

**长城久兆中小板 300 指数分级证券投资
基金更新的招募说明书摘要
(首次更新)**

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一二年九月

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金经2011年9月15日中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1474号文核准募集。基金合同于2012年1月30日生效。

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《基金法》、《运作办法》、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2012年7月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年6月30日（财务数据未经审计）。

本招募说明书更新情况说明中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人中国建设银行股份有限公司复核。

一、基金管理人

(一) 基金管理人情况

- 1、名称：长城基金管理有限公司
- 2、住所：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 传真：0755-23982328
- 8、联系人：袁柳生

9、管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、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、长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、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、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金和长城保本混合型证券投资基金等十六只基金

- 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%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

(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总裁助理，华富基金管理有限公司（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，重庆对外经贸委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日报社总编辑，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、公司总经理助理，现任公司副总经理。

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总经理，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，武汉大学（武汉测绘科技大学）工学学士，中南财经政法大学经济学硕士。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月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理，现任公司副总经理兼运行保障部总经理。

桑煜先生，长城基金管理有限公司副总经理，简历同上。

车君女士，中共党员，经济学硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。现任公司督察长兼监察稽核部总经理。

2、本基金基金经理简历

余礼冰女士，女，中国籍，华中理工大学工学硕士。曾就职于富国基金、宝盈基金、友邦华泰基金等，2007年加入长城基金管理有限公司，曾任研究部副总经理。2012年1月至2012年4月任“长城久兆中小板300指数分级证券投资基金”基金经理助理，自2012年4月17日至今任“长城久兆中小板300指数分级证券投资基金”基金经理。

“长城久兆中小板300指数分级证券投资基金”历任基金经理如下：2012年1月30日—2012年5月4日，陈硕任基金经理。

3、本公司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，公司总经理助理、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) 基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日，中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。2007 年 9 月 25 日中国建设银行 A 股在上海证券交易所上市并开始交易。A 股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486 股(包括 240,417,319,880 股 H 股及 9,593,657,606 股 A 股)。

截至 2011 年 9 月 30 日，中国建设银行资产总额 117,723.30 亿元，较上年末增长 8.90%。截至 2011 年 9 月 30 日止九个月，中国建设银行实现净利润 1,392.07 亿元，较上年同期增长 25.82%。年化平均资产回报率为 1.64%，年化加权平均净资产收益率为 24.82%。利息净收入 2,230.10 亿元，较上年同期增长 22.41%。净利差为 2.56%，净利息收益率为 2.68%，分别较上年同期提高 0.21 和 0.23 个百分点。手续费及佣金净收入 687.92 亿元，较上年

同期增长 41.31%。

中国建设银行在中国内地设有 1.3 万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在莫斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球 13 个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行 33 家，拥有建行亚洲、建银国际，建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可。2011 年上半年，中国建设银行主要国际排名位次持续上升，先后荣获国内外知名机构授予的 50 多个重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》2011 年“世界银行品牌 500 强”中位列第 10，较去年上升 3 位；在美国《财富》世界 500 强中排名第 108 位，较去年上升 8 位。中国建设银行连续第三年获得香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”，先后摘得《亚洲金融》、《财资》、《欧洲货币》等颁发的“中国最佳银行”、“中国国内最佳银行”与“中国最佳私人银行”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等 12 个职能处室、团队，现有员工 130 余人。自 2008 年以来中国建设银行托管业务持续通过 SAS70 审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 12 月 31 日，中国建设银行已托管 224 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2011 年，中国建设银行以总分第一的成绩被国际权威杂志《全球托管人》评为 2011 年度“中国最佳托管银行”；并获和讯网 2011 年中国“最佳资产托管银行”奖。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 长城基金管理有限公司深圳直销中心

地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

电话：0755-23982244

传真：0755-23982259

联系人：黄念英

(2) 长城基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心大厦 916、917 室

电话：010-88091157

传真：010-88091075

联系人：王玲

(3) 长城基金管理有限公司上海直销中心

地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1804 室

电话：021-51150756

传真：021-51150756

联系人：邱文勋

(4) 网上直销

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理本基金的开户和认购手续，具体交易细则请参阅本公司网站相关信息。

网址：<https://www.ccfund.com.cn/etrading/>

2、场外代销机构

(1) 中国建设银行股份有限公司

住所：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：王洪章

电话：010-66275654

联系人：张静

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(2) 中国银行股份有限公司

住所：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

联系人：宋亚平

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

(3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

联系人：田耕

网址：www.icbc.com.cn

(4) 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

传真：010-85109219

联系人：吴双

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(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) 招商银行股份有限公司

