（上接D13版）

1、经济的增长率；
2、利率政策和通胀水平；
3、各种资产的收益和风险比较；
4、各种资产的估值水平比较；
5、市场流动性；
6、本基金现金流。

（二）股票投资策略

本基金的股票投资将遵循被动投资和主动投资的双重策略。被动投资将通过完全复制的指数化策略来实施，主要目标为控制和最小化跟踪误差；主动投资将以基本面研究为基础，力争取得优于标的指数的收益率。

1、指数化投资

不少于80%的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普100等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化，进行相应的调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数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，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。

（1）对标的指数的跟踪调整

标准普尔公司会定期和不定期根据成员变化、股价变化、并购、特殊分红等进行成份股及权重调整，本基金将根据标准普尔公司的公告并在规定时间内进行相应调整。

（2）跟踪误差的控制和再平衡调整

本基金追求基金净值增长率与标普100等权重指数收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在0.50%以内（相应的年化跟踪误差控制在7.94%以内），以实现对标的指数的有效跟踪。

本基金采取跟踪误差和跟踪偏离度这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于目标指数的偏离风险。

本基金每周计算上述跟踪误差。如果该指标接近或者超过0.5%，并且跟踪偏离度小于0，则本基金管理人将通过数量分析找出跟踪误差的来源，即考察某一阶段的跟踪误差指标分别来源于交易费用、投资组合与指数成份股所含股票的差别和权重的偏离的比例，并在适当的时机进行再平衡调整操作，使得跟踪误差回复到最大容忍值以下。

2、主动型投资

对于不高于基金净资产15%的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

证券选择的起点是通过定量和定性方式初步筛选投资领域，以便发现值得深入研究的公司。在初步筛选阶段将以数量化模式为主要手段，具体筛选因素包括市值、流动性、现金流、负债率、估值水平、销售收入和净收入的增长等。

经过筛选的公司将以行业分类，结合对宏观经济和行业周期的研究和判断以及标普100等权重指数的行业配置比例，基金管理人将对主动投资基金净值作合理的行业配置。各个行业内的公司将以各种基本面指标进行综合评级，进一步筛选投资的目标公司，本基金管理人认为这样的公司往往拥有以下特征：

（1）在市场及行业内拥有主导地位，并能获取超额利润；
（2）所处行业拥有较高的成长潜力；
（3）公司的主导地位和竞争优势拥有可延续性，市场进入壁垒较高；
（4）公司内在价值（intrinsic value）高于当前市场价值，并且下降空间有限，使得股票拥有较强的风险和回报的特质。

当选择出具有上述特征的企业后，本基金将基于动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的评估方法，如自由现金流贴现法（DCF）、红利贴现法（DDM）、各部分累加法（Sum-of-the-Part）、市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）等，对入选股票进行价值评估，在此基础上选择股价没有充分反映价值的投资目标。

以基本面为基础的主动投资是本基金争取超值回报的主要手段，在适当的时机下基金管理人也将采取以下策略力争获取超越标的指数的收益率：

1）适当调整成分股权重的主动性投资

本基金将依据宏观经济形势和经济周期各个阶段不同行业表现以及当前各个行业估值水平，并采用数量化分析与基本面研究相结合的方法对目标指数的成份股进行综合评分，在综合考虑交易成本、交易冲击、流动性、投资比例限制等因素后，本基金将适度增加排名靠前成份股的权重以及适度减少排名靠后成份股的权重。成分股权重的适当调整将在确保本基金的跟踪误差和跟踪偏离度在规定范围之内的前提下进行。

2）前瞻性纳入部分备选成份股

如果预期目标指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否提前纳入部分备选成份股。

（三）固定收益证券投资策略

本基金固定收益证券的投资以流动性管理需要和低风险为主要投资依据，收益率水平为辅助投资依据，由此给现金流管理提供良好的基础。本基金将根据国内外宏观经济形势、债券市场资金供求情况以及市场利率走势来预测债券市场利率变化趋势，并对各债券品种收益率、流动性、信用风险和久期进行综合分析，评定各品种的投资价值，同时着重考虑基金的流动性管理需要，主要选取到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券和银行存款等货币市场工具作为主要的投资工具。

