# 长安沪深300非周期行业指数证券投资基金更新招募说明书（摘要）

（2013年第1号）

**重要提示**

本基金的募集申请经中国证监会2012年1月30日证监许可[2012]130号文核准。本基金基金合同于2012年6月25日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集，并经中国证监会核准。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做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，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等。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2013年6月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年3月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

基金管理人：长安基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

**一、基金管理人**

（一）基金管理人情况

基金管理人：长安基金管理有限公司

住所： 上海市虹口区丰镇路806号3幢371室

办公地址： 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

法定代表人：万跃楠

成立日期： 2011年9月5日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

及批准设立文号：中国证监会证监许可【2011】1351号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人： 陈楠

电话： 021-20329852

股权结构：

| 股东名称 | 出资比例 |
|---|---|
| 长安国际信托股份有限公司 | 40% |
| 上海美特斯邦威服饰股份有限公司 | 33% |
| 上海磐石投资有限公司 | 18 |
| 兵器装备集团财务有限责任公司 | 9% |
| 合计 | 100% |

（二）主要人员情况

1、董事会成员

万跃楠先生，董事，经济学博士。曾任南昌保险学校教师、中国证监会机构监管部处长、长沙通程实业集团有限公司总裁、特华投资控股有限公司执行总裁、兵器装备集团财务有限责任公司副总经理和安信期货有限责任公司董事长等职，现任长安基金管理有限公司董事长。

柳志伟先生，董事，法学博士。曾任海南省汇通国际信托投资有限公司董事会秘书，长城证券有限责任公司投资银行部总经理，国信证券有限责任公司收购兼并部总经理，新疆汇通集团股份有限公司董事长、总经理，长安国际信托股份有限公司副董事长等职，现任深圳市淳大投资有限公司董事长、上海金融与法律研究院董事长、长安国际信托股份有限公司监事。

王尚钧女士，董事，硕士。曾任上海美特斯邦威服饰股份有限公司总经理助理，现任上海华服投资有限公司总经理助理。

纪艳丽女士，董事，硕士。曾任石家庄轻型汽车厂、河北省汽车集团公司助理工程师，中华企业咨询公司项目经理，清华大学工业工程系教师等职，现任兵器装备集团财务有限责任公司投资业务部总经理、北京中兵保险经纪有限公司执行董事兼总经理。

沈丹义女士，董事，硕士。曾任中国航空技术进出口公司广州分公司总经理助理，招商银行总行风险管理部经理助理，中国银联法律及股权管理部总经理，通联支付网络服务股份有限公司战略总监，上海真爱梦想公益基金会行政总监兼建设总监等职，现任刘鸿儒金融教育基金会秘书长。

黄陈先生，董事，金融学博士。曾任中国工商银行总行政策室、发展规划部、投资银行部等部门主任科员、副处长，工银瑞信基金管理有限公司战略发展部总监，汤森路透中国区投资及咨询业务董事总经理、中国区机构投资者业务负责人等职，现任长安基金管理有限公司总经理，长安财富资产管理有限公司董事长、总经理。

张俊瑞先生，独立董事，经济学博士。曾任陕西财经学院会计系/财会学院、西安交通大学会计学院教授、副院长等职，现任西安交通大学管理学院教授、博士生导师。

李步云先生，独立董事，法学研究生毕业。曾任中国人民解放军四野炮一师二十六团政治处干事，东北军区第二十六陆军医院书记，江苏太仓县人民政府水利局秘书，中国社会科学院荣誉学部委员、博士生导师等职，现任广州大学人权研究中心主任，兼任湖南大学法学院名誉院长。

刘规松先生，独立董事，经济学博士。曾任上海市统计局副主任科员、科长，中国华源集团部门总经理、集团总裁助理等职，现任上海社会科学院经济所研究员、博士生导师。

2、监事会成员

孙广民先生，监事，涉外经济管理本科。曾任中国船舶工业总公司财务局副处长、江南船舶（集团）有限责任公司财务总监、中国船舶工业集团公司财务部副主任、兵器装备集团财务有限责任公司稽核审计部总经理等职，现任兵器装备集团财务有限责任公司投资业务部专务。

