证券有限责任公司总裁助理,长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理,现任长城基金管理有限公司总经理。

②监事

罗世容女士,工商管理硕士,会计师。历任四川省《经工厅》盐业学校财经教研室副主任,海南机设信托投资公司证券部主办会计,长城证券有限责任公司财务部主管、深圳二部财务部经理、成都营业部副总经理兼财务部经理、深圳一部副总经理兼财务部经理、审计部总经理、风险管理部总经理,现任长城证券有限责任公司财务部副总经理,并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

张令先生,中共党员,研究生学历。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理,现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。

孟凡君先生,中共党员,经济学学士,经济师。历任工商银行河南华信资金市场融资二部经理、总经理助理、中原信托投资有限公司开封证券营业部副经理、资产管理部经理,现任中原信托有限公司投资管理二部经理。

田德良先生,中共党员,本科学历,经济师。曾任职于中国建设银行天津开发区分行,任经理助理、事后总稽核。现任职于北方国际信托股份有限公司,曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部经理、监察稽核部副经理、项目评估部项目经理、业务发展总部客户经理、自营业务总部客户经理,现任资产管理部高级项目经理。

桑煜先生,中共党员,经济学学士。曾任职于中国建设银行山东日照市分行、中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司,历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理,现任公司总经理助理兼综合管理部总经理和运行保障部总经理。

张静女士,中共党员,2005年毕业于南开大学,法学硕士。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。2007年5月至今,任长城基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

③高级管理人员

杨光裕先生,长城基金管理有限公司董事长,简历同上。

关林戈先生,长城基金管理有限公司董事、总经理,简历同上。

余骏先生,硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经管学院,历任中国人民银行湖北省分行科室负责人,君安证券有限公司研究部宏观发言人,长城证券有限责任公司营业部总经理,长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理、综合管理部总经理和运行保障部总经理,现任长城基金管理有限公司副总经理兼市场开发部总经理。

韩浩先生,硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部总经理,长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理部总经理、"久嘉证券投资基金"基金经理、总经理助理、"长城久恒平衡型证券投资基金"基金经理,现任长城基金管理有限公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

彭洪波先生,经济学硕士,工学学士,MBA,曾就职于长城证券有限责任公司,历任深圳东园路营业部电脑部经理,公司电子商务筹备组项目经理,公司审计部技术主审。2002年3月加盟长城基金管理有限公司,历任监察稽核部业务主管、部门副经理、部门经理,现任长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理。

2、本基金拟任基金经理简历

杨建华先生,北京大学力学系理学学士,北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师。具有10年证券从业经历。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳市和君创业投资公司、长城证券有限责任公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司,曾任基金经理助理,2007年9月25日至2009年1月5日任"长城安心回报混合型证券投资基金"基金经理,2004年5月21日至今任"长城久泰中信标普300指数证券投资基金"基金经理,2009年9月22日至今任"长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)"基金经理。

3、本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

关林戈先生,投资决策委员会主席,公司董事、总经理。

韩浩先生,投资决策委员会执行委员,公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

杨毅平先生,投资决策委员会委员,公司首席策略分析师。

秦玲萍女士,投资决策委员会委员,公司研究部总经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、基金管理人的权利

①依法募集基金,办理基金备案手续;

②依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产;

③根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;

④根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式,获得基金管理费、收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用;

⑤根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额;

⑥在本合同的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会和中国银监会,以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;

⑦根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;

⑧自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构,办理基金注册登记业务,并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;

⑨在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;

⑩在法律法规允许的前提下,为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券;

⑪依据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益分配方案;

⑫按照法律法规,代表基金对被投资企业行使股东权利,代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利;

⑬在基金托管人职责终止时,提名新的基金托管人;

⑭依据法律法规和基金合同的规定,召集基金份额持有人大会;

⑮选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;

⑯法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

①依法申请并募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

②办理基金备案手续;

③自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理、分别记账,进行证券投资;

⑥按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

⑦除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

⑧进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;

⑨依法接受基金托管人的监督;

⑩编制季度、半年度和年度基金报告;

⑪采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

⑫计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

⑬严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

⑭保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予以保密,不得向他人泄露;