（四）其他金融衍生品投资策略

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生品对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用上述金融衍生品必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

1、金融衍生品主要投资策略包括：

（1）规避风险：本基金可利用货币远期和货币互换来对冲人民币和美元之间的汇率风险，避免汇率的波动性对基金的回报率和回报率的波动率产生负面影响；本基金也可利用相关的指数期货和指数期权及个股期权对市场的系统性风险和个股风险进行对冲。

（2）有效管理：本基金在建仓期及发生大规模申购或赎回时，大量买入或卖出会造成股价的短期波动而抬高交易成本，可以利用金融衍生品的流动性和杠杆作用进行短期的替代，以降低交易成本。本基金也可将待投资的现金暂时投资于相关的指数期货，以此降低和标的指数的跟踪误差。

2、主要金融衍生品及简介

金融衍生品通常是指从基础资产（Underlying Assets）派生出来的金融工具，这种金融工具的回报率是根据基础资产和一些其它金融要素的表现情况衍生出来的，比如利率，汇率，波动性，各种指数（股票指数，消费者物价指数，以及天气指数）等。这些要素的表现将会决定一个衍生品的回报率和回报时间。金融衍生品的共同特征是保证金交易，即只要支付一定比例的保证金就可进行全额交易，不需实际上的本金转移，合约的了结一般也采用现金差价结算的方式进行，只有在满期日以实物交割方式履约的合约才需要买方交足货款。所以金融衍生品具有杠杆性和高风险性。金融衍生品的主要类型有互换（Swap）、权证（Warrant）、期权（Options）、期货（Futures）、远期（Forward）等。

（1）互换是指当事双方同意在预先约定的时间内，通过一个中间机构来交换一连串付款义务的金融交易，或者说是当事双方同意在预先约定的时间内用一种现金流交换另一种现金流。互换协议规定了现金流交换的时间和计算的方式。一般来说，互换协议中至少有一种现金流是由利率，汇率，股权价格，或商品价格来决定的。互换中的现金流通常是依照一个本金单位来计算的。本金单位一般不会在当事双方之间交换。比较常见的互换交易包含货币互换（Currency Swap）和利率互换（Interest Rate Swap）两种。现在互换是世界上交易量最大的金融产品之一。@　（2）权证是基础证券发行人或其以外的第三人发行的，约定持有人在规定期间内或特定到期日，有权按约定价格向发行人购买或出售标的证券，或以现金结算方式收取结算差价的有价证券。投资者付出权利金购买后，有权利（而非义务）在某一特定期间（或特定时点）按约定价格向发行人购买或者出售标的证券。很多时候权证被当作一种附于债券或者优先股的优惠券，使得债券或者优先股的发行者能够付更低的利息或者股息。权证也可以提高债券的收益，从而使得债券对投资者来说更具有吸引力。一般来说权证可以被拆分，独立于依附的债券或者股票进行买卖。

（3）期权合约是一种赋予权利而不是义务的标准化契约，即在某一段特定时间内，以期权合约成交时双方同意的期权费，买卖特定价格，特定数量与质量的相关产品。买入期权是指它给予期权的持有者在给定时间或在此时间以前的任一时刻按规定的价格买入一定数量某种资产或期货合约的权利的一种法律合同。卖出期权给予其持有者在给定时间或在此时间以前的任一时刻，按规定的价格卖出一定数量某种资产或期货合约的权利的一种法律合同。期权的持有者拥有该项期权规定的权利，持有者可以行使该权利，也可以放弃该权利，期权的出卖者则只有履行期权合约规定的义务。

（4）期货一般指由期货交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。这个标的物，又叫基础资产，是期货合约所对应的现货，可以是某种商品，如铜或原油，也可以是某个金融工具，如外汇、债券，还可以是某个金融指标，如三个月同业拆借利率或股票指数。期货合约的买方，如果将合约持有到期，就有义务买入期货合约对应的标的物；而期货合约的卖方，如果将合约持有到期，就有义务卖出期货合约对应的标的物。期货合约的交易者还可以选择在合约到期前进行反向买卖来冲销这种义务。