吴樱女士，职工监事，上海财经大学金融学研究生，理学学士。曾任江西电力职大助教，亚龙湾开发股份有限公司董事会秘书兼资金证券部经理，海南欣龙无纺股份有限公司董事会秘书，上海君创财经顾问有限公司副总经理，上海鼎立实业投资有限公司副总经理等职。现任长安基金管理有限公司综合管理部总经理。

3、公司高级管理人员

万跃楠先生，董事长，简历同上。

黄陈先生，总经理，简历同上。

张洪水先生，督察长，中国科学院研究生院管理学博士。曾任中央财政金融学院助教，中国长城计算机集团公司职员，中国证监会机构监管部主任科员、副处长，中国证券业协会资格管理部、场外市场委、发展战略委主任等职。

盛军先生，副总经理，硕士。曾任日本大和证券上海代表处首席交易员，华夏证券有限公司高级投资经理，首创证券有限责任公司公司研究员，中邮创业基金管理有限公司策略研究员、中邮核心成长股票基金基金经理助理和基金经理等职。

4、本基金基金经理

王磊先生，吉林大学经济学硕士。曾任中邮创业基金管理有限公司战略发展部副总经理，国金通用基金管理有限公司筹备期研究员，长安基金管理有限公司基金经理助理等职，2012年6月至今任本基金的基金经理。

5、投决策委员会成员

盛军先生，简历同上。

雷宇先生，中国人民大学经济学硕士，十三年证券及相关工作经验。曾任中国技术进出口总公司项目经理、研究员，上海中技投资顾问有限公司研究员、投资经理，通用技术集团投资管理有限公司投资经理、投资部副总监，国金通用基金管理有限公司筹备期基金经理助理、风险管理部负责人，长安基金管理有限公司基金经理助理等职，现任长安基金管理有限公司长安宏观策略股票型基金的基金经理。

王磊先生，简历同上。

府春江先生，上海财经大学经济学硕士，十二年的证券、基金从业经历。曾任元富证券（香港）有限公司上海代表处研究员，金信证券有限责任公司研究员，国金证券研究所宏观分析师，国泰基金管理有限公司宏观策略分析师，国金通用基金管理有限公司筹备期宏观策略分析师，长安基金管理有限公司基金经理助理等职，现任长安基金管理有限公司长安货币市场基金的基金经理。

乔哲先生，山东大学毕业，获工商管理硕士学位，十七年债券及相关金融工作经验。曾任中国农业发展银行山东省分行资金计划处资金科科长，中国农业发展银行总行资金计划部债券发行与资金交易负责人，东亚银行（中国）有限公司资金中心高级助理经理，法国巴黎银行（中国）有限公司固定收益部债务资本市场主管等职，现任长安基金管理有限公司长安货币市场基金的基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、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者实施其他法律行为；

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、基金管理人将遵守《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生。

2、基金管理人承诺防止下列行为的发生：

（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。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

（7）违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露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；

（8）除按基金管理人制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

（9）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（10）违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（11）贬损同行，以抬高自己；

（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13）以不正当手段谋求业务发展；

（14）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（15）其他法律、行政法规禁止的行为。

4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，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）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）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；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）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活动。

5、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、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

（3）不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的目标

（1）保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规定，遵循份额持有人利益最大化原则，自觉形成守法经营、规范运作的意识和理念；

（2）防范和化解经营风险、提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展；

（3）确保基金、公司财务和其它信息真实、准确、完整和及时披露；

（4）确保投资管理活动中公平对待不同投资组合，保护投资者合法权益。

2、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其它资产的运作严格分离；

（4）互制约原则。公司各机构、部门和岗位的设置权责分明、相互制衡；

（5）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、制订内部控制制度的原则

（1）合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律法规、规章和各项规定，必须把国家的法律法规、规章和各项政策体现到内控制度中；

