（上接B28版）

（39）红塔证券股份有限公司
地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人：况雨林
客服电话：0871-3577946
联系人：高国泽
电话：0871-3577942
（40）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
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20号
法定代表人：杨宝林
联系电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
公司网址：www.zxwt.com.cn
客户咨询电话：95548
（41）大通证券股份有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座－大连期货大厦38、39层
办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座－大连期货大厦38、39层
法定代表人：董永成
客服电话：4008-169-169
网址：www.daton.com.cn
（42）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
联系人：张玉静
联系电话：0755-33227953
传真：0755-82080798
客户服务电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
（43）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：李二朝
联系电话：62020088
客服电话：4008-886-661
传真：62020088-8802
网址：www.myfund.com
（44）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
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
联系人：潘世友
联系电话：021-54509988-7019
客服电话：400-1818-188
传真：021-6485308
网址：www.1234567.com.cn
（45）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
联系人：周嫣受
电话：0571-28829790、021-60897869
客服电话：4000-766-123
传真：0571-26698533
网址：http://www.fund123.cn/
（46）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
联系人：薛年
联系电话：021-58870011-6705
客服电话：400-700-9665
传真：021-68596916
网址：http://www.ehowbuy.com/
（47）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：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人：汪静波
联系人：方凌
联系电话：021-38602377
客服电话：400-821-5399
传真：021-38509777
网址：http://www.noah-fund.com/
（48）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：习甜
联系电话：010-85650920
客服电话：400-920-0022
传真：010-85657357
网址：http://licaike.hexun.com/
（49）浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址：拱墅区湖墅路239号8号楼4楼403室
办公地址：杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区8层
法定代表人：陆彬彬
联系人：鲁盛
联系电话：0571-56028617
客服电话：400-068-0058
传真：0571-56899710
网址：www.jincheng-fund.com???
（50）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：上海东方路989号中达大厦2楼
法定代表人：盛大
联系人：叶志杰
联系电话：021-50583533-3011
客服电话：400-005-6355
传真：021-50583533
网址：www.leadfund.com.cn
基金管理人可根据《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》和本基金基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

（二）基金注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
注册登记业务办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电话：010-59378835
传真：010-59378907
联系人：任瑞新
（三）律师事务所及经办律师
名　称：北京德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
电　话：（010）66575888
传　真：（010）65232181
经办律师：徐建军、李晓明
（四）会计师事务所及经办注册会计师
名　称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
经办注册会计师：许康玮　　吴海霞
联系电话：（021）23238888
传　真：（021）23238800

四、基金的名称
本基金名称：工银瑞信睿智中证500指数分级证券投资基金

五、基金的类型
本基金类型：股票型基金

六、基金的投资目标
采用指数化投资，通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度，实现对标的指数的有效跟踪。通过产品分级设置，为不同份额投资者提供具有差异化收益和风险特征的投资工具。

七、基金的投资范围
本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证500指数的成份股及其备选成份股、首发和增发新股、债券、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为90%-95%，其中标的指数成分股票、备选成分股票占基金资产净值的比例不低于90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。权证及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。

八、基金的投资策略
本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成分股被限制投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金日收益率与业绩比较基准日收益率偏离度的年度平均值不超过0.35%，偏离度年化标准差不超过4%。
1、股票资产指数化投资策略
本基金股票资产投资原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下，本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量。
在特殊情况下，本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换，这些情况包括但不限于以下情形：
（1）法律法规的限制；
（2）标的指数成份股流动性严重不足；
（3）本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；
（4）成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼；
（5）有充分而合理的理由认为其市场价格被操纵等。
进行此等替换遵循的原则如下：
（1）优先考虑用以替换的股票与被替换的股票属于同一行业；
（2）替换后，该成份股票所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重相一致。
（3）用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考查期内日收益率序列风险收益特征高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率波动情况。
2、股票指数化投资日常投资组合管理
（1）标的指数定期调整
根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，减少流动性冲击，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。
（2）成份股公司信息的日常跟踪与分析
跟踪标的指数成份股公司信息（如：股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌等），以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合每日交易策略。
（3）标的指数成份股票临时调整
在标的指数成份股票调整周期内，若出现成份股票临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。
（4）申购赎回情况的跟踪与分析
跟踪本基金申购和赎回信息，结合基金的现金头寸管理，分析其对组合的影响，制定交易策略以应对基金的申购赎回。
（5）跟踪偏离度的监控与管理
每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度，每月末、季度末定期分析基金的实际组合与标的指数表现的累计偏离度、跟踪误差变化情况及其原因，并优化跟踪偏离度管理方案。
3、债券投资策略
本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等期限在一年期以下的债券，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。
4、其他金融工具投资策略
在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具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工具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。

