长城久泰沪深300指数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:长城基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司

二〇一一年七月

长城久泰沪深300指数证券投资基金经中国证监会2004年4月2日证监基金字【2004】51号文批准发起设立。本基金合同于2004年5月21日正式生效。

重要提示

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现,本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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,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《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》、《长城久泰沪深300指数证券投资基金基金合同》及其他有关规定享有权利、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。

本招募说明书所载内容截止日为2011年5月20日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年3月31日(财务数据未经审计)。本招募说明书更新已经本基金托管人招商银行股份有限公司复核。

一、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、注册地址: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
8、传真:0755-23982328
9、联系人:袁柳生
10、客户服务电话:400-8868-666
11、注册资本:壹亿伍仟万元人民币
12、股权结构:

†2。22¥。»	2…22。2-2-˜22
‡/† ˜2/˜ †2–˜222˜ ˙。«˙。2	47.059%
2-2»–˜˜–2–˜2。«˙。2	17.647%
–→•‰。®。˜–˜˜–。2•22–˜2。«˙。2	17.647%
¶«•‰2/˜ †。2•22–˜2。«˙。2	17.647%
ª˜。˜	100%

13、管理基金情况:目前管理长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、久嘉证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深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、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金等十三只基金。

(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。

范小新先生,中共党员,经济学博士,高级经济师。1986年7月参加工作,历任重庆市对外经济贸易委员会副处长,西南技术进出口公司总经理助理,重庆对外经贸委美国公司著名组织长,中国机电产品进出口商会法律部副主任,华能资本服务有限公司总经理工作部副经理,现任长城证券有限责任公司董事会秘书兼纪委书记、党委委员。

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,长城证券有限责任公司首席合规官,现任长城证券有限责任公司副总经理。

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,研究生学历,工商管理硕士。历任司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裁。

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、北方国际信托投资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等职务,现任深圳施得普红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,上海国际集团党委副书记、副董事长、总裁,现任国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长。

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。

刘彩先生,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》造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、资产管理部副经理,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,任会计部经理助理、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,资产管理部高级项目经理(主持工作),现派出担任天津津南村镇银行有限责任公司董事兼副行长。

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运行保障部总经理、综合管理部总经理。

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室负责人,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,长城基金管理有限公司副总经理兼证行保障部总经理兼证行稽核部总经理和综合管理部总经理,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、本基金基金经理简历

杨建华先生,1969年出生,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。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部。2001年10月进入长城基金管理公司基金投资部任基金经理助理;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,自2004年5月21日基金合同生效至今任"长城久泰沪深300指数证券投资基金"基金经理,自2009年9月22日起兼任"长城久富核心成长股票型证券投资基金"基金经理,自2011年1月27日起兼任"长城中小盘成长股票型证券投资基金"基金经理。

3、本基金管理人分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。

二、基金托管人

(一)基金托管人概况

1、基本情况

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

设立日期:1987年4月8日

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本:215.77亿元

法定代表人:傅育宁

行长:马蔚华

资产托管业务批准文号:证监基字【2002】83号

电话:0755—83199084

传真:0755—83195201

资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截止2010年12月31日,招商银行总资产2.403万亿元人民币,核心资本充足率8.04%。

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

招商银行确立"因为市变,先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值,独创"6S托管银行"品牌体系,以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在内审先推出"网上托管银系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现资市市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只T+N"基金专户理财"、第一个长期基资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资服务机构的转变,得到了同业认可,被境内外权威媒体评为"中国最佳托管专业银行""中国资产托管市场创新家户满意首选品牌"6S资产托管综合业务平台荣获"深圳市金融创新奖二等奖第一名"。

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

(二)主要人员情况

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

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

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

夏博辉先生,招商银行资产托管部总经理,厦门大学管理学博士,教授、注册会计师。1992年至1999年历任湖南财经学院会计系副主任、科研处副处长、科研(研究生)处处长,世界银行技术援助中国人民银行会计改革体系项目金融会计准则研究组中方工作组组长(1993-1996),1996年晋升为教授;2000年至2005年6月历任深圳发展银行总行部门总经理、财务执行总监等职;2005年7月,加盟招商银行,同时担任财政部会计准则咨询专家、金融会计组负责人,中国银行业协会托管专业委员会常务副主任、曾获"宝钢优秀教师"(1993)、湖南省普通高校优秀教学成果一等奖(1993)、湖南省第五届优秀社会科学成果二等奖(1999)、中国青年科技论坛二等奖(1999)、深圳市人民政府金融创新二等奖(2009)。

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

(三)基金托管业务经营情况

截至2011年4月30日,招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金(含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金)、招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴业合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金共32只开放式基金及其它托管资产,托管资产为3946.29亿元人民币。

