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2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

二〇一一年十二月

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11月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30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：

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

何伟先生，中共党员，硕士研究生。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。现任长城证券有限责任公司总裁。

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，重庆对外经贸美国公司筹备组组长，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。

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。

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。

谭岳衡先生，中共党员，经济学博士。曾任职于国家发展改革委员会，历任南方证券国际部总经理、南方证券咨询公司董事长、南方证券香港公司副董事长，香港江南财务有限公司董事副总经理，招银国际董事副总经理、长城证券公司董事，招商银行董事，招商证券监事长。现任交银国际控股有限公司首席执行官兼副董事长。

熊科金先生，经济学硕士。历任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理，公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人，银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。2011年7月进入长城基金管理有限公司，现任公司董事、总经理。

（2）监事

吴礼信先生，中共党员，会计师，中国注册会计师（非执业）。历任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券有限责任公司，任财务部总经理，现任长城证券有限责任公司财务总监，并担任长城基金管理有限公司监事会主席。

王燕滨先生，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任内蒙银行学校教师，校团委书记，学生科科长，教研室主任，内蒙古证券公司发行部经理，上海业务部总经理，总经理助理，副总经理，海通证券天津、北京营业部总经理，北方信托业务二部总经理，公司总经理助理兼信托业务二部总经理。现任北方信托总经理助理兼资产管理部总经理。

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。

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，综合管理部总经理，现任公司总经理助理兼运行保障部总经理。

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月进入长城基金管理有限公司，现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。

（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。

熊科金先生，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经理，长城基金管理有限公司副总经理兼运行保障部总经理和综合管理部总经理，长城基金管理有限公司副总经理兼市场开发部总经理，现任公司副总经理。

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，公司督察长，现任公司总经理助理兼监察稽核部总经理，并代为履行公司督察长职责。

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，现任公司投资总监、基金管理部总经理。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、本基金管理人公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。
杨建华先生，投资决策委员会执行委员，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2011年6月30日，招商银行总资产2.643万亿元人民币，核心资本充足率7.81%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，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业务资格。

招商银行确立"因势而变、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：在业内率先推出"网上托管银行系统"、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、第一家实现货币市场基金赎回资金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"1+N"基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，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客户满意首选品牌"、"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，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（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顾问委员会成员等；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，及新加坡上市公司嘉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月起兼任招银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永隆银行有限公司董事长，并自2002年7月起担任招商局集团有限公司董事。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。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，大学本科，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

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，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等职务。

（三）基金托管业务经营情况

截至2011年10月31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、长城久泰中信标普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、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、中银上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（QDII-LOF）共40只开放式基金及其它托管资产，托管资产为4430.36亿元人民币。

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：黄念英
客户服务电话：400-8868-666
网站：www.ccfund.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：张建国（代行）
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：北京市海淀区复兴路甲23号
法定代表人：项俊波
电话：010-85109219
传真：010-85109219
联系人：滕涛
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：曹榕
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：黄滨
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：丰靖
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：董云巍
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：张青
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）东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址：东莞市南城路2号
办公地址：东莞市南城路2号
法定代表人：何沛良
联系人：黄飞燕
电话：0769-23394102
传真：0769-22320896
客服电话：0769-961122
网址：www.drcbank.com

（16）中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市湖贝路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

（17）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：权唐
网址：www.csc108.com
客户服务电话：4008888108

（18）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

（19）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：芮敏祺
电话：021-62580818-213
传真：021-62569400
客户服务电话：4008888666
网站：www.gtja.com

（20）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—29层
法定代表人：王益民
联系人：吴宇
电话：021-50367888
传真：021-50366868
客户服务热线：95503
网站：www.dfzq.com.cn

（21）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

（22）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.cc168.com.cn

（23）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

（24）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

（25）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

（26）平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：郑舒丽
电话：0755-22626391
传真：0755-82400862
客户服务电话：4008816168
网站：www.pingan.com

（27）华西证券有限责任公司
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：杨玲
电话：0755-83025430
传真：0755-83025991
客户服务电话：4008-888-818
网址：www.hx168.com.cn

（28）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

（29）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

（30）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

（31）渤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.bhzq.com

（32）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：庞晓芸
电话：0755-82492000
传真：0755-82492062
客户服务电话：95513
网站：www.lhzq.com

（33）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

（34）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

（35）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：李炜
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客服电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

（36）中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

（37）安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号中国凤凰大厦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