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：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.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) 85237046

传真：(010) 85238680

网址：www.hxb.com.cn

(8) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：宁黎明

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476111

联系人：张萍

联系电话：021-68475888

网址：www.bankofshanghai.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：010-57092615

传真：010-57092611

联系人：董云巍

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

（10）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

公司网站：<http://bank.ecitic.com/>

（11）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：闫冰竹

电话：010-66223584

传真：010-66226045

联系人：王曦

客服电话：95526

网址：www.bankofbeijing.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：芮蕊

电话：0755-25879756

传真：0755-25879196

网址：<http://bank.pingan.com/>

客户服务电话：95511-3

（14）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

联系电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

（15）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000，4006666888

网址：www.cgws.com

（16）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 22-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：95503

网址：www.dfzq.com.cn

（17）广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人：刘东

电话：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

客服电话：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

（18）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 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 层 10 层

法定代表人：常喆

电话：010-84183333

传真：010-84183311

联系人：黄静

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（19）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

法定代表人：曾小普

联系电话：0791-86281305

联系人：陈明

客户服务电话：4008222111

网址：www.gsstock.com

（20）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 层

法定代表人：万建华

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

（21）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 16-26 层

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法人代表人：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.cn

(22) 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

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：4008888001、95553

网站：www.htsec.com

(23) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86868681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

(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：肖亦玲

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

(25) 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

全国统一客户服务热线：4008816168

网址：www.pingan.com

（26）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：汪建熙

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.sywg.com

（27）世纪证券有限责任公司

住所：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

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：方文

客服电话：0755-83199599

网址：www.cscoco.com.cn

（28）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

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

（29）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

网址：www.xyzq.com.cn

（30）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：田徽

电话：(010)66568047

咨询电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（31）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：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

（32）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

开放式基金咨询电话：4008888108

（33）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

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(34) 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

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

(35) 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

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客服电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

(36) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-68816000

传真：021-68815009

联系人：李芳芳

客服电话：10108998、4008888788

公司网址：www.ebscn.com

(37) 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：张同亮

客服电话：0471-4961259

网址：www.cnht.com.cn

（38）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：0551-2257012

传真：0551-2272100

联系人：祝丽萍

客服电话：全国统一热线 4008888777，安徽省内热线 96888

网址：www.gyzq.com.cn

（39）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

（40）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

地址：西安市东大街 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：崔轶梅

网址：www.westsecu.com.cn

(41) 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

(42) 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：袁月

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(43) 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 16-18 座

法定代表人：余政

电话：010-85127622

联系人：赵明

客户服务电话：4006198888

网址：www.msizq.com

(44) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

网站：www.cs.ecitic.com

(45) 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

（46）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

（47）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 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

（48）国海证券股份有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

电话：0755-83702462

传真：0755-83700205

法定代表人：张雅锋

联系人：张亦潇

客服电话：95563

公司网站：www.ghzq.com.cn

（49）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 层、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 层、20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

传真：0571-86065161

客户服务电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

(50) 民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层

法定代表人：赵大建

联系人：赵明

客户服务热线：40088-95618

网址：www.e5618.com

(51) 大同证券经纪有限责任公司

注册地址：山西省大同市大北街13号

办公地址：山西省太原市长治路111号世贸中心A座13层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务热线：400-7121-212

网址：www.dtsbc.com.cn

(52) 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客服电话：400-8888-993

公司网站：www.dxzq.net.cn

(53) 信达证券股份有限公司

注册（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

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

基金管理人可根据业务发展需要，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

3、场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

（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

住所：北京市西城区太平桥大街 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：任瑞新

电话：010-58598835

传真：010-58598907

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京国枫凯文律师事务所

注册地址：北京市西城区金融大街一号 A 座 12 层

负责人：张利国

经办律师：刘洪蛟、胡婷

电话：0755-23993388

传真：0755-86186205

联系人：胡婷

（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：梁成杰、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：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

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

本基金通过投资约束和数量化监控，力求实现对中小板 300（价格）指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。

七、基金的投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、资产支持证券、权证，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90% 的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，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的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

八、基金的投资策略

本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

1. 资产配置策略

为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90% 的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股。本基金将采用完全复制策略，按标的指数成份股及其权重构建股票资产组合。

2. 股票投资策略

本基金通过完全复制策略进行被动式指数化投资，根据中小板 300（价格）指数成份股的基准权重构建股票资产组合，并根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