九、基金的业绩比较基准
本基金投资组合的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%＋商业银行税后活期存款利率×5%。
中证500指数是中证指数公司编制并发布的市场指数，它的成份股为?样本空间内股票扣除沪深300指数样本股及最近一年日均总市值排名前300名的股票，剩余股票按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前500名的股票作为中证500指数样本股。中证500指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

十、基金的风险收益特征
本基金属于股票型基金，其风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。此外，本基金作为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，目标为获取市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。
本基金的分级设定则决定了不同份额具有不同的风险和收益特征。睿智A份额具有低风险、低预期收益的特征；睿智B份额具有高风险、高预期收益的特征。

十一、基金投资组合报告
本投资组合报告期为2013年04月1日起至06月30日止（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	92,540,592.73	93.48
	其中：股票	92,540,592.73	93.48
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,184,580.79	6.25
6	其他资产	266,258.02	0.27
7	合计	98,991,431.54	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。
2 报告期末按行业分类的股票投资组合
（1）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,410,288.50	1.45
B	采矿业	1,691,277.30	1.73
C	制造业	49,616,401.86	50.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,045,095.40	4.15
E	建筑业	2,575,673.04	2.64
F	批发和零售业	4,488,762.00	4.60
G	交通运输、仓储和邮政业	2,498,776.00	2.56
H	住宿和餐饮业	77,470.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,563,695.72	4.68
J	金融业	851,296.00	0.87
K	房地产业	7,524,096.39	7.71
L	租赁和商务服务业	1,007,892.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	401,629.36	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	406,152.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,220,803.00	2.28
S	综合	386,918.40	0.40
	合计	83,766,226.97	85.88

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。
（2）报告期末积极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	117,585.00	0.12
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,287,872.79	5.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	286,150.00	0.29
E	建筑业	136,497.00	0.14
F	批发和零售业	513,445.75	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	417,624.22	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,249,417.35	1.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	765,773.65	0.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,774,365.76	9.00

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。
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
（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

代码	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	002230	科大讯飞	20,311	938,368.20	0.96
2	000400	许继电气	24,120	653,169.60	0.67
3	000661	长春高新	6,486	635,044.26	0.65
4	000503	海虹控股	44,400	625,152.00	0.64
5	600200	江苏吴中	38,700	605,268.00	0.62
6	600867	通化东宝	40,060	596,493.40	0.61
7	600436	片仔癀	4,281	585,726.42	0.60
8	000793	华闻传媒	58,300	584,166.00	0.60
9	002456	欧菲光	11,600	552,856.00	0.57
10	000598	兴蓉投资	109,240	525,444.40	0.54

（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

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	002405	四维图新	30,310	423,733.80	0.43
2	002073	软控股份	46,600	390,974.00	0.40
3	000671	阳光城	31,929	378,358.65	0.39
4	601929	吉视传媒	55,300	345,625.00	0.35
5	002273	水晶光电	16,428	302,110.92	0.31

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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
本基金本报告期末未持有债券。
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
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
本基金本报告期末未持有权证。
8 投资组合报告附注

8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	56,294.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	8,151.19
4	应收利息	1,238.61
5	应收申购款	200,573.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	266,258.02

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
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
（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

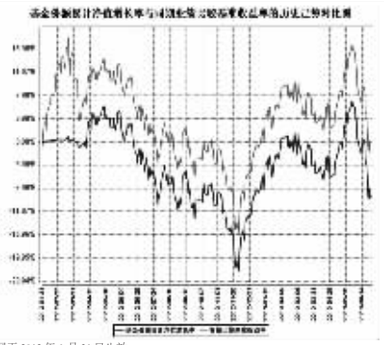
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600436	片仔癀	585,726.42	0.60	重大事项

（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
本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩
基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
1、本基金自同生效日为2012年1月31日，基金合同生效以来（截至2013年6月30日）的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

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
2012.1.31-2012.12.31	-8.18%	1.17%	-0.35%	1.35%	-7.83%	-0.18%
2013.1.1-2013.6.30	-1.40%	1.42%	-1.09%	1.42%	-0.31%	0.00%
自基金合同生效起至今	-9.47%	1.25%	-1.43%	1.37%	-8.04%	-0.12%

2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于2012年1月31日生效。
2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。截至本报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定；本基金投资于股票资产占基金资产净值的比例为90%-95%，其中标的指数成分股票、备选成分股票占基金资产净值的比例不低于90%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。