（38）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

（39）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：王明权
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨、李芳芳
客服电话：4008888788、10108998
公司网址：www.ebscn.com

（40）恒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

（41）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

（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
电话：021-54033888
传真：021-54035333
客户服务电话：021-962505
网站：www.sw2000.com.cn

（43）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

（44）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
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

（45）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

（46）日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：孔佑杰
联系人：陈韦杉、朱晓光
联系电话：010-88086830-730、010-88086830-737
传真：010-66412537
网址：www.rxzq.com.cn

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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

（51）华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区月坛北街26号
办公地址：北京市西城区金融大街8号中国华融A座3层
法定代表人：丁之锁
联系人：梁宇
联系电话：010-58568007
传真：010-58568062
客服电话：010-58568118
公司网站：www.hrsec.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：010-85188298

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，本基金将保持相对固定的股票投资比例，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因：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（B值），B=（H-L）V/CAP，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4/5，近半年的累积B值居前4/5，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300指数的行业配置比例进行评估，如行业配置比例调整幅度超出允许的范围，本基金将在信息公布后一个月内，对投资组合进行调整；
（6）当发生新股申购和组合品种的增发时，研究部研究策划小组提供拟发行新股企业和增发企业的调研报告；基金管理小组根据调研报告进行新股和增发申购。

十、基金的业绩比较基准

95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率。

十一、投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月24日复核了本投资组合报告内容，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2011年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,470,844,517.92	93.47
	其中：股票	1,470,844,517.92	93.47
2	固定收益投资	799,736.10	0.05
	其中：债券	799,736.10	0.05
	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	99,486,545.91	6.32
6	其他资产	2,538,077.79	0.16
7	合计	1,573,668,877.72	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末指数投资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	6,634,662.12	0.42
B	采掘业	181,320,950.33	11.54
C	制造业	541,876,880.18	34.49
C0	食品、饮料	110,082,050.69	7.01
C1	纺织、服装、皮毛	5,131,815.38	0.33
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	31,141,758.30	1.98
C5	电子	18,034,084.38	1.15
C6	金属、非金属	124,154,952.11	7.90
C7	机械、设备、仪表	177,686,589.40	11.31
C8	医药、生物制品	69,028,118.32	4.39
C99	其他制造业	6,617,511.60	0.42
D	电力、煤气及水的生产和供应业	29,279,989.15	1.86
E	建筑业	41,055,352.00	2.61
F	交通运输、仓储业	54,572,324.28	3.47
G	信息技术业	48,509,467.15	3.09
H	批发和零售贸易	44,574,913.85	2.84
I	金融、保险业	413,525,960.10	26.32
J	房地产业	68,609,563.11	4.37
K	社会服务业	10,499,351.42	0.67
L	传播与文化产业	3,232,973.91	0.21
M	综合类	27,152,130.32	1.73
	合计	1,470,844,517.92	93.63

2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1报告期末指数投资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	600016	民生银行	8,511,174	46,981,680.48	2.99
2	601166	兴业银行	3,101,277	38,424,822.03	2.45
3	600000	浦发银行	4,030,264	34,418,454.56	2.19
4	601318	中国平安	991,661	33,290,059.77	2.12
5	601328	交通银行	6,819,809	30,552,744.32	1.94
6	600030	中信证券	2,326,803	26,176,533.75	1.67
7	601088	中国神华	1,009,596	25,583,162.64	1.63
8	000001	深发展A	1,577,359	25,300,838.36	1.61
9	600519	贵州茅台	130,721	24,914,115.39	1.59
10	000858	五粮液	624,685	22,676,065.50	1.44

3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
4	其中：政策性金融债	–	–
5	企业债券	–	–
6	企业短期融资券	–	–
7	可转债	799,736.10	0.05
8	其他	–	–
9	合计	799,736.10	0.05

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110018	国电转债	8,210	799,736.10	0.05

6、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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

8.1本报告期本基金投资的前十名证券除宜宾五粮液股份有限公司外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

宜宾五粮液股份有限公司于2011年5月28日发布"关于收到中国证监会《行政处罚决定书》的公告"，监管机构认定公司在信息披露方面存在违法事实，并对相关高管人员处以警告和罚款。

鉴于五粮液是本基金跟踪的标的指数沪深300指数的成份股，本基金依据基金合同和五粮液在目标指数中的权重进行了相应的配置。

8.2 本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	760,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	165,166.69
4	应收利息	20,478.82
5	应收申购款	1,592,432.28
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,538,077.79

