

# 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

## 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 2017 年 6 月 25 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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：2.7 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：吴昱

电话：021-20329896

股权结构：

股东名称 出资比例

长安国际信托股份有限公司 29.63%

上海景林投资发展有限公司 25.93%  
上海恒嘉美联发展有限公司 24.44%  
五星控股集团有限公司 13.33%  
兵器装备集团财务有限责任公司 6.67%  
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、长安财富资产管理有限公司董事。

崔进才先生，董事，经济学硕士。曾任中信银行（原中信实业银行）总行部门副总经理、部门总经理等职，中信资产管理有限公司公司董事、副总经理，现任长安国际信托股份有限公司公司总经理，西安国家航空产业基金投资管理有限公司董事。

高斌先生，董事，硕士。曾任中国证监会市场监管部主任科员、副处长、处长，中国证监会驻深圳证券交易所督察员，中国证券登记结算公司总经理助理、党委委员、常务副总经理，期间兼任中国证券登记结算公司上海分公司总经理。现任上海景林投资发展有限公司总裁。

范欢欢女士，董事，管理学学士。曾任上海景林投资发展有限公司市场营销部产品经理、投资研究部研究助理、总裁办投后管理等岗位，现任上海景林投资发展有限公司总裁办高级经理。

李莉女士，董事，经济学硕士、工商管理硕士。曾任中国招商银行总行离岸业务部经理、同业机构部高级经理，美国 PIMCO 总部香港公司副总裁，现任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理，上海正阳国际经贸有限公司董事长、法人代表，兴业银行股份有限公司监事，通联网络支付股份有限公司监事。

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。

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。

田轩先生，独立董事，金融学博士。曾任印第安纳大学凯利商学院助理教授、副教授，现任清华大学五道口金融学院教授、保利能源控股有限公司独立董事。

傅蔚冈先生，独立董事，法学博士。曾任上海金融与法律研究院院长助理，现任上海金融与法律研究院执行院长，北京刘鸿儒金融教育基金会副秘书长。

### 2、监事会成员

印凤女士，监事，工商管理硕士。曾任长安汽车销售有限公司经营部财会处处长、长安汽车股份有限公司财务部财务处处长、长安福特汽车有限公司财务总监、长安标致雪铁龙汽车有限公司财务总监、兵器装备集团财务有限责任公司综合管理部总经理等职，现任兵器装备集团财务有限责任公司总经理助理、党委委员。

吴缨女士，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。

李永波先生，督察长。武汉大学法学学士、民商法学硕士，十年以上法律及基金从业经历。曾任上海市源泰律师事务所律师、上海市通力律师事务所律师，上海市律师协会基金业务委员会委员，长安基金管理有限公司监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理等职。

王健先生，副总经理。工商管理博士，十三年基金行业从业经历。曾任长信基金管理有限责任公司市场开发部总监，金元比联基金管理有限公司渠道销售部总监，长安基金管理有限公司市场总监等职。

#### 4、本基金基金经理

林忠晶先生，经济学博士，七年以上金融行业从业经历。曾任安信期货有限责任公司高级分析师，中海石油气电集团有限责任公司贸易部研究员，长安基金管理有限公司产品经理、战略及产品部副总经理等职，现任长安基金管理有限公司量化投资部（筹）总经理，长安沪深 300 非周期行业指数证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金及长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

黄陈先生，简历同上。

陈立秋先生，工商管理硕士及工学硕士学位，十一年以上金融行业从业经历。曾任 BluePoolCapital 投资经理，江海证券有限公司研究主管等，人保资产管理有限公司高级投资经理，上海知几资产管理有限公司投资总监，鸿商资本股权投资有限公司董事总经理（期间委派至旗下控股的中法人寿保险有限责任公司担任投资总监）等职。现任长安基金管理有限公司投资总监、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金及长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

乔哲先生，山东大学毕业，获工商管理硕士学位，二十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联席投资总监、长安货币市场证券投资基金、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金的基金经理。

林忠晶先生，简历同上。

栾绍菲先生，澳大利亚悉尼大学毕业，获金融与经济学硕士学位，六年以上金融行业从业经历。曾任长安基金管理有限公司研究部研究员、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证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

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

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；
- (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营成本，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：杨明生

成立时间：1988 年 7 月 8 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：154 亿人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363 号

联系人：周小磊

联系电话：(010) 65169562

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。

经中国银行业监督管理委员会批复同意（银监复 2016[232]号文），广发银行主要股东中国人寿保险股份有限公司已于 2016 年 8 月 29 日完成与 CITIGROUPINC.（花旗集团）及 IBM CREDITLLC（IBM 信贷）的股份转让交易。目前，中国人寿持有广发银行约 67.29 亿股，持股比例 43.686%，为广发银行单一最大股东。截至 2016 年 12 月 31 日，广发银行总资产 20475.92 亿元、总负债 19416.18 亿元、实现营业收入 553.18 亿元、拨备前利润 364.43 亿元。据英国《银行家》杂志 2016 年全球银行排名，广发银行按一级资本列第 86 位。