（5）远期又称远期合同，是指当事双方现在同意在将来的特定时间以特定价格买卖某种资产。远期合同是和现货合同相对应的，而现货合同是指同意当前以特定价格买卖某种资产。远期合同中当事双方同意的价格被称为交割价格。同意将来买入资产的一方被称为多方，同意将来卖出资产的一方被称为空方。在远期合同中，资产价格的交换发生在资产控制权的交换之前，因此远期是一种买卖交易发生在资产交换之前的合同。远期价格一般和现场价格相对应，现场价格是指当前资产交换的价格。远期价格和现场价格的差别一般叫做远期溢价或远期折价，通常是远期合同购买者的利润或损失。

3、金融衍生品风险管理机制

本基金根据金融衍生产品的高风险、高杠杆特性，制定了金融衍生品投资风险控制策略和严格的投资风险控制流程。金融衍生品投资风险控制策略分为事前风险识别、事中风险跟踪及控制和事后风险评估总结三个方面：

（1）事前风险识别主要包括宏观环境分析、市场分析、衍生品合约细则的认识和分析、衍生品流动性分析、衍生品波动率分析等。

（2）事中风险跟踪及控制主要包括金融衍生品投资仓位的监控和预警、衍生品在值风险（VaR）估算和预测、情景分析、压力测试以及金融衍生品投资合规性的日常检查和警示等。

（3）事后风险评估总结主要包括对金融衍生品投资盈利或损失的归因分析和总结。

4、金融衍生品的投资方式及频率

本基金主要投资于在美国市场上市交易的金融衍生品，当交易所没有本基金需要的金融衍生品时，可采用场外交易市场（OTC）进行买卖。

本基金采用金融衍生品的时间和频率将根据投资策略、市场环境、申购赎回等因素决定。

随着美国证券市场投资工具的发展和丰富，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在基金更新的招募说明书中披露。

在符合有关法律法规以及本基金基金合同规定的投资限制前提下，本基金还可进行证券借贷交易、回购交易等投资，以提高收益。

六、投资决策依据与决策程序

（一）决策依据

1、国家和证监会有关法律法规和本《基金合同》的有关规定；
2、标的指数的编制方法及其调整；
3、宏观经济形势、货币和财政政策、利率走势和通货膨胀预期、市场流动性及行业周期；
4、各种资产的估值水平和预期收益及风险的比较。

（二）投资决策程序

公司在内部建立了包括投资决策委员会、国际业务部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、金融工程部以及交易管理部等部门在内的完整的投资决策程序。

本基金采用投资决策委员会指导下的基金经理负责制。

1、国际业务部是管理本基金的主要业务部门，基金经理和研究员依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展宏观经济及数量化的研究；在金融工程部的协助下开展指数跟踪、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，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据；

2、公司投资决策委员会依据国际业务部提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，审议决策相关事项。国际业务部根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策；

3、依据标的指数的组成和基本面研究，国际业务部以完全复制指数成份股的方法结合主动投资选股构建组合。在将跟踪误差和偏离度控制在规定范围内的前提下，基金经理将采取适当的策略追求优于标的指数的回报，同时控制投资风险；

4、交易管理部根据投资管理部的投资指令，进行基金资产的日常交易活动，对交易情况及时反馈，并对投资指令进行监督，遇有异常情况要及时向投资总监反映，同时对投资指令进行合规性检查；

5、国际业务部和金融工程部的风险与业绩评估人员定期对基金投资组合进行业绩和风险评估，提供基金业绩评估报告，确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，并提出风险控制意见，作为投资决策委员会调整风险控制策略和评估投资业绩的参考；