三、相关服务机构

(一)销售机构

1、直销机构

名称:长城基金管理有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址: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

电话:0755-23982338

传真:0755-23982328

联系人:黄全英

客户服务电话:400-8868-666

网站:www.cfund.com.cn

2、代销机构

①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

法定代表人:傅育宁

电话:0755-83198888

传真:0755-83195049

联系人:邓炯鹏

客户服务电话:95555

网站:www.cmbchina.com

②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

联系人:张静

电话:010-66275654

客户服务电话:95533

网站:www.ccb.com

③中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市崇法区复兴路甲23号

法定代表人:项俊波

电话:010-85109219

传真:010-85109219

联系人:蒋浩

客户服务电话:95599

网站:www.abchina.com

④中国银行股份有限公司

地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:肖钢

电话:010-66596688

传真:010-66594946

客户服务电话:95566

公司网址:www.boc.cn

⑤交通银行股份有限公司

注册地址:上海市仙霞路18号

办公地址:上海市银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

电话:021-58781234

传真:021-58408842

联系人:曹辉

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

⑥中国光大银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人:唐双宁

电话:010-68098778

传真:010-68560661

联系人:李伟

客户服务电话:95595

网站:www.cebbank.com

⑦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

办公地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴建

联系人:李远征

电话:010-85238412

传真:010-85238680

网址:www.hxb.com.cn

⑧中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:孔丹

联系人:丰璐

电话:010-65550827

传真:010-65541230

客户服务电话:95558

网站:www.bank.ecitic.com

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

电话:010-58351666

传真:010-83914283

联系人:李群

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

⑩北京银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:阎冰竹

联系人:王曦

电话:010-66223584

传真:010-66226045

客户服务电话:95526

网站:www.bankofbeijing.com.cn

⑪深圳发展银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:肖遂宁

联系人:周勤

电话:0755-82088888转8811

客户服务电话:95501

公司网站:www.sdb.com.cn

⑫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

电话:021-61618888

传真:021-63604199

联系人:徐伟

网址:www.spdb.com.cn

客户服务电话:95528

⑬平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

联系人:霍兆龙

电话:0755-25859591

传真:0755-25879453

网址:www.pingan.com

客户服务电话:4006699999

⑭深圳农村商业银行股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区3038号合作金融大厦

办公地址:深圳市罗湖区3038号合作金融大厦

法定代表人:李伟

联系人:曾明

联系电话:0755-25188371

客服电话:4001961200

公司网站:www.961200.net

⑮中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区深南中路1030号海龙王大厦

法定代表人:王东明

电话:010-84864818-63266

联系人:陈忠

客户服务电话:400-666-5589

网站:www.cs.ecitic.com

⑯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

电话:010-85130577

联系人:权丽

网址:www.csc108.com

客户服务电话:4008888108

⑰海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

电话:021-53594566

联系人:金芸

客户服务电话:95553、4008888001

网站:www.htsec.com

⑱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:上海市延平路135号

法定代表人:祝幼一

联系人:陶毅琪

电话:021-62580818-213

传真:021-62569400

客户服务电话:4008888666

网站:www.gtja.com

⑲东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼21层一29层

法定代表人:王益民

联系人:吴宇

电话:021-50367888

传真:021-50366668

客户服务热线:95503

网站:www.dfzq.com.cn

⑳兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:021-68419974

联系人:谢高得

客户服务热线:4008888123

网站:www.xyzq.com.cn

㉑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

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:0755-33680000、4006666888

网站:www.c168.com.cn

㉒中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:顾伟国

联系人:李洋

电话:010-66568047

客户服务电话:4008-888-8888

网站:www.chinastock.com.cn

㉓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A座38-45层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82960223