#### 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，内设业务运行处、监控管理处、期货业务处和产品营销处，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。

部门负责人蒋柯先生，经济学硕士，高级经济师，从事托管工作十七年，托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、全球资产托管处副处长、全球资产托管处副处长（主持工作）等职务。曾被中国证券业协会聘任为证券投资基金估值工作小组组长。2015 年 1 月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理，现主持部门工作。

#### 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。截至 2016 年 12 月末，托管资产规模 20,429.55 亿元。建立了一只优秀、专业的托管业务团队，保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线，产品

涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、QDII 托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等，能为托管产品提供全面的托管服务。

## （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，专设监控管理处，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，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，基金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。

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的托管业务综合系统基金监督子系统，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 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：吴昱

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](http://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

客服电话：400-830-8003

公司网址：[www.cgbchina.com.cn](http://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：周慕冰

客服电话:95599

公司网址:[www.abchina.com](http://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

客服电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://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

客服电话：400-869-6779

公司网址：[www.96779.com.cn](http://www.96779.com.cn)

### (5) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客服电话：95528

网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

### (6) 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

客服电话：400-888-8888

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)



(7) 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

客服电话: 400-888-8666

公司网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(8) 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

客服电话: 95553

公司网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(9) 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

客服电话: 95558

公司网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(10) 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

客服电话: 95575

公司网址: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(11) 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: 王常青

公司网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(12) 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: 薛峰

客服电话: 95525

公司网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(13) 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

客服电话: 400-888-8123

公司网址: [www.xyjq.com.cn](http://www.xyjq.com.cn)

(14) 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

客服电话:95565

公司网址:[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(15) 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

客服电话:400-800-1001

公司网址:[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(16) 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

客服电话:400-660-9926

公司网址:[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(17) 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

客服电话:400-800-8899

公司网址:[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(18) 中信证券(山东)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

客服电话:0532-96577

公司网址:[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(19) 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

客服电话:400-809-6518

公司网址:[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(20) 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

客服电话:400-660-9839

公司网址:[www.rxzq.com.cn](http://www.rxzq.com.cn)

(21) 中泰证券股份有限公司

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

客户电话:95538

公司网址:[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(22) 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

客服电话：400-888-8133

公司网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

(23) 华泰证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人：俞洋

客服电话：400-109-9918

网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(24) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

客服电话：400-809-6096

公司网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

(25) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人：俞洋

客服电话：400-109-9918

网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(26) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

客服电话：95563

公司网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

(27) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

公司网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(28) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：许建平

客服电话：400-800-0562

公司网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(29) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服电话：400-160-0109

公司网址：[www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

(30) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：中国武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

客服电话：400-800-5000

公司网站：[www.tfzq.com](http://www.tfzq.com)

(31) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

公司网站：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

(32) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

法定代表人：董祥

客服电话：95563

公司网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

(33) 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 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(34) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

客服电话：400-990-8826

公司网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(35) 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

客服电话：400-6788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(36) 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

客服电话：400-076-6123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(37) 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

客服电话：400-700-9665

公司网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(38) 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

客服电话：400-181-8188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(39) 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

客服电话：400-089-1289

公司网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(40) 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：中国上海杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(41) 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

客服电话：400-005-6355

公司网址：<http://leadfund.com.cn/>

(42) 一路财富(北京)信息科技股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

法定代表人：吴雪秀

客服电话：4000011566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(43) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：400-920-0022、021-20835588

网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(44) 中期时代基金销售(北京)有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 2 层

法定代表人：路瑶

客服热线：95162、4008888160

公司网址：[www.CIFCOFUND.com](http://www.CIFCOFUND.com)

(45) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人:赵荣春

客服热线:400-678-5095

公司网址: [www.niuji.net](http://www.niuji.net)

(46) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室

办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人:凌顺平

客服电话:4008-773-772

公司网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(47) 中国国际期货有限公司

注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人:王兵

客服电话:95162、400-8888-160

网址: [www.cifco.net](http://www.cifco.net)

(48) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室

法定代表人:王翔

客服电话:021-65370077

网站: [www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(49) 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

客服电话:400-888-6661

公司网址: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(50) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人:董浩

客服电话:010-56409010

公司网站: [www.jimufund.com](http://www.jimufund.com)

(51) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层

法定代表人:冯修敏

客服电话:400-820-2819

公司网站: [www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

(52) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人:郭坚

客服电话:400-821-9031

公司网站: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(53) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际大厦南塔12楼