十三、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）因基金的证券交易或结算而产生的费用；
（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和律师费；
（7）基金资产的资金汇划费用；
（8）基金上市费及年费；
（9）标的指数许可使用费；
（10）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
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
基金管理人的基金管理费按基金财产净值的1.0%年费率计提。
在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：
H＝E×1.0%÷当年天数
H　为每日应计提的基金管理费
E　为前一日基金财产净值
基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
（2）基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.2%年费率计提。
在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.2%÷当年天数
H　为每日应计提的基金托管费
E　为前一日的基金财产净值
基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
（3）基金合同生效后的标的指数许可使用费
在通常情况下，基金标的指数许可使用基点费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：
H＝E×标的指数许可使用基点费年费率÷当年天数，根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数许可使用基点费年费率为0.02%
H　为每日应计提的基金标的指数许可使用基点费
E　为前一日基金资产净值
自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用基点费每日计提，按季支付。基金设立当年，不足3个月的，按照3个月收费。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元，当季标的指数许可使用基点费不足50,000元的，按照50,000元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月的前十个工作日内将上季度标的指数许可使用基点费从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。
（4）本条第1款第(3)至第(9)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。
3、不列入基金费用的项目
本条第1款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。
4、基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。
（二）与基金销售有关的费用
1、申购费用
本基金申购采用金额申购方式，申购费率如下表。投资者在一天之内如果有多笔申购，费率按单笔分别计算。

申购金额M（含申购费）	申购费率
M<100万	1.2%
100万≤M<300万	0.8%
300万≤M<500万	0.4%
500万≤M	按笔收取，1000元/笔

本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
睿智500份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。
申购费用的计算方法：
净申购金额＝申购金额／（1＋申购费率）
申购费用＝申购金额－净申购金额
2、赎回费用
本基金的场内赎回适用固定的赎回费率，定为0.5%。
场外赎回费率按基金份额持有期限递减。从场内转托管至场外的基金份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管日转入确认日开始计算。

连续持有时间（N）	场外赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.2%
N≥2年	0%

（注：1年指365天，2年为730天，依此类推）
赎回费用的计算方法：赎回费用＝赎回份额×赎回受理当日基金份额净值×赎回费率
4、睿智500份额的申购费用由申购人承担，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。
睿智500份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。
5、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调低睿智500份额的申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施3个工作日前在至少一种指定媒体上公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明
本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：
1、　在“二、释义”部分，更新了相关信息。
2、　在“三、基金管理人”部分，更新了董事会成员、监事会成员、高级管理人员、基金经理、投资决策委员会成员的相关信息。
3、　在“四、基金托管人”部分，更新了相关情况。
4、　在“五、相关服务机构”部分，更新了直销机构及代销机构的有关信息。
5、　在“十三、基金的投资”部分，更新了投资组合报告的相关信息。
6、　更新了“十四、基金的业绩”。
7、　在　“二十七、对基金份额持有人的服务”部分，更新了相关信息。
8、　在“二十八、其他应披露事项”部分，增加了本次更新期间本基金的相关公告事项。
上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，投资人欲查询本更新招募说明书正文，可登陆工银瑞信基金管理有限公司网站www.icbccs.com.cn。

工银瑞信基金管理有限公司
二〇一三年九月十三日

（上接B26版）

3. 场内代销机构
本基金办理场内认购业务的代销机构为具有基金代销业务资格的深交所会员。具有中国证监会认定的基金代销业务资格且符合风险控制要求的深交所会员单位可以办理本基金的场内申购业务；具有中国证监会认定的基金代销业务资格的深交所会员单位可以办理本基金的场内赎回业务。
（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：中国北京西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
联系人：朱立元
电话：（010）59378888
传真：（010）66210938
（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师
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
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：吕红
经办律师：吕红、安冬
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办注册会计师：汪棣、张晓艺

七、基金的名称
本基金名称：长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）

八、基金的类型
1、基金的类型：股票型基金。
2、基金的运作方式：上市契约型开放式。
3、基金存续期间：不定期。

九、基金的投资目标
本基金采取指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%，以实现对基准指数的有效跟踪。