（2）全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

（3）审慎性原则。公司内部控制的核心是风险控制，制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

（4）适时性原则。公司内部控制制度必须随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制的制度体系

公司内部控制的制度体系由内部控制大纲、基本管理制度和部门业务规章三个层次的制度系列构成，这三个不同层次的内部管理制度既相互独立又互相联系，在公司章程的指引和约束下构成了公司总体的内部控制的制度体系。

内部控制大纲是对公司章程的原则规定的细化和展开，同时又是对公司各项基本管理制度的总揽和原则指导。

基本管理制度是依据内部控制大纲对各项业务活动和公司管理的基本规范，涵盖公司各项业务及管理活动的各个方面，为部门管理制度和业务工作手册的制定提供了依据。基本管理制度主要包括风险控制制度、投资管理制度、基金运营制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、行政管理制度、人力资源管理制度、紧急情况处理制度和反洗钱制度。

部门业务规章则直接对员工日常工作进行约束和指导。

三层内部控制制度体系在不同的控制层次上，对公司经营管理活动的决策、执行和监督进行规范，将公司在经营管理活动中可能发生的风险，根据不同的决策层和执行层的权利与责任进行分解，并对决策和执行过程中的风险点和风险因素，通过相应的内部控制制度予以防范和控制，实现公司的合法合规运行，强化公司的内部风险控制，从而维护公司股东和基金份额持有人的利益。

5、内部控制的监控防线

公司依据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的三道监控防线：

（1）建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。明确各岗位职责，并制定详细的岗位说明和业务流程，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担岗位责任；

（2）建立相关部门、相关岗位之间相互监督制衡的第二道监控防线。公司建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

（3）建立以督察长和监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。督察长、监察稽核部独立于其它部门和业务活动，并对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

6、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于风险管理和内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

**二、基金托管人**

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

注册日期：1988 年7月8日

注册资本：154 亿元人民币

托管部门联系人：殷浩然

电话：010—65169776

传真：010—65169564

广发银行股份有限公司成立于1988 年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本154 亿元。二十多年来，广发银行栉风沐雨，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

2006年，广发银行成功重组，引入了花旗集团、中国人寿、国家电网、中信信托等世界一流的知名企业作为战略投资者。重组后，广发银行紧紧围绕“建设一流商业银行”的战略目标，注重战略规划的执行，坚持“调结构、打基础、抓创新、促发展”，强化风险控制，坚持又好又快可持续发展，取得了良好的经营业绩。

2012年末，广发银行资本净额635.28亿元（人民币，下同），资产总额11046.22亿元，本外币各项存款余额8561.66亿元，各项贷款余额6157.50亿元。根据英国《银行家》杂志对全球1000家大银行排定的位次，广发银行已连续多年入选全球银行500强。

2、主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运行团队、监督稽核团队和市场营销团队，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

总经理禄金山先生具有超过二十年的银行从业经历，先后在监管机构和商业银行工作，熟悉我国监管制度和相关行业准则，确保托管业务安全稳健运行。2009年5月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部总经理职务。

3. 基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363 号。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专门设置了监督稽核团队，配备了专职内部监察稽核人员负责托管业务的内部控制和风险管理工作，具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

3、内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

**三、相关服务机构**

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

长安基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

注册地址：上海市虹口区丰镇路806号3幢371室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼

法定代表人：万跃楠

联系电话：021-20329866

传真：021-20329899

联系人：徐东青

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：www.changanfunds.com

2、代销机构

（1）广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：詹全鑫

客服电话：400-830-8003

公司网址：www.cgbchina.com.cn

（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：蒋超良

联系人：滕涛

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

（3）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

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

（4）西安银行股份有限公司

注册地址：陕西省西安市高新区高新路60号

办公地址：陕西省西安市高新区高新路60号

法定代表人：王西省

联系电话：029-88992881

传真：029-88992891

联系人：白智

客服电话：400-869-6779

公司网址：www.96779.com.cn

（5）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

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：陈有安

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

客服电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（6）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