传真:0755-82943237

联系人:林生迎

客户服务电话:95565

网站:www.newone.com.cn

㉔华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人:吴万善

电话:025-83290845

联系人:舒萌菲

客户服务电话:95597

网站:www.htsc.com.cn

㉕申安证券有限责任公司

办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人:杨宇翔

联系人:邓舒丽

电话:0755-22626391

传真:0755-82400862

客户服务电话:4008816168

网站:www.pingan.com

㉖郑州证券有限责任公司

注册地址:四川省成都市陕西街239号

办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼

法定代表人:张慎修

联系人:杨沙

电话:0755-83025430

传真:0755-83025991

客户服务电话:4008-888-818

网址:www.hx168.com.cn

㉗中航证券有限公司

注册地址:江西省南昌市象山北路208号

法定代表人:杜航

联系人:余雅娜

电话:0791-6768763

传真:0791-6789414

客服电话:400-8866-567

网站:www.avicsec.com

㉘国盛证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市永叔路15号

办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人:管荣升

联系电话:0791-6285337

联系人:徐美云

网站:www.gsstock.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

法人代表人:何如

联系人:齐晓燕

电话:0755-82133066

传真:0755-82133302

客户服务电话:800-810-8868

公司网址:www.guosen.com.cn

㉚湘海证券股份有限公司

注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人:王春峰

联系人:王兆权

联系电话:022-28451861

传真:022-28451892

客户服务电话:400-651-5988

网站:www.lhzq.com

㉛华泰联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道4011 号香港中旅大厦24、25楼

法定代表人:马昭明

联系人:陶晓芸

电话:0755-82492000

传真:0755-82492062

客户服务电话:95513

网站:www.lhzq.com

㉜广州证券有限责任公司

注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼

法定代表人:吴志明

联系人:林洁茹

电话:020-87322668

传真:020-87325036

客户服务电话:020-961303

网站:www.gzs.com.cn

㉝世纪证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人:卢长才

联系人:张婷

电话:0755-83199511

传真:0755-83199545

客户服务电话:0755-83199599

网站:www.csco.com.cn

㉞齐鲁证券有限责任公司

注册地址:山东省济南市市中区经七路86号

办公地址:山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人:李玮

联系人:吴阳

电话:0531-68889155

传真:0531-68889752

客服电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

㉟申信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层

法定代表人:张智河

联系电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

联系人:吴忠超

公司网址:www.zxwt.com.cn

客户服务电话:0532-96577

㊱万信证券股份有限公司

住所: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

深圳市福田区深南大道2008号中国风凰大厦1栋9层

法定代表人:牛冠兴

联系人:陈剑虹

电话:0755-82825551

传真:0755-82558355

公司网址:www.essence.com.cn

客服热线:4008001001

㊲东海证券有限责任公司

注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址:上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人:朱科敏

电话:021-50586660

传真:021-50586660-8880

联系人:邵一明

客服电话:0519-8166222、0379-64912266

网址:www.longone.com.cn

㊳长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:王明权

电话:021-22169999

传真:021-22169134

联系人:刘晓、李芳芳

客服电话:4008888788、10108998

公司网址:www.ebscn.com

㊴短泰证券有限责任公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人:刘汝军

电话:0471-4913998

传真:0471-4930707

联系人:常向东

客服电话:0471-4961259

网址:www.cnht.com.cn

㊵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

电话:0551-2207114

联系人:程维

客户服务电话:全国统一热线4008888777,安徽省内热线96888

网址:www.gyzq.com.cn

㊶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

电话:021-54033888

传真:021-54035333

客户服务电话:021-962505

网站:www.sw2000.com.cn

㊷中国建银投资证券有限责任公司

注册地址:深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心48-50层

法定代表人:杨小阳

电话:0755-82026521

联系人:刘权

客服电话:400-600-8008

网址:www.cjis.cn

㊸西部证券股份有限公司

注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

办公地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层

法定代表人:刘建武

电话:029-87406172

传真:029-87406387

客服热线:029—87419999

联系人:黄晓军

网址:www.westsecu.com.cn

㊹长江证券股份有限公司

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

客服热线:4008-888-999或95579

网址:www.95579.com

㊺归信证券有限责任公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市锡林南路18 号

法定代表人:孔伯杰

联系人:陈书杉、朱晓光

联系电话:010-88086830-730、010-88086830-737

传真:010-66412537

网址:www.rxzq.com.cn

㊻华宝证券有限责任公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路166号27层

法定代表人:陈林

联系人:楼斯佳

电话:021-50122222

传真:021-50122200

客户服务电话:4008209898

网址:www.cnhbstock.com

㊼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层

法定代表人:常喆

联系人:黄静

联系电话:010-84183389

传真:010-64482090

客户服务电话:400-818-8118

网址:www.guodu.com

㊽民生证券有限责任公司

注册(办公)地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座

法定代表人:岳献春

电话:010-85127622

传真:010-85127917

联系人:赵明

客户服务电话:4006198888

网址:www.mszq.com

㊾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6楼

法人代表:林小明

联系人:王斌

联系电话:0755-33331188-8801

客服电话:4006543218

公司网站:www.tyzq.com.cn

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构,并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。

(二)基金注册登记人

名称:长城基金管理有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址: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