八、基金的投资范围
本基金为股票指数型基金，投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产投资比例不低于基金资产净值的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；保持不低于基金资产净值5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略与程序
（一）投资策略
本基金采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%的投资目标。
当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准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，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为3个月，本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。
1、资产配置策略
本基金首先确定基金资产中股票和现金之间的配置比例，再进一步以抽样复制基准指数的方法，确定抽样组合中各行业及个股的配置比例。本基金股票资产不低于基金资产净值的90%，在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。
2、股票组合构建
本基金采用抽样复制基准指数的方法，在综合考虑个股的自由流通市值规模、个股流动性、行业代表性、波动性以及抽样组合与标的指数的相关性等因素的基础上，采用“分层抽样＋优化抽样”的两阶段抽样方法，选择标的指数成份股票或被选成份股票构建基金的抽样股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股配置比例。
（1）股票筛选
本基金在抽样复制指数投资时，首先进行样本成份股初步筛选，通常初步筛选的股票样本为标的指数全部成份股和备选成份股，作为下一步分层抽样的基础。但在特殊情况下，如指数成份股调整、长期停牌或样本个股流动性较差时，则相应调整股票初选股票样本或剔除流动性较差的股票样本。
（2）分层抽样
在初选出的样本股票的基础上，首先按照行业分类方法进行行业类别划分，然后根据每个行业类别在标的指数中的权重、个股在行业类别中的权重、个股收益波动性和所在行业收益相关性进行抽样选取，并优先抽取收益波动与标的指数高度相关的个股。
在分层抽样中，首先控制约束抽样股票组合中的行业权重及收益风险特征代表性与标的指数一致，且控制抽样股票组合中的行业内样本个股与行业整体的收益风险特征高度相关。
（3）优化抽样
对于分层抽样后的股票样本组合，采用进一步优化方法并确定个股的权重，考虑标的指数总体收益和风险的特征情况，通过投资组合优化模型构建基金的股票资产组合，同时保证较小的调整频率和追踪成本。
优化方法是基于样本组合与标的指数的跟踪误差限制，即以跟踪误差最小化为目标函数，并以样本组合内个股集中度，组合资产规模和交易成本为附加约束条件，采用二次规划优化算法和模型，确定抽样组合及组合中个股的权重。
（4）最终组合
对于“分层抽样＋优化抽样”的两阶段抽样方法得到的股票组合，将被用来构建本基金的最终股票组合。由于指数成份股的周期性变动，以及成份股的权重的变化，抽样组合将不定期进行有效跟踪，并进行相应的调整样本组合，即再“分层＋优化”抽样，以保证样本组合与标的指数的跟踪误差最小化。
为了能够更好的跟踪标的指数，如果今后由于基准指数成份股结构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前2个工作日内在至少一种指定媒体上刊登公告，并阐明变更抽样复制方法的原因。
3、股票组合调整
（1）组合调整原则
本基金为抽样复制的指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、配股增发因素等变化，对基金投资组合
进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。
（2）组合调整方法
①跟踪调整
A、定期性调整
本基金所构建的投资组合将主要根据所跟踪的目标指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。
本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合，将每季度末根据上述抽样复制方法调整股票组合及个股配置比例。
B、不定期调整
根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，并根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。
C、基于流动性及法律法规限制的调整
如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素或法律法规规定的投资限制，使得基金管理人无法顺利购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循“同行业基础上价格相关性”原则，对于需要进行替代的股票，其替代股票将从标的指数样本或被选成份股中选取，具体将在考虑股票流动性等因素的前提下，在同行业范围内，选取相关性较大的股票进行替代。
D、在其他不影响指数复制的情况下，本基金管理人可以根据市场情况，在跟踪误差最小化的条件下，对基金资产组合进行适当的调整。
4、债券投资策略
本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。
本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。
5、权证投资策略
在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则对权证进行投资，即根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。
（二）投资决策依据与交易机制
1、投资决策依据
有关法律法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。
2、投资管理体制
本基金管理人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做出有关标的指数重大调整的应对决策、基金组合重大调整的决策，以及其他单项投资的重大决策。基金经理负责做出日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、组合调整等决策。
3、投资管理程序
研究、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合监控与调整各环节的相互协调与配合，构成了本基金的投资管理程序。
（1）研究。基金管理人的研究部依托公司整体研究平台，整合外部信息包括券商等外部研究力量的研究成果，开展标的指数跟踪、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，并撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。
（2）投资决策。基金管理人的投资决策委员会依据研究部提供的研究报告，定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会议，对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策。
（3）组合构建。结合研究报告，基金经理主要采取抽样复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金抽样股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险。
（4）交易执行。基金管理人的交易部负责本基金的具体交易执行，交易部同时履行一线监控的职责。
（5）投资绩效评估。本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，并撰写相关的绩效评估报告，确认基金组合是否实现了投资预期，投资策略是否成功，并对基金组合误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略，如果需要，亦对投资组合进行相应的调整。
（6）组合监控与调整。基金经理根据标的指数的每日变动情况，结合成份股等的基本面情况、流动性状况、基金申赎赎回的现金流量情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合进行动态监控和调整，密切跟踪标的指数。
基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，根据环境的变化和基金实际投资的需要，有权对上述投资程序做出调整，并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

十、基金的业绩比较标准
本基金业绩比较基准＝95%×沪深300指数收益率＋5%×一年期银行定期存款利率