6、国际业务部将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数；

7、监察稽核部负责监督整个投资交易全过程是否有违反国家相关法律、法规和公司规章制度的规定，检查有无涉嫌内幕交易、侵犯持有人权益的行为；

8、国际业务部在确保基金持有人利益的前提下，有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

七、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

标准普尔100等权重指数总收益率

本基金为增强型股票指数基金，不低于基金资产净值80%的部分将投资于标准普尔100等权重指数成份股，不高于基金资产净值15%的增强型部分将主要投资于在美国公开上市的权益类证券。因此，本基金设置标准普尔100等权重指数总收益率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、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业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

八、风险收益特征

本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

九、投资限制

（一）为维护基金份额持有人的合法权益，除中国证监会另有规定外，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；
2、向他人贷款或提供担保；
3、从事承担无限责任的投资；
4、购买不动产；
5、购买房地产抵押按揭；
6、购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；
7、购买实物商品；
8、除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
9、利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
10、参与未持有基础资产的卖空交易；
11、直接投资与实物商品相关的衍生品；
12、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
13、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
14、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
15、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述限制，在可适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

（二）投资组合限制

1、对标普100等权重指数的成份股的投资不低于基金资产净值的80%。
2、基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。
3、为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。
4、基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。
5、单只基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。
6、基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。
7、基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。
8、本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：（1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级；（2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；（3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。
9、本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的10%，持有货币市场基金可以不受该等限制。
10、基金合同、中国法律法规及中国证监会规定的其他限制。

若基金超过上述2、4、5、9项规定的投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制的要求。

（三）本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。
2、应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。
3、借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。
4、除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：
（1）现金；
（2）存款证明；
（3）商业票据；
（4）政府债券；
（5）中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。
5、本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。
6、基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

（四）基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：

1、所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。
2、参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。
3、买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。
4、参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。
5、基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

（五）基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

（六）若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

（七）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在30个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

十、基金管理人代表基金行使所投资证券产生权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
3、有利于基金财产的安全与增值；
4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十一、基金的上市交易

若将来基金管理人认为有必要，基金管理人在履行适当程序后可将本基金相应调整为上市开放型基金（LOF）的模式，并对本基金的投资运作、基金估值等相关内容进行调整，届时无需召开基金份额持有人大会，但需报中国证监会核准后在指定媒体上公告。

十二、代理投票

（一）基金管理人作为基金投资者的代理人，将行使股票的代理投票权。在代理投票时，公司将本着投资者利益最大化的原则，按照增加股东利益，提高股东发言权的原则提出代理投票的建议。

（二）代理投票权的决定将由基金经理做出。公司将保留代理投票的文件至少三年以上。

（三）基金管理人可委托境外境外托管人进行代理投票。

（四）在某些中国以外的法域中，就基金组合内公司的股份行使投票权的股东可能被限制在股东大会召开日期前后的一段时间内对股票进行交易。由于此类交易限制会妨碍组合管理且可能导致基金的流动性受损，如果存在此类限制，基金管理人在一般情况下将不行使代理投票权。此外，某些中国以外的法域要求投票的股东就不同的基金披露当前的持股情况，如果存在此类披露要求，基金管理人在一般情况下将不行使委托投票权，以保护基金持有信息。

（五）基金将保留委托投票权的记录，至少保存3年以上。其中包括：

1、基金作为证券持有人收到的有报告义务的发行人的证券持有人会议相关的材料；
2、发行人的名称；
3、组合证券的交易所代码；
4、会议日期；
5、会议上需投票的事项的简要描述；
6、需投票的事项是否由发行人、其管理层或其他人或公司提出；
7、基金是否对该等事项进行了投票；
8、基金如何就该等事项进行了投票；
9、基金的投票是赞成还是反对发行人的管理层的提议。

十三、证券交易

（一）券商的交易执行能力、研究实力和提供的研究服务，这是选择券商以及分配交易量最主要的原则和标准，包括以下几个方面：

交易执行能力。主要指券商是否对投资指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：是否完成交易、成交的及时性、成交价格、对市场的影响等；

研究机构的实力和水平。主要是指券商能否所提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告，报告内容是否详实，投资建议是否准确；