法定代表人: 肖雯

客服电话: 020-89629066

公司网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(54) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#

法定代表人: 杨懿

客服电话: 400-166-1188

公司网站: <http://8.jrj.com.cn/>

(55) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址: 南京市建邺区江东中路359号国睿大厦1号楼B区4楼A506室

办公地址: 上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人: 袁顾明

客服电话: 400-928-2266

公司网站: [www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(56) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市南山区智慧广场第A栋11层1101-02

办公地址: 深圳市南山区科苑路东方科技大厦18F

法定代表人: 陈姚坚

客服电话: 400-9500-888

公司网址: [www.jfzinv.com/](http://www.jfzinv.com/)

(57) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

法定代表人: 齐小贺

客服电话: 0755-83999907

公司网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(58) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京海淀区中关村大街11号11层1108号

法定代表人: 王伟刚

客服电话: 400-619-9059

公司网址: [www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

(59) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址: 上海市黄浦区西藏南路765路602-115室

法定代表人: 陈继武

客服电话: 4006-433-389

公司网址: [www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(60) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 上海自由贸易实验区富特北路277号3层310室

法定代表人: 燕斌

客服电话: 4000-466-788

公司网址: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(61) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室

法定代表人: 李锐

客服电话: 4007868868

公司网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(62) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人: 王廷富

客服电话: 400-821-0203

(63) 北京增财基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人: 罗细安

客服电话: 400-001-8811

公司网址: <http://www.zengcaiwan.com/>

(64) 上海大智慧财富管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人: 申健

客服电话: 021-20219931

公司网址: [8.gw.com.cn](http://8.gw.com.cn)

(65) 上海爱建财富管理有限公司

注册地址: 上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

法定代表人: 马金

客服电话: 021-64393653

公司网址: <http://www.ajcf.com.cn>

(66) 上海中正达广投资管理有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人: 黄欣

客服电话: 400-6767-523

公司网址: <http://www.zzwealth.cn/>

(67) 乾道金融信息服务(北京)有限公司

注册地址: 北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302

法定代表人: 王兴吉

客服电话: 010-66250542

公司网址: [www.qiandaoholdings.com](http://www.qiandaoholdings.com)

(67) 上海华信证券有限责任公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人: 郭林

客服电话: 021-38784818

公司网址: <http://www.shhxzq.com>

(68) 平安证券有限责任公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

客服电话: 95511

公司网址: <http://stock.pingan.com/beta/index.shtml>



(69) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：徐黎云

客服电话：4000680058

公司网址：<http://www.jincheng-fund.com/>

(70) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

客服电话：4008188866

公司网址：<http://www.shengshiview.com.cn/>

(71) 弈丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

法定代表人：TANYIKKUAN

客服电话：4006840500

公司网址：<https://www.ifastps.com.cn/fe/b2b#/home>

(72) 和谐保险销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302

法定代表人：蒋洪

客服电话：95569

公司网址：<http://www.hx-sales.com/>

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：021-20329771

传真：021-20329742

联系人：欧鹏

(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：邹俊

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：张楠、黄小熠

#### 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合规监控。基金经理依据申购赎回和成份股停牌等情况，对投资组合进行监控和调整、控制投资组合的流动性风险。

#### 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为 95%沪深 300 非周期行业指数收益率+5%活期存款利率（税后）。

本基金追求对标的指数成份股的充分投资，股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，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%，因此采用该加权复合方法构建以上业绩比较基准。

如果沪深 300 非周期行业指数被停止编制及发布、被其他指数替代、指数编制方法出现重大变更等原因导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，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，对本基金的业绩比较基准进行调整。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，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的指数的，相应变更业绩比较基准应当召开基金份额持有人大会。

#### 十、风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

#### 十一、基金投资组合报告

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。基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。本报告中财务资料未经审计。本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 2017 年 3 月 31 日止。

#### 1、报告期末基金资产组合情况金额单位：人民币元

序号 资产类别 市值（元） 占总资产的比例（%）

1 股票 279,736,446.01 91.48

2 基金 0

3 债券 0

4 其中：央票 0

5 国债 0

6 政策性金融债 0

7 金融债（商业银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券） 0

8 企业债 0

9 企业短期融资券 0

10 可转债 0

11 权证 0

12 资产支持证券 0

13 货币市场工具（票据、CD） 0

14 现金（银行存款及清算备付金） 25,278,786.60 8.27

15 银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单） 0

16 其他资产（交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等） 772,110.06 0.25

17 其中：买入返售证券 0

18 资产合计 305,787,342.67 100.00

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:金额单位:人民币元

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	1,303,807.10	0.43
B 采矿业	—	—
C 制造业	168,809,777.26	55.92
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,710,370.32	5.20
E 建筑业	27,177,517.22	9.00
F 批发和零售业	12,799,540.89	4.24
G 交通运输、仓储和邮政业	—	—
H 住宿和餐饮业	199,272.00	0.07
I 信息传输、软件和信息技术服务业	32,344,109.35	10.71
J 金融业	—	—
K 房地产业	—	—
L 租赁和商务服务业	6,342,637.91	2.10
M 科学研究和技术服务业	—	—
N 水利、环境和公共设施管理业	4,296,180.48	1.42
O 居民服务、修理和其他服务业	—	—
P 教育	—	—
Q 卫生和社会工作	763,488.88	0.25
R 文化、体育和娱乐业	7,402,620.78	2.45
S 综合	2,433,607.81	0.81
合计	279,582,930.00	92.61