⑮按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

⑯保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料;

⑰依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

⑱以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

⑲组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

⑳因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

㉑基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

㉒法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人承诺

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》等法律法规的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止性行为

①将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

②不公平地对待其管理的不同基金财产;

③利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

⑤依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

(五)基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3、不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(六)基金管理人的内部控制制度

健全、完善的内部风险控制制度是规范公司行为,有效防范经营风险,实现公司持续、稳健发展的主要保证,也是公司经营管理水平的重要标志。为此,公司建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度。

1、风险控制的目标

公司风险控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理实体。具体目标是:

①确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行;

②建立符合现代企业制度要求的法人治理结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制;

③不断提高基金管理的效率和效益,在有效控制风险的前提下,努力实现基金份额持有人利益最大化;

④努力将各种风险控制在规定的范围内,保障公司发展战略和经营目标的全面实施,维护公司股东的合法权益;

⑤建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

2、建立风险控制制度的原则

公司按照合法、合规、稳健的要求,制定明确的经营方针,建立合理的经营机制。在建立风险控制制度时应严格遵循以下原则:

①全面性原则:风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

②审慎性原则:内部风险控制的核心是有效防范各种风险,公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;

③独立性原则:公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行部门;风险控制委员会、合规审查委员会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查;

④有效性原则:风险控制制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章,具有高度的权威性,成为所有员工严格遵守的行动指南;执行风险控制制度不能存在任何例外,公司任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力;

⑤适时性原则:内部风险控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善;

⑥防火墙原则:公司基金投资、研究策划、市场开发等相关部门,应当在空间上和制度上适当分离,以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序。

3、风险控制的主要内容

①确立加强内部风险控制的指导思想,确定风险控制的目标和原则;

②建立层次分明、权责明确的风险控制体系;

③建立公司风险控制程序;

④对公司内部风险进行全面、系统的评估,制定风险控制计划;

⑤确定公司风险控制的路径和措施;

⑥保障风险控制制度的持续性和有效性,制定可行的风险控制制度的评价和检查机制。

4、风险控制体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构,并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系:

①一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险控制与审计委员会,负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。对公司内部控制制度的有效性进行评价,对公司经营管理和基金业务运作的合法合规性进行监督检查,协助董事会建立并有效维持公司内部控制系统,对公司经营中的风险进行研究、分析和评估,并提出风险防范措施和建议,保证公司的规范健康发展。风险控制与审计委员会的基本职能为:

①协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。

②审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。

③检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况,并出具评估意见或改正方案;

④定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报;

⑤检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见;

⑥评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险,检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性,并提出改进意见;

⑦检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序,与外部审计机构进行交流;

⑧对公司内部控制和风险管理工作进行考核;

⑨董事会安排的其他事项。

(下转D6版)

# 长城中小盘成长股票型证券投资基金基金合同摘要

**基金管理人:长城基金管理有限公司**
**基金托管人:中国银行股份有限公司**
**二〇一〇年十二月**

## 一、基金合同当事人及其权利义务

(一)基金管理人

1、基金管理人基本情况

名称:长城基金管理有限公司

住所:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

法定代表人:杨光裕

成立日期:2001年12月27日

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【2001】55号

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

组织形式:有限责任公司

注册资本:1.5亿元人民币

存续期间:持续经营

2、基金管理人的权利

①依法募集基金,办理基金备案手续;

②依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产;

③根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;

④根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式,获得基金管理费,收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用;

⑤根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额;

⑥在本合同的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的,应及时呈报中国证监会和中国银监会,以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益;

⑦根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;

⑧自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构,办理基金注册登记业务,并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;

⑨在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;

⑩在法律法规允许的前提下,为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券;

⑪依据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益分配方案;

⑫按照法律法规,代表基金对被投资企业行使股东权利,代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利;

⑬在基金托管人职责终止时,提名新的基金托管人;

⑭依据法律法规和基金合同的规定,召集基金份额持有人大会;

⑮选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;

⑯法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

①依法申请并募集基金,办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

②办理基金备案手续;

③自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理、分别记账,进行证券投资;

⑥按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

⑦除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

⑧进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;

⑨依法接受基金托管人的监督;