提供研究服务的质量。主要指券商承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座。

（二）基金管理人根据上述标准对境外券商进行遴选，拟定交易量分仓比例，并每季度进行调整。

考核内容包括：服务质量、证券推荐的成功率、交易的执行力等因素。

考核采取打分制，打分采取加权平均的办法，主要有以下方面：交易执行能力（40%）、研究能力（30%）、服务质量（30%）。

（三）每家券商的分仓比例上限为50%，具体分仓计算公式为：50%×考核得分/5。

（四）对于在券商选择和分仓中存在或潜在的利益冲突，基金管理人应该本着维护持有人的利益出发进行妥善处理，并及时进行披露。

（五）交易佣金的返还。基金管理人每年年初根据对券商的评价和考核，与券商签订服务协议，在协议中规定详细的交易佣金的收取标准，严格禁止佣金返还的情况出现。

第五章 基金的业绩

本基金在业绩披露中将参照全球投资表现标准（GIPS）

一、在业绩表述中采用统一的货币；
二、参照GIPS的相关规定和标准进行计算。

第六章 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		
设立日期	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人员情况

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。曾任中国人民解放军273团政委，上海市松江区建设委员会党委书记，上海市松江区小昆山镇党委书记，上海市松江区洞泾镇党委书记，上海海欣集团股份有限公司监事会主席、总裁。现任上海海欣集团股份有限公司党委书记、董事长。
陈谋亮	董事	男	中共党员，博士，高级经济师。曾任湖北经济学院讲师，扬子石化公司法律顾问，上海交大南洋股份有限公司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兼战略投资管理部常务副总监、总裁助理。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	金融学硕士，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总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，曾任公司投资总监，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			

（下转D15版）

（上接D13版）

（2）本人有效身份证件及复印件（二代身份证正反面复印）；
（3）在本代销机构开立的资金账户卡；
（4）代销网点指定的银行存折（储蓄卡）。

机构投资者开立基金账户应提供以下材料：
（1）开户申请表（加盖机构公章和法定代表人章）；
（2）经办人身份证件及复印件；
（3）授权委托书（加盖机构公章和法定代表人章）；
（4）代销网点开立的资金账户卡。

4、提出认购申请

个人投资者在开立资金账户和基金账户并存入足额认购资金后，可申请认购本基金。个人投资者申请认购本基金应提供以下材料：
（1）填妥的《认购申请表》；
（2）本人有效身份证原件及复印件（二代身份证正反面复印）；
（3）在代销机构开立的资金账户卡；
（4）投资者还可通过各代销网点的电话委托、自助/热自助委托、网上交易委托等方式提交认购申请。

机构投资者申请认购本基金应提供以下材料：
（1）认购申请表（加盖机构公章和法定代表人章）；
（2）经办人身份证件及复印件（二代身份证正反面复印）；
（3）授权委托书（加盖机构公章和法定代表人章）；
（4）代销网点开立的资金账户卡；
（5）投资者还可通过电话委托、自助/热自助委托、网上交易委托等方式提出认购申请。

四、清算与交割

（一）本基金合同生效前，全部认购资金将被冻结在本基金在中登公司开立的开放式结算备付金账户中，投资者认购资金利息的计算以注册登记机构的计算为准，在募集期结束时归入投资者认购金额中，如基金合同生效，则折算为基金份额归投资者所有。

（二）本基金权益登记由本基金的注册登记机构在募集结束后完成。

五、募集费用

本次基金募集期间所发生的与本基金有关的法定信息披露费、会计师费、律师费等费用可以从基金管理人收取的基金认购费中列支，不得从基金财产中支付。若基金募集失败，募集费用由基金管理人承担。

六、基金的验资与基金合同的生效

基金募集期届满，本基金募集的基金份额总额符合《基金法》第四十四条的规定，并具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

（一）基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币；
（二）基金份额持有人的人数不少于200人。