法定代表人：万建华

电话：021-38676161

传真：021-38670161

联系人：芮敏祺

客服电话：400-888-8666

公司网址：www.gtja.com

（7）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

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

（8）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：陈忠

客服电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

（9）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

电话：020-87555888

传真：020-87555305

联系人：黄岚

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

（10）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

客服电话：400-888-8108

传真：010-65182261

公司网址：www.csc108.com

（11）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

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨

客服电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

（12）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

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

电话：021-38565785

联系人：谢尚荣

客服电话：400-888-8123

公司网址：www.xyzq.com.cn

（13）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

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

传真：0755-82943636

客服务电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

（14）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34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

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82558305

传真：0755-8255855

联系人：陈剑虹

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

（15）恒泰证券股份有限公司

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：庞介民

电话：0471-4972343

传真：0471-4961259

联系人：王旭华

客服电话：400-660-9926

公司网址：www.cnht.com.cn

（16）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

（17）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

客服电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（18）华安证券股份有限公司

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

法定代表人：李工

联系电话：0551-5161666

联系人：甘霖

客服电话：400-809-6518

公司网址：www.hazq.com

（19）中信证券（浙江）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19、20层

法定代表人：沈强

电话：0571-87112510

传真：0571-86065161

联系人：丁思聪

客服电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

（20）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

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

联系电话：010-88085201

联系人：李巍

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

（21）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

办公地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路18号

法定代表人：孔佑杰

联系电话：010-83991737

传真：010-66412537

联系人：文思婷

客服电话：400-660-9839

公司网址：www.rxzq.com.cn

（22）齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路86号

办公地址：济南市经七路86号23层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531—68889155

传真：0531—68889752

客户电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（23）万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场 F 栋18、19层

法定代表人：张建军

联系电话：020-38285585

传真：020-22373718-1013

联系人：张士伟

客服电话：400-888-8133

公司网址：www.wlzq.com.cn

(24)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

客服电话：400-6788-887

公司网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

(25)杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系电话：0571-28829790

联系人：周嫣旻

客服电话：400-076-6123

(26)上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

联系电话：021-58870011

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

网址：www.chowbuy.com

（27）上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人：其实

联系电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

客服电话：400-181-8188

公司网址：www.1234567.com.cn

（28）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021—58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

（29）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

联系电话：021-38600735

传真号码：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（30）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区东方路989号中达广场201室

法定代表人：盛大

联系人：程毅

联系电话：021-50583533

传真号码：021-50583633

客服电话：400-005-6355

公司网址：http://leadfund.com.cn/

基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金，并及时公告。

（二）登记机构

长安基金管理有限公司

注册地址：上海市虹口区丰镇路806号3幢371室

办公地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16楼

法定代表人：万跃楠

联系电话：021-20329772

传真：021-20329742

联系人：王峰

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

联系电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京东长安街1号东方广场东2座8层

办公地址：上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼

法定代表人：姚建华

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、钟菊秀

**四、基金的名称**

长安沪深300非周期行业指数证券投资基金。

**五、基金类型**

股票型证券投资基金。

**六、基金的投资目标**

本基金为股票型指数基金，力求通过对沪深300非周期行业指数进行完全复制，在严格控制跟踪误差的基础上，为投资者提供一个投资于沪深300非周期行业指数的有效工具。

**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，包括沪深300非周期行业指数的成分股及其备选成分股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行和增发）、债券、回购、货币市场工具、银行存款、权证、资产支持证券、股指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(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（包括期权等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：沪深300非周期行业指数成分股及其备选成分股的投资比例不低于基金资产的90%,在任何交易日日终持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不超过基金资产净值的100%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证占基金资产净值的比例为0-3%,其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

**八、基金的投资策略**

1、标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深300非周期行业指数。

沪深300非周期行业指数是中证指数有限公司编制的以沪深300指数成分股中的非周期行业股票作为样本，能够较为全面反映沪深两市A股市场非周期行业运行特点。中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