电话:0755-23982338

传真:0755-23982328

联系人:张真珍

客户服务电话:400-8868-666

(三)律师事务所与经办律师

律师事务所名称:北京市金杜律师事务所

注册地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层

负责人:王玲

经办律师:靳庆军、宋萍萍

电话:0755-22163333

传真:0755-22163380

联系人:宋萍萍

(四)会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称:安永华明会计师事务所

注册地址:中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(即东三办公楼)16层

法定代表人:葛明

经办注册会计师:李地、周刚

联系人:李妍明

电话:010-58153000

传真:010-58188298

四、基金的名称

本基金名称:长城久泰沪深300指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

以增强指数化投资方法跟踪目标指数,分享中国经济的长期增长,在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票,包括沪深300指数的成份股(投资组合中持有的沪深300指数成份股的数量不低于240只);因增强性投资而选择的其他投资品种:在不增加额外风险的前提下,还可适当投资一级市场申购的股票(包括新股与增发)以提高收益水平。

本基金债券投资部分主要投资于国债、政策性金融债。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金为增强型指数基金,股票投资以沪深300指数作为目标指数,除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因,本基金将保持相对稳定的股票投资比例,通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术,控制与目标指数的跟踪误差,追求适度超越目标指数的收益。

在正常情况下,本基金投资于股票的比例为基金净资产的90-95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。

2、股票投资策略

①指数化投资

本基金的指数化投资采用分层抽样法,实现对沪深300指数的跟踪,即按照沪深300指数的行业配置比例构建投资组合,投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整,股票投资范围以沪深300指数的成份股为主,少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票,并基于基本面研究进行有限度的优化调整。

非成份股的入选主要基于以下原:①有望入选沪深300指数的准成份股;②少量为提高组合流动性而可能投资的其他品种;③新股配售得到的非成份股,本基金将在新股上市后1个月以内择机卖出此类股票。

成份股出现以下几种情况可剔除:①公司经营状况、财务状况恶化,基本面发生重大变化,导致投资价值严重降低的上市公司;②成份股中流动性太差的个股。

②增强性投资

指数化基础上的增强投资将通过证券选择实现。基金管理小组将对组合品种的流动性和公司基本面进行评估,根据沪深300指数的行业配置情况,采取有限度的增强投资。

①流动性优化

组合品种的流动性评价指标包括:股票的流通市值、股票近半年的累积换手率、单位换手率对应的当日股票价格波动幅度R值。R=|H-L|/VCAP,H为当日最高价,L为当日最低价,V为当日成交量,CAP为流通股本。

要求组合品种的流动性同时达到以下要求:近半年累积换手率居前45,近半年的累积R值居前45,优先选择大市值股票。

②基本面优化

本基金基于对上市公司及行业的基本面分析对指数化投资组合进行优化,具体而言,本基金将提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重:

A. 上市公司基本面较好,具有鲜明的竞争优势,有持续增长能力;
B. 中长期估值水平明显高于目前股价水平,在同行业中,股票相对价格偏低;
C. 预期将纳入持续的指数的个股;
D. 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成份股。

本基金将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重(极端情况下可降低至零):

A. 基本面较差,缺乏核心竞争力,经营业绩下滑;
B. 中长期估值水平明显低于目前股价水平;在同行业中,股票相对价格偏高;
C. 短期内股价涨幅过高,预期短期内股价将大幅回调;
D. 其他特殊个股,例如预期将从指数中剔除的个股等。

3、债券投资策略

本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标,主要投资于到期日一年以内的政府债券等。

九、投资管理基本程序

1、投资决策程序

①投资决策委员会定期(月)召开会议,评价基金净值与比较基准的跟踪误差,并对基金管理小组关于控制跟踪误差的提案做出决议;

②基金管理部基金管理小组利用数量模型,对总体累积偏差和行业偏差进行测算;研究部各行业研究员从基本面对行业、个股和市场走势提出研究报告;运行保障部提供基金申购、赎回的动态情况,供基金管理小组参考;

③基金管理小组根据信息汇总情况对组合进行适度调整,对于需调整的个股,基金经理必须提供充分的理由;

④研究部金融工程小组对基金投资组合跟踪误差进行评估,并作出跟踪误差的归因分析报告,在投资组合的年化总体累积偏差超过2%时提出预警;

⑤监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

2、投资操作程序

①基金管理小组根据沪深300指数的行业构成比例,在设定的偏差范围内定出组合中个股的比例关系,输入交易系统;

②买入股票时,交易员启动组合交易系统,系统按事先设定的个股权重统一下单买入;卖出股票时,系统按事先设定的个股权重统一下单卖出;

③对于需个别调整或组合交易出现困难的个股,基金经理可独立发出指令,交易员可在交易时间内人工操作;

④基金管理小组每日对投资组合的总体累积偏差进行跟踪,若总体累积偏差超过允许范围,通过纠正行业偏差、证券选择偏差,以减少跟踪误差;

⑤本基金在沪深300指数成份股调整信息公告后,研究部金融工程小组将对调整后的沪深