募集截止后本基金管理人根据注册登记机构确认的数据，将有效认购资金（不含认购费）及有效认购申请资金产生的利息一并划入在托管行开立的专用验资账号。基金管理人应当自基金募集结束之日起10日内聘请法定验资机构验资，法定验资机构出具验资报告，注册登记机构出具认购户数证明。基金管理人自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续，并将备案文件抄报国家外汇管理局。

自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。

基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

七、退款事项

（一）基金募集结束后，以下情况将被视为无效认购：
1、投资者划来资金，但未办理开户或开户手续或办理不成功的；
2、投资者划来资金，但未办理认购申请或认购申请未被确认的；
3、投资者划来的认购资金小于其申请的认购金额的；
4、其他导致认购无效的情况。

（二）投资者的无效认购资金，将于本基金合同生效之日起七个工作日内向投资者指定的银行账户或指定的券商资金账户划出。

（三）基金募集未达到法定要求：

在募集期结束后，如果本基金募集份数少于2亿份，基金募集金额不到2亿元人民币或者认购人数低于200人，则基金合同不能生效。届时由本基金管理人承担因募集行为而产生的费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在募集期届满后30天内退还投资者。

八、本次募集有关当事人和中介机构

（一）基金管理人

表4：基金管理人概况表

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
设立日期	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	长江证券股份有限公司出资7350万元，占注册资本的49%
	上海海欣集团股份有限公司出资5149.5万元，占注册资本的34.33%
	武汉钢铁股份有限公司出资2500.5万元，占注册资本的16.67%

（二）基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）
住所：北京市复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
成立日期：1983年10月31日
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
存续期间：持续经营
联系人：宁敏
联系电话：010-66594856
经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

（三）销售机构

表5：基金销售机构列表

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
（2）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
（3）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
（4）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
（5）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
（6）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
（7）深圳发展银行股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号	
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦	
法定代表人：肖遂宁	传真：0755-25841098
客户服务电话：95501	网址：www.sdb.com.cn
（8）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
（9）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
（10）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
（11）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
（12）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
（13）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
（14）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
（15）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
（16）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

（17）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
（18）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
（19）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
（20）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
（21）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
（22）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
（23）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
（24）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
（25）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
（26）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
（27）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
（28）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
（29）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
（30）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
（31）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
（32）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

（33）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
（34）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	
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）	
法定代表人：杨宇翔	联系人：周璐
电话：0755-22626172	传真：0755-82400862
客户服务电话：4008816168	网址：http://www.pingan.com
（35）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
（36）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
（37）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
（38）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
（39）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
（40）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
（41）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
（42）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
（43）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
（44）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

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份额，并及时公告。

（四）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

表6：基金注册机构、律师事务所、会计师事务所列表

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	梁丽金、刘佳	黄小熠、王国蓓

长信基金管理有限责任公司
二〇一一年二月二十三日

（上接D13版）

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利按分红权益登记日（具体以届时的基金分红公告为准）自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费（如基金管理人委托投资顾问，包括投资顾问费）；
2、基金托管人的托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括向其支付的相应服务费）；
3、基金的证券交易费用、在境外市场的开户、交易、清算、登记等各项费用；
4、基金合同生效以后的信息披露费用；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金合同生效以后的会计师费、律师费和其他为基金利益而产生的中介机构费用；
7、基金的资金汇划费用；
8、外汇兑换交易的相关费用；
9、代表基金投票的费用；
10、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）；
11、更换基金管理人、更换基金托管人及基金资产由原基金托管人转移至新基金托管人所引起的费用；
12、经生效的司法文书判决或裁定明确应由基金资产承担的与基金有关的诉讼、追索费用；
13、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（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1.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金的管理费
E为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，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前5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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0.3%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.3%÷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，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前5个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、上述“一、基金费用的种类”中第3-13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

本条第（一）款约定以外的其他费用，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，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。

（四）基金费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费、基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和标普100等权重指数（本基金的标的指数）收益率之间的日均跟踪误差控制在0.50%以内（相应的年化跟踪误差控制在7.94%以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。

（二）基准货币

人民币

（三）投资范围

本基金主要投资于标普100等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；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。