如果沪深300非周期行业指数被停止编制及发布，或沪深300非周期行业指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300非周期行业指数不宜继续作为标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等因素选择确定新的标的指数。本基金由于上述原因变更标的指数，不需召开基金份额持有人大会通过，但应及时通知本基金托管人并报中国证监会备案，并在履行必要手续后，在中国证监会指定的媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。若本基金由于变更投资目标、范围或策略而变更标的指数的，应当召开基金份额持有人大会。

2、投资策略

本基金采用完全复制方法跟踪标的指数，即按照沪深300非周期行业指数的成分股组成及权重构建股票投资组合，进行被动指数化投资。

在建仓期结束后，本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人将发挥专业优势，对投资组合进行适当调整，使跟踪误差控制在限定范围之内。

（1）标的指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成分股及权重的影响，在适当时机、采用适当方法调整投资组合。

（2）成分股发生新增、剔除等定期或临时调整。基金管理人将预测成分股调整方案，并判断指数成分股调整对投资组合的影响，在此基础上制定投资组合调整策略。

（3）沪深300非周期行业指数成分股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将分析这些信息对指数的影响，进而进行投资组合调整分析，确定相应的投资组合调整策略。

（4）基金发生申购赎回、基金分红、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪误差的影响，并相应调整投资组合。

（5）指数成分股的股票停牌、股票流动性不足等其他市场因素的影响，或者法律法规限制等合规因素的影响，使得基金管理人无法依据指数权构成购买某成分股的情形。基金管理人将根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则，采用样本股替代等方式对投资组合进行调整。

为有效控制投资组合对标的指数的跟踪误差，本基金投资股指期货将本着风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的合约。本基金管理人将根据宏观经济因素和资本市场状况，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估，并通过与现货资产进行匹配，选择合适的投资时机，采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

运用股指期货的情形主要包括：对冲系统性风险；对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险；本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整而导致的交易成本和跟踪误差，从而确保投资组合对标的指数的跟踪效果。

3、投资决策依据

以国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定为投资依据，并以维护基金份额持有人利益为最高准则。

4、投资决策原则

（1）合法合规原则。公司各类投资、研究业务应都当严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。

（2）公平交易原则。公司应公平对待不同基金份额持有人、基金份额持有人和其他资产委托人，不得在不同基金财产之间、基金财产和其他委托资产之间直接或通过第三方交易等形式进行利益输送。公司应制定公平交易制度和公平交易规则，明确公平交易的原则和实施措施。

（3）独立性原则。公司基金资产、其他委托资产和固有资产的运作应当严格分离；投资、研究、决策、交易和评估等部门和岗位应当在物理上和制度上隔离。不同的基金要独立运作，分别管理。

（4）相互制约原则。投资业务部门和岗位的设置必须权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点；

（5）严格授权原则。授权制度是投资管理业务控制的核心，必须贯穿于公司投资管理活动的全过程；

（6）研究制约原则。任何基金投资决策都必须建立在有研究支持的基础之上。

5、投资决策流程

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定基金投资的整体投资机会和投资原则；决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

（1）投资部运用数量化模型以及各种风险监控指标，对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算，并提供数量化风险分析报告；研究部对标的指数成分股的基本面和流动性出现变化的企业提供及时的风险分析报告。清算登记部每日提供基金申购赎回的数据分析，供基金经理投资决策参考。

（2）投资决策委员会定期召开会议，依据上述报告对资产配置制定整体投资战略；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

（3）基金经理根据数量风险分析和申购赎回分析报告，在追求跟踪误差最小化的目标下，控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险，降低交易成本。

（4）中央交易室依据基金经理指令，制定交易策略，通过组合交易系统执行指数投资组合的交易。

（5）投资部根据市场变化、定期和不定期地对基金投资业绩进行评估，并提供相关绩效评估报告。

（6）风险管理部根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议。监察稽核部对指数化投资的执行过程进行