⑩编制季度、半年度和年度基金报告;

⑪采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

⑫计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

⑬严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

⑭保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予以保密,不得向他人泄露;

⑮按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

⑯保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料;

⑰依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

⑱以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

⑲组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

⑳因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

㉑基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

㉒法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

(四)基金管理人承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》等法律法规的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止性行为

①将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

②不公平地对待其管理的不同基金财产;

③利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

⑤依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

(五)基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3、不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(六)基金管理人的内部控制制度

健全、完善的内部风险控制制度是规范公司行为,有效防范经营风险,实现公司持续、稳健发展的主要保证,也是公司经营管理水平的重要标志。为此,公司建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度。

1、风险控制的目标

公司风险控制的总体目标是建立一个决策科学、运营规范、管理高效和持续、稳定、健康发展的基金管理实体。具体目标是:

①确保国家法律法规、行业规章和公司各项规章制度的贯彻执行;

②建立符合现代企业制度要求的法人治理结构,形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制;

③不断提高基金管理的效率和效益,在有效控制风险的前提下,努力实现基金份额持有人利益最大化;

④努力将各种风险控制在规定的范围内,保障公司发展战略和经营目标的全面实施,维护公司股东的合法权益;

⑤建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度。

2、建立风险控制制度的原则

公司按照合法、合规、稳健的要求,制定明确的经营方针,建立合理的经营机制。在建立风险控制制度时应严格遵循以下原则:

①全面性原则:风险控制制度应覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节;

②审慎性原则:内部风险控制的核心是有效防范各种风险,公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点;

③独立性原则:公司风险控制的检查、评价部门应当独立于风险控制的建立和执行部门;风险控制委员会、合规审查委员会、督察长和监察稽核部应保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行评价和检查;

④有效性原则:风险控制制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章,具有高度的权威性,成为所有员工严格遵守的行动指南;执行风险控制制度不能存在任何例外,公司任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力;

⑤适时性原则:内部风险控制应随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善;

⑥防火墙原则:公司基金投资、研究策划、市场开发等相关部门,应当在空间上和制度上适当分离,以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员,应制定严格的批准程序。

3、风险控制的主要内容

①确立加强内部风险控制的指导思想,确定风险控制的目标和原则;

②建立层次分明、权责明确的风险控制体系;

③建立公司风险控制程序;

④对公司内部风险进行全面、系统的评估,制定风险控制计划;

⑤确定公司风险控制的路径和措施;

⑥保障风险控制制度的持续性和有效性,制定可行的风险控制制度的评价和检查机制。

4、风险控制体系

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构,并在此基础上建立层层递进、严密有效的多级风险防范体系:

①一级风险防范

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。

董事会下设风险控制与审计委员会,负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。对公司内部控制制度的有效性进行评价,对公司经营管理和基金业务运作的合法合规性进行监督检查,协助董事会建立并有效维持公司内部控制系统,对公司经营中的风险进行研究、分析和评估,并提出风险防范措施和建议,保证公司的规范健康发展。风险控制与审计委员会的基本职能为:

①协助董事会建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制组织体系和制度体系。

②审查、评价公司基金投资管理制度、市场营销管理制度、风险管理制度等各项内部控制制度的合法合规性、合理性和有效性。

③检查和评价公司管理和资产经营、基金管理和资产经营中对国家有关法律法规、中国证监会部门规章以及基金合同的遵守和执行情况,并出具评估意见或改正方案;

④定期或不定期听取公司主要经营管理人员关于风险管理工作的汇报;

⑤检查和评价公司各项内部控制制度的执行情况并提出改进意见;

⑥评估公司管理和基金管理中存在或潜在的风险,检查和评价公司各项业务风险控制工作的有效性,并提出改进意见;

⑦检查公司会计政策、财务状况和财务报告程序,与外部审计机构进行交流;

⑧对公司内部控制和风险管理工作进行考核;

⑨董事会安排的其他事项。

(下转D8版)

# 长城中小盘成长股票型证券投资基金份额发售公告

**基金管理人:长城基金管理有限公司**
**基金托管人:中国银行股份有限公司**
**二〇一〇年十二月**

**重要提示**

1、长城中小盘成长股票型证