本基金为股票指数增强型基金，对标普100等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的80%-95%；现金、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本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其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（四）投资理念

本基金将采用“指数化投资为主、主动性投资为辅”的投资理念，在最小化和控制跟踪误差的基础上通过有效的资产及行业组合和基本面研究力求投资收益能够有效跟踪并适度超越标的指数。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

标准普尔100等权重指数总收益率

本基金为增强型股票指数基金，不低于基金资产净值80%的部分将投资于标准普尔100等权重指数成份股，不高于基金资产净值15%的增强型部分将主要投资于在美国公开上市的权益类证券。因此，本基金设置标准普尔100等权重指数总收益率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、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业绩基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（六）风险收益特征

本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

（七）投资限制

1、为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：
（1）承销证券；
（2）向他人贷款或提供担保；
（3）从事承担无限责任的投资；
（4）购买不动产；
（5）购买房地产抵押按揭；
（6）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证；
（7）购买实物商品；
（8）除应付赎回、交易清算等临时用途以外，借入现金；
（9）利用融资购买证券，但投资金融衍生品除外；
（10）参与未持有基础资产的卖空交易；
（11）直接投资与实物商品相关的衍生品；
（12）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
（13）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
（14）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
（15）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述限制，在可适用于本基金的情况下，则本基金投资不再受相关限制。

2、投资组合限制：
（1）对标普100等权重指数的成份股的投资不低于基金资产净值的80%。
（2）基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。
（3）为应付赎回、交易清算等临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。
（4）基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。
（5）单只基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。
（6）基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。
（7）基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。
（8）本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品，应当符合以下要求：1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级；2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值，并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易；3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。
（9）本基金持有境外基金的市值合计不得超过本基金净值的10%，持有货币市场基金可以不受该等限制。
（10）本合同、中国法律法规及中国证监会规定的其他限制。

若基金超过上述（2）、（4）、（5）、（9）项规定的投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制的要求。

3、本基金可以参与证券借贷交易，并且应当遵守下列规定：
（1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。
（2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。
（3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。
（4）除中国证监会另有规定外，担保物可以是以下金融工具或品种：
1）现金；
2）存款证明；
3）商业票据；
4）政府债券；
5）中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。
（5）本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。
（6）基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

4、基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易，并且应当遵守下列规定：
（1）所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。
（2）参与正回购交易，应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。
（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。
（4）参与逆回购交易，应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约，本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。
（5）基金管理人应当对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

5、基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。

前项比例限制计算，基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

6、若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

7、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在30个交易日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产总值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）估值方法

本基金的估值对象为本基金所拥有的证券和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

本基金的估值方式如下：

1、上市流通股票：

如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。

如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

2、未上市股票：

送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次公开发行且未上市的股票，按成本价估值。

首次发行且有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值。

3、金融衍生品：
（1）上市流通衍生品按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。
（2）未上市衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值技术确定公允价值。
（3）衍生品的估值，可以参照国际会计准则进行。

4、基金持有的债券、交易型开放式指数基金（ETF）等其他有价证券，上市交易的有价证券按估值日的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

5、开放式基金以估值日可以获得的最新基金份额净值进行估值。

6、非流动性资产或暂停交易的证券估值方法：

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可以根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及美元、港币对人民币汇率的，采用当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。

8、在任何情况下，基金管理人如采用本项第1-7小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第1-7小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

（四）基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。如本基金投资衍生品，应当在每个工作日计算并披露基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或赎回之后，基金管理人应当在T+2日（T日为开放日）通过网站、基金份额发售网点以及其他指定媒体，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日后2日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同第九部分第（二）点规定的对基金合同当事人权利义务产生重大影响的事项应经基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：
1、基金份额持有人大会决定终止；
2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序
（1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
（4）对基金财产进行评估和变现；
（5）制作清算报告；
（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
（7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
（8）对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：
（1）支付清算费用；
（2）交纳所欠税款；
（3）清偿基金债务；
（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

八、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议应首先通过友好协商解决。但若自一方书面要求协商解决争议发生之日起60日内未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。