(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	—	—
B 采矿业	—	—
C 制造业	63,882.77	0.02
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E 建筑业	15,545.24	0.01
F 批发和零售业	74,088.00	0.02
G 交通运输、仓储和邮政业	—	—
H 住宿和餐饮业	—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J 金融业	—	—
K 房地产业	—	—
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 153,516.01 0.05

### 3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### (1)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

金额单位：人民币元

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	600519	贵州茅台	28,996	11,202,894.56	3.71
2	000651	格力电器	276,733	8,772,436.10	2.91
3	000333	美的集团	261,312	8,701,689.60	2.88
4	601668	中国建筑	882,060	8,114,952.00	2.69
5	600887	伊利股份	348,130	6,583,138.30	2.18
6	600104	上汽集团	236,547	6,003,562.86	1.99
7	601766	中国中车	568,918	5,825,720.32	1.93
8	600900	长江电力	387,107	5,136,909.89	1.70
9	000725	京东方 A	1,472,743	5,066,235.92	1.68
10	000858	五粮液	105,605	4,541,015.00	1.50

#### (2)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	601366	利群股份	8,400	74,088.00	0.02
2	002851	麦格米特	784	48,490.40	0.02
3	603388	元成股份	554	15,545.24	0.01
4	002860	星帅尔	777	15,392.37	0.01
1	601366	利群股份	8,400	74,088.00	0.02

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未进行股指期货交易。

### 9 投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2)报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	9,908.31
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	713,368.74
5	应收申购款	48,833.01
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	772,110.06

(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无处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

期末积极投资前五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 601366 利群股份 74,088.00 0.025 网下新股流通受限

2 002860 星帅尔 15,392.37 0.005 网下新股流通受限

(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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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、本基金合同生效日为2012年6月25日，基金业绩截止日为2017年3月31日：

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 --

2012.6.25-2012.12.31 1.20% 0.86% -5.42% 1.11% 6.62% -0.25%

2013.1.1-2013.12.31 4.05% 1.20% 4.52% 1.21% -0.47% -0.01%

2014.1.1-2014.12.31 24.78% 1.05% 27.22% 1.07% -2.44% -0.02%

2015.1.1-2015.12.31 18.14% 2.60% 21.24% 2.53% -3.10% 0.07%

2016.1.1-2016.12.31 -5.67% 1.48% -12.07% 1.49% 6.40% -0.01%

从成立至 2017.3.31 55.22% 1.58% 42.30% 1.59% 12.92% -0.01%

注：本基金整体业绩比较基准构成为：沪深300非周期行业指数收益率95%+活期存款利率（税后）5%

## 2、自基金合同生效以来基金份额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：本基金基金合同生效日为 2012 年 6 月 25 日，图示日期为 2012 年 6 月 25 日至 2017 年 3 月 31 日。

### 十三、基金的费用与税收

#### 一、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### 二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \times \text{当年天数}$$

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款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 3、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费

标的指数许可使用费即标的指数许可使用基点费，标的指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算；标的指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.02%/年，标的指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。

在通常情况下，标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

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

H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值



标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，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，于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用基点费。基金具体核算方法遵循监管部门有关规定。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述一、基金费用的种类中第3—9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

#### （一）重要提示部分

更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日期信息。

#### （二）第三部分基金管理人部分

更新了基金管理人主要人员情况。

#### （三）第四部分基金托管人部分

更新了基金托管人基本情况。

#### （四）第五部分相关服务机构部分

更新了代销机构方面信息。

#### （五）第八部分基金份额的申购与赎回

更新了申购与赎回的数量限制。

#### （六）第九部分基金的投资部分

更新了基金投资组合报告，报告期自2016年10月1日起至2017年3月31日止。

#### （七）第十部分基金的业绩部分

更新了基金投资组合报告，报告期截止2017年3月31日止。

#### （八）第二十一部分对基金份额持有人的服务

更新了网络在线服务。

#### （九）第二十二部分其他应披露事项部分

更新了2016年12月26日至2017年6月25日期间涉及本基金的相关公告。

长安基金管理有限公司

2017年7月29日