（1）股票投资组合的构建

本基金将按照中小板 300（价格）指数各成份股的基准权重进行股票资产配置。当遇到成份股停牌、流动性不足、投资限制或其他影响指数复制的市场因素，使基金无法依指数权重购买某成份股或预期将调整的标的指数成份股时，本基金可以根据市场情况，对基金资产进行适当调整，以尽量缩小跟踪误差。

（2）股票投资组合的调整

本基金的股票投资组合将根据中小板 300（价格）指数成份股构成及其权重的变动进行相应的定期调整和日常修正，本基金还将根据投资比例限制、申购赎回变动情况等因素，对股票投资组合进行不定期调整，力争实现跟踪误差最小化。

1) 定期调整

本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。中小板 300 指数的样本股每半年调整一次，每次样本股调整数量不超过样本总数的 10%。样本调整设置缓冲区，排名在样本数 70%范围内的非原成份股按顺序入选，排名在样本数 130%范围内的原成份股按顺序优先保留。

本基金将持续关注中小板 300 指数成份股的变动情况，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，实现指数调整前后基金资产稳定，减小基金资产波动对追踪误差造成的影响。

2) 不定期调整

①当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据其需调整的权重比例，进行相应调整。

②当上市公司股权关系发生变动导致其控股属性发生变化或者指数成份股出现吸收合并等事件时，本基金可根据市场情况，对基金资产进行适当调整，以尽量缩小跟踪误差。

③本基金将根据申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略对股票投资组合进行调整，使基金申购和赎回不会对追踪误差带来重大影响。

④若因个别成份股停牌、流动性不足或法规限制等因素，使得本基金无法按照其所占标的指数权重进行购买时，本基金将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益，部分持有现金或买入相关的替代性组合。

进行股票替换时遵循的原则如下：①用以替换的股票与被替换股票属于同一行业；②用以替换的股票具有较好的流动性；③用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考察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及其波动情况。

3. 债券投资策略

本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，选取流动性较好的债券进行配置。

4. 权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

此外，本基金还将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股）。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

九、基金的业绩比较基准

本基金以中小板 300（价格）指数作为标的指数。

本基金业绩比较基准： $\text{中小板 300(价格) 指数收益率} \times 95\% + \text{活期存款利率(税后)} \times 5\%$

由于本基金为完全复制型指数基金，跟踪标的为中小板 300（价格）指数，同时本基金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%，因此本基金以中小板 300（价格）指数收益率和活期存款利率（税后）的复合收益率作为基金的业绩比较基准符合本基金的特性。

今后，如果指数公司变更或停止中小板 300（价格）指数的编制及发布，或中小板 300（价格）指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致中小板 300（价格）指数不宜继续作为标的指数，或市场有其他更适合投资的指数，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更本基金的标的指数和投资对象，并选择确定新的标的指数，相应变更基金名称、投资范围和业绩比较基准或业绩比较基准的权重构成。本基金由于上述原因变更标的指数和投资对象以及相应变更基金名称、投资范围和业绩比较基准或业绩比较基准的权重构成，不需召开基金持有人大会通过，但须经基金管理人和基金托管人协商一致，并在报中国证监会备案后及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为指数型基金，长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等，为高风险、高收益产品。

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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年8月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，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2012年6月30日止，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	54,580,482.01	91.12
	其中：股票	54,580,482.01	91.12
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	5,145,628.51	8.59
6	其他资产	172,409.97	0.29
7	合计	59,898,520.49	100.00

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	1,563,831.77	2.62
B	采掘业	1,880,286.18	3.16
C	制造业	35,227,157.00	59.11
C0	食品、饮料	3,520,041.10	5.91
C1	纺织、服装、皮毛	1,641,647.17	2.75
C2	木材、家具	141,372.15	0.24
C3	造纸、印刷	798,586.19	1.34
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,539,662.27	9.30
C5	电子	6,460,954.62	10.84
C6	金属、非金属	3,086,962.20	5.18

C7	机械、设备、仪表	8,225,664.17	13.80
C8	医药、生物制品	4,848,766.40	8.14
C99	其他制造业	963,500.73	1.62
D	电力、煤气及水的生产和供应业	411,690.33	0.69
E	建筑业	2,964,788.82	4.98
F	交通运输、仓储业	236,677.98	0.40
G	信息技术业	3,854,167.49	6.47
H	批发和零售贸易	4,476,361.81	7.51
I	金融、保险业	1,327,092.28	2.23
J	房地产业	1,118,731.63	1.88
K	社会服务业	1,183,605.24	1.99
L	传播与文化产业	278,786.62	0.47
M	综合类	57,304.86	0.10
	合计	54,580,482.01	91.59