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

过往一定阶段长城久泰沪深300指数证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较（数据截止日为2011年9月30日）：

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
2004年	-9.20%	0.95%	-11.29%	1.00%	2.09%	-0.05%
2005年	-3.61%	1.23%	-8.25%	1.26%	4.64%	-0.03%
2006年	135.48%	1.30%	114.36%	1.33%	21.12%	-0.03%
2007年	145.02%	2.15%	150.06%	2.17%	-5.04%	-0.02%
2008年	-63.44%	2.88%	-62.58%	2.85%	-0.86%	0.03%
2009年	92.40%	1.94%	89.12%	1.94%	3.28%	0.00%
2010年	-11.05%	1.50%	-10.40%	1.49%	-0.65%	0.01%
2011年1月1日至2011年6月30日	-3.18%	1.16%	-3.20%	1.16%	0.02%	0.00%
基金合同生效至2011年9月30日	205.93%	1.83%	167.78%	1.83%	38.15%	0.00%

注：本基金自基金合同生效日至2011年3月31日以中信标普300指数为跟踪标的指数，自2011年4月1日起所跟踪的标的指数变更为沪深300指数。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

十三、基金的费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）证券交易费用；
（4）基金法定信息披露费用；
（5）基金持有人大会费用；
（6）与基金相关的会计师费和律师费；
（7）按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、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

基金管理费按前一日基金资产净值的0.98%年费率计算。计算方法如下：

H=E×0.98%÷当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的2‰的年费率计提。计算方法如下：

H=E×2‰÷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付指令，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托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（3）上述（一）中（3）至（7）项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

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的费用支出或基金资产的损失，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。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

申购费用由基金申购人承担，归基金管理人及代销机构所有，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。

（1）前端申购费

申购金额（元）	前端申购费率
1,000≤M<100万	1.5%
100万≤M<500万	1.2%
500万≤M<1000万	0.6%
1000万≤M	每笔收取固定费用1000元

申购份额的计算方式：

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额=申购金额/（1+申购费率），对于1000万元（含）以上的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

例：某投资者投资5,000元申购本基金，对应费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.0660元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=5,000/（1+1.5%）=4,926.11元
申购费用=5,000-4,926.11=73.89元
申购份额=4,926.11/1.0660=4,621.12份

即：投资者投资5,000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0660元，则可得到4,621.12份基金单位。

例：某投资者投资100万元申购本基金，若对应费率为1.2%，假设申购当日基金份额净值仍为1.0660元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=1,000,000/（1+1.2%）=988,142.29元
申购费用=1,000,000-988,142.29=11,857.71元
申购份额=988,142.29/1.0660=926,962.75份

即：投资者投资100万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值也是1.066元，则可得到926,962.75份基金单位。

（2）后端申购费

持有基金时间	后端申购费率
1年以内	1.6%
满1年不满2年	1.3%
满2年不满3年	1.0%
满3年不满4年	0.7%
满4年不满5年	0.4%
满5年后	0

注：以上的持有基金的起始时间为投资者申购确认之日。

后端申购费的计算基数为本次要赎回的基金份额在当初购买时所需的申购金额，计算方法为：当初购买本次赎回份额的申购资金总额-申购资金总额/（1+后端申购费率）。

2、赎回费

（1）赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费用由基金赎回人承担。自2004年7月1日起将赎回费用中归入基金资产部分的比例提高到赎回费用总额的25%，其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

（2）基金赎回支付金额的计算

本基金的赎回支付金额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回金额 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额
赎回费用 = 赎回当日基金份额净值×赎回份额×赎回费率
赎回支付金额 = 赎回金额 - 赎回费用

例：某投资者赎回本基金1万份基金份额，赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.066元，则可得到的赎回支付金额为：

赎回金额 = 1.066×10,000 = 10,660
赎回费用 = 1.066×10,000×0.5% = 53.30元
赎回支付金额 = 10660 - 53.30 = 10,606.70元

即：投资者赎回本基金1万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.066元，则其可得到的赎回支付金额为10,606.70元。

3、转换费

（1）基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

①如转入基金的申购费率>转出基金的申购费率
转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值
转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率
转入总金额=转出金额-转出基金赎回费
转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率-转出基金适用申购费率
转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/（1+转入基金申购费补差费率）
转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差
转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值
基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差