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

3、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	002024	苏宁电器	319,584	2,681,309.76	4.50
2	002304	洋河股份	16,979	2,284,524.45	3.83
3	002142	宁波银行	87,446	872,711.08	1.46
4	002155	辰州矿业	40,535	784,757.60	1.32
5	002422	科伦药业	16,076	750,106.16	1.26
6	002241	歌尔声学	19,513	712,029.37	1.19
7	002415	海康威视	25,576	695,667.20	1.17
8	002081	金螳螂	17,916	680,808.00	1.14
9	002202	金风科技	101,277	649,185.57	1.09
10	002106	莱宝高科	29,211	586,264.77	0.98

4、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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5、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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

8、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。

9、投资组合报告附注

9.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

9.2 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。

9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	117,765.28
3	应收股利	-
4	应收利息	937.17
5	应收申购款	6,527.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	47,179.93
8	其他	-
9	合计	172,409.97

9.4 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。

9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

9.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

9.5.2 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较（截止 2012 年 6 月 30 日）

时间段	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
基金合同生效日至2012年6月30日	-5.50%	1.11%	6.07%	1.24%	-11.57%	-0.13%

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) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (4) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 基金上市费及年费；
- (9) 标的指数许可使用费；
- (10) 基金收益分配中发生的费用；
- (11) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2. 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3. 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 基金合同生效后的指数使用许可费

本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的《指数使用许可协议》的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。指数使用许可费的计费时间从本基金基金合同生效日开始计算；基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度5万元。

在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。当本基金在某个季度的指数使用许可费不足5万元时，由于指数使用许可费收取下限的存在，本基金在该季度实际的指数使用许可费年费率将高于0.02%。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。

指数使用许可费计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应付的指数使用许可费

E为前一日的基金资产净值

(4) 除管理费、托管费、标的指数使用许可费和前述十七（一）所列之外的基金费用，由基金托管人与基金管理人协商后，根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(二) 与基金销售有关的费用

1. 久兆300份额的申购费用

(1) 申购费率

久兆300份额的申购采用“金额申购”方式。申购费由投资者承担，在申购基金份额时收取，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用，不列入基金财产。投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

	申购金额（含申购费）	申购费率
场外申购费率	50万元以下	1.2%
	50万元(含)－200万元	0.8%
	200万元(含)－500万元	0.4%
	500万元(含)以上	每笔1000元
场内申购费率	由深圳证券交易所会员单位按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率。	

(2) 申购份额的计算

久兆300份额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)

申购金额在 500 万元(含)以上的适用固定金额的申购费, 即净申购金额 = 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 / 申购当日久兆 300 基金份额净值

通过场外方式进行申购的, 申购份额计算结果保留到小数点后 2 位, 小数点后 2 位以后的部分四舍五入, 由此产生的误差计入基金财产; 通过场内方式申购的, 申购份额计算结果保留到整数位, 计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例 1: 某投资者通过场外投资 10 万元申购久兆 300 份额, 申购费率为 1.2%, 假定申购当日久兆 300 份额的基金份额净值为 1.100 元, 则其可得到的申购份额为:

净申购金额 = $100,000 / (1 + 1.2\%) = 98,814.23$ 元

申购费用 = $100,000 - 98,814.23 = 1185.77$ 元

申购份额 = $98,814.23 / 1.100 = 89,831.12$ 份

例 2: 如例 4, 如果该投资者选择通过场内申购, 假定申购费率也为 1.2%, 则因场内份额保留至整数位, 故投资者申购所得份额为 89,831 份, 不足 1 份部分对应的申购资金返还给投资者。计算方法如下:

实际净申购金额 = $89,831 \times 1.100 = 98,814.10$ 元

退款金额 = $100,000 - 98,814.10 - 1185.77 = 0.13$ 元

2. 赎回费用

(1) 赎回费率

久兆 300 份额的申购采用“份额赎回”方式。赎回费由基金份额持有人承担, 在赎回基金份额时收取, 其中 25% 归入基金财产, 其余部分用于支付注册登记费和其他手续费。

	持有年限	赎回费率
场外赎回费率	1 年以内	0.5%
	1 年(含) - 2 年	0.25%
	2 年(含) 以上	0%
场内赎回费率	0.5%	

注: 上表中, 1 年按 365 天计算。

(2) 赎回金额的计算

久兆 300 份额的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中:

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日久兆 300 份额的基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例3:某投资者赎回10万份久兆300份额,持有时间为8个月,对应的赎回费率为0.5%,假设赎回当日久兆300份额的基金份额净值是1.100元,则其可得到的赎回金额为:

$$\text{赎回总金额} = 100,000 \times 1.100 = 110,000 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 110,000 \times 0.5\% = 550 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 110,000 - 550 = 109,450 \text{ 元}$$

3. 转换费用

(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

$$\text{转出金额} = \text{转出基金份额} \times \text{转出基金当日基金份额净值}$$

$$\text{转出基金赎回费} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

$$\text{转入总金额} = \text{转出金额} - \text{转出基金赎回费}$$

$$\text{转入基金申购费补差费率} = \text{转入基金适用申购费率} - \text{转出基金适用申购费率}$$

$$\text{转入基金申购费补差} = \text{转入总金额} - \text{转入总金额} / (1 + \text{转入基金申购费补差费率})$$

$$\text{转入净金额} = \text{转入总金额} - \text{转入基金申购费补差}$$

$$\text{转入份额} = \text{转入净金额} / \text{转入基金当日基金份额净值}$$

$$\text{基金转换费} = \text{转出基金赎回费} + \text{转入基金申购费补差}$$

例4:某基金份额持有人将持有的本基金场外份额10,000份转换为场外长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金份额,持有期满1年(未满2年)。假设转换当日转出基金的份额净值是1.115元,转入基金的份额净值是1.1450元,对应赎回费率为0.25%,申购费补差费率为0.3%,则可得到的转换份额及转换费用计算如下:

$$\text{转出金额} = 100,000 \times 1.115 = 111,500 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金赎回费} = 111,500 \times 0.25\% = 278.75 \text{ 元}$$

$$\text{转入总金额} = 111,500 - 278.75 = 111,221.25 \text{ 元}$$

$$\text{转入基金申购费补差} = 111,221.25 - 111,221.25 / (1 + 0.3\%) = 332.67 \text{ 元}$$

$$\text{转入净金额} = 111,221.25 - 332.67 = 110,888.58 \text{ 元}$$

$$\text{转入份额} = 110,888.58 / 1.1450 = 96,845.92 \text{ 份}$$

$$\text{基金转换费} = 278.75 + 332.67 = 611.42 \text{ 元}$$

②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

$$\text{基金转换费用} = \text{转出金额} \times \text{转出基金赎回费率}$$

例5：某基金份额持有人将持有的场外长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF) 10,000份基金份额转换为本基金场外份额，持有期满1年（未满2年）。假设转换当日转出基金的份额净值是1.2150元，转入基金的份额净值是1.155元，对应赎回费率为0.25%，申购费补差费率为0，则可得到的转换份额及转换费用计算如下：

$$\text{转出金额} = 10,000 \times 1.2150 = 12,150 \text{元}$$

$$\text{转出基金赎回费} = 12,150 \times 0.25\% = 30.38 \text{元}$$

$$\text{转入总金额} = 12,150 - 30.38 = 12,119.62 \text{元}$$

$$\text{转入基金申购费补差} = 0$$

$$\text{转入净金额} = 12,119.62 - 0 = 12,119.62 \text{元}$$

$$\text{转入份额} = 12,119.62 / 1.155 = 10,493.17 \text{份}$$

$$\text{基金转换费用} = 12,150 \times 0.25\% = 30.38 \text{元}$$

(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。

(三)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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(四)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(五)基金税收

基金和基金份额持有人根据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《长城久兆中小板300指数分级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12月12日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”中，调整了风险提示的相关内容；更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。
- 2、在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人情况及主要人员情况。
- 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、主要人员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，更新了代销机构信息和注册登记机构、经办律师、经办注册会计师信息。
- 5、将原七、八部分合并为现在的第七部分“基金的募集与基金合同的生效”，并删除了基金合同生效前适用的内容。
- 6、在第八部分“久兆 300 份额的申购与赎回”中，更新了基金转换和定期定额投资的内容。
- 7、在第九部分“久兆稳健份额与久兆积极份额的上市交易”中，更新了上市交易的时间，删除了上市交易前适用的内容。
- 8、在第十二部分“基金的投资管理”中，增加了投资组合报告内容，披露截至 2012 年 6 月 30 日的数据。
- 9、增加了第十三部分“基金的业绩”数据，披露了截至 2012 年 6 月 30 日本基金的业绩数据。
- 10、在第十七部分“基金的费用与税收”中，增加了与基金销售有关的费用的内容。
- 11、在第二十五部分“基金托管协议的内容摘要”中，更新了基金托管人的法定代表人信息。
- 12、增加了第二十七部分“其他应披露的事项”，并披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司

二〇一二年九月十一日