例：某投资者持有长城稳健增利债券型证券投资基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为本基金，假设转换当日转出基金（长城稳健增利债券型证券投资基金）份额净值是1.200元，转入基金（本基金）份额净值是1.5800元，转出基金对应赎回费率为0.1%，申购补差费率为0.7%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.2=120,000 元
转出基金赎回费=120,000×0.1%=120元
转入总金额=120,000-120=119,880元
转入基金申购费补差费率=1.5%-0.8%=0.7%
转入基金申购费补差=119,880-119,880/（1+0.7%）=833.33元
转入净金额=119,880-833.33=119,046.67元
转入份额=119,046.67/1.58=75,345.99份
基金转换费=120+833.33=953.33元

②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率
基金转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

例：某投资者持有本基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为长城稳健增利债券型证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金）份额净值是1.5800元，转入基金（长城稳健增利债券型证券投资基金）份额净值是1.200元，转出基金对应赎回费率为0.5%，申购补差费率为0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.58=158,000 元
转出基金赎回费=158,000×0.5%=790元
转入总金额=158,000-790=157,210元
转入基金申购费补差=0
转入净金额=157,210-0=157,210元
转入份额=157,210/1.2=131,008.33份
基金转换费=790+0=790元

（2）对于实行级差申购费率（不同申购金额对应不同申购费率的基金），以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为0。

（3）转出基金赎回费的25%计入转出基金资产。

（4）计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下，调整上述收费方式和费率水平，但最迟应于新收费办法开始实施日前3个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

（三）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》等法律法规及《长城久泰沪深300指数证券投资基金基金合同》的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资管理活动，对2011年7月2日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

1、在第二部分"释义"中，更新了《证券投资基金销售管理办法》颁布、实施的日期。
2、在第三部分"基金管理人"中，更新了基金管理人情况和基金管理人主要人员情况。
3、在第四部分"基金托管人"中，更新了基金托管人的基本情况和基金托管业务经营情况。
4、在第五部分"相关服务机构"中，新增了代销机构东莞农村商业银行、华融证券；更新了部分代销机构的联系信息。
5、在第八部分"基金的投资管理"中，更新了投资组合报告内容，披露截至2011年9月30日的数据。
6、在第九部分"基金的业绩"中，披露了截至2011年9月30日本基金的业绩数据。
7、在第二十一部分"其他应披露的事项"中，披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司
二〇一一年十二月三十日

长城基金关于增加国海证券为旗下开放式基金代销机构并开通定期定额投资及转换业务的公告

根据长城基金管理有限公司（以下简称"长城基金"）与国海证券股份有限公司（以下简称"国海证券"）签署的销售代理主协议及补充协议，从2012年1月4日起，国海证券开始代理销售长城久恒平衡型证券投资基金（前端代码200001）、长城久泰沪深300指数证券投资基金（前端代码200002）、长城货币市场证券投资基金（200003）、长城消费增值股票型证券投资基金（200006）、长城安心回报混合型证券投资基金（200007）、长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）（162006）、长城品牌优选股票型证券投资基金（200008）、长城稳健增利债券型证券投资基金（200009）、长城双动力股票型证券投资基金（200010）、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金（200011）、长城中小盘成长股票型证券投资基金（200012）、长城积极增利债券型证券投资基金（A类份额：200013，C类份额：200113）、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金（162010）。

投资者可在国海证券全国各指定网点办理上述基金的开户、认/申购、赎回等业务，具体办理程序应遵循国海证券相关规定。

长城基金将同时在国海证券开通上述基金的定期定额投资业务（长城久兆中小板300指数分级证券投资基金开放日常申购业务之后方可办理），以及上述基金之间的转换业务（除长城久富核心成长股票型证券投资基金、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金以外），相关费率及业务规则请查阅各基金最新的《招募说明书》、相关公告及长城基金网站。

重要提示：投资人可在国海证券申请开办定期定额投资业务并约定每期固定的投资金额，该投资金额即为申购金额，上述基金每期定期定额申购金额不低于人民币300元(含300元)，并不设金额级差。本业务不受日常申购的最低金额限制。

投资者也可通过以下途径咨询有关详情：

1、国海证券股份有限公司
客服电话：95563
公司网站：www.ghzq.com.cn
2、长城基金管理有限公司
客服电话：400-8868-666
公司网站：www.ccfund.com.cn

特此公告

长城基金管理有限公司
2011年12月30日