

# 长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书摘要

2012 年第 2 号

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇一二年九月

## 重要提示

长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）由久富证券投资基金转型而成。依据中国证监会2007年2月1日证监基金字[2007]25号文核准的久富证券投资基金基金份额持有人大会决议，久富证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）”。自2007年2月12日起，由《久富证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

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》、《长城久富核心成长股票型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2012年8月11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）。本招募说明书更新已经本基金托管人交通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、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和长城久兆中小板 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。

### (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、北方国际信托投资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。历任中国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

杨建华，男，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。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳市和君创业投资公司、长城证

券有限责任公司。2001年进入长城基金管理有限公司，曾任基金经理助理，现任公司投资总监、基金管理部总经理，自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，自2004年5月21日起任“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日起兼任本基金的基金经理，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。

长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）（原“久富证券投资基金”转型）历任基金经理如下：许良胜先生自2001年12月18日该基金基金合同生效日起至2005年3月25日任该基金基金经理；项志群先生自2005年3月26日起至2008年2月4日任该基金基金经理；徐九龙先生自2008年2月5日至2009年3月4日担任该基金基金经理；李硕先生自2008年2月5日至2009年3月4日担任该基金基金经理；韩刚自2009年1月6日至2009年9月21日担任该基金基金经理。

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

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路188号

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：618.85亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：张咏东

电话：021-32169999

## 2、发展概况

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市，是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志（The Asset）“2010年全球最佳交易银行评选”中，交通银行荣膺“最佳次托管银行”大奖。英国《银行家》杂志2011年公布的全球1000家银行排名，交通银行以343.21亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行50强。截至2012年3月31日，交通银行资产总额达到人民币4.88万亿元，实现净利润人民币158.80亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

### （二）基金托管人主要人员情况

牛锡明先生，交通银行行长，哈尔滨工业大学经济学硕士，高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

钱文挥先生，交通银行副行长，上海财经大学工商管理硕士。2004年10月起任交通银行副行长，2007年8月起任交通银行执行董事。

刘树军先生，交通银行资产托管部总经理。管理学硕士，高级经济师。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书，农行总行信贷部工业信贷处处长，农行总行托管部及养老中心副总经理，交通银行内蒙古分行副行长。2011年10月起任交通银行资产托管部副总经理，2012年5月起任交通银行资产托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截止2012年二季度末，交通银行共托管证券投资基金64只，包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票（LOF）、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合（LOF）、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、



汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利、融通行行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国指数、博时深证基本面200ETF、博时深证基本面200ETF联接、建信信用增强债券、富安达优势成长股票、工银主题策略股票、汇丰晋信货币、农银汇理中证500指数、建信深证100指数、富安达策略精选混合、金鹰中证500指数分级、工银瑞信纯债定期开放债券。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品，托管资产规模超过一万亿元。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1. 直销机构：

名称：长城基金管理有限公司

住所：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

成立时间：2001 年 12 月 27 日

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. 场外代销机构：

(1) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

传真：021-58408483

联系人：曹榕

网站：www.bankcomm.com

(2) 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

联系人：王隼

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

网址：www.icbc.com.cn

(3) 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：王洪章

联系人：张静

电话：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(4) 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：蒋超良

电话：010-85109219

传真：010-85109219

联系人：吴双

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

(5) 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

(6) 中国银行股份有限公司

注册地址：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 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖钢

联系人：宋亚平

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(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

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(8) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：021-62677777

传真：021-62569070

联系人：苏健

客户服务电话：95561

网站：www.cib.com.cn

(9) 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

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560661

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

(10) 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

(11) 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：www.htsc.com.cn

(12) 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

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网址: [www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

(13) 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](http://www.spdb.com.cn)

客户服务电话: 95528

(14) 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

(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: 何茂才

电话: 0769-23394102

传真: 0769-22320896

客服电话: 0769-961122

网址: [www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(20) 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

(21) 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

(22) 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

办公地址：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

(23) 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](http://www.gzs.com.cn)

(24) 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: 95553、4008888001

网站: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(25) 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](http://www.avicsec.com)

(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

客户服务热线: 4008816168

网址: [www.pingan.com](http://www.pingan.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.csc.com.cn

(28) 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：021-54038844

客服电话：021-962505

网址：www.sywg.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：400888123

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：田薇

电话：010-66568047

传真：010-66568990

客户服务电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

(31) 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

客户服务电话：400888108

(32) 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

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82960141

客户服务热线：95565

网址：www.newone.com.cn

(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

公司网址：www.zxwt.com.cn

客户咨询电话：0532-96577

(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

公司网址：www.essence.com.cn

客服热线：4008001001

(36) 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

(37) 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：400888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(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) 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

（40）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

（41）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

（42）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

(43) 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：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

(44) 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

(45) 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

(46) 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.msza.com

(47) 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](http://www.cs.ecitic.com)

（48）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](http://www.tyzq.com.cn)

（49）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：张有德

电话：0755-83025046

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

公司网站：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

（50）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](http://www.hrsec.com.cn)

（51）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

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

### 3. 场内代销机构：

指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.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) 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、冯艾  
电话：0755-22163333  
传真：0755-22163380

联系人：冯艾

### **(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：长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）

#### **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**

投资于具有核心竞争力的企业，分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益，力争为基金持有人实现稳定的超额回报。

#### **七、基金的投资范围**

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票、债券、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基金总资产 60%—95%，债券占基金总资产 0%—35%，权证投资占基金资产净值 0%—3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金股票资产中，不低于 80%的资金将投资于具有核心成长优势的上市公司发行的股票。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。

#### **八、基金的投资策略**

##### **1、资产配置策略**

本基金为主动型股票基金，对于股票、债券、现金及其他金融产品等大类资产的配置策略，主次分明，以股票为主。基于对各类资产风险收益水平的分析，结合主要投资对象一具备核心竞争力上市公司持续成长能力及估值水平，参考基金流动性要求，在重点投资于具备持续成长能力与获取超额利润能力的优势企业的前提下实现大类资产配置，以求基金资产在股票、债券及短期金融工具的投资中实现风险和收益的最佳匹配。

## **2、股票投资策略**

本基金的股票投资策略将立足于公司的估值体系，在平衡市场总体估值水平的基础上，将重点投资于具备核心竞争力的持续成长性企业，强调对公司核心竞争力的判断，及核心竞争力所拥有的超额收益能力的评估。同时适度兼顾因行业发展、重组购并等要素的变化而导致的估值调整所带来的阶段性机会；对于新经济、新业务模式等创新型公司依据供求关系、市场地位、发展前景给予一定估值弹性；对于主题类资产则重点把握市场心理与企业重估的实质性基础。股票组合构建所追求的目标是双高：高 $\alpha$ 、高夏普比率。

## **3、基金操作策略**

本基金的操作策略核心有二，一是保持组合获得超额收益的能力，主要在于股票类资产的操作倾向于长、中、短期类目标的处理，其中长期类资产依据估值水平的变化调整权重，而中、短期类资产的选择是为了发掘新的长期投资目标。二是降低组合的风险系数，保持组合均衡，主要通过行业配置、主题配置、持股集中度的调整以及均值偏离度的评估等操作来保持组合的均衡，降低组合的风险。

## **4、债券及短期金融工具投资策略**

本基金认为股票市场投资风险较大时，将择机把部分股票资产转换为债券资产以获取较稳定的收益。由于目前中国债券市场仍处于制度完善与规则建立的发展阶段，本基金采取组合久期控制下的主动性投资策略，结合收益率曲线选择有利投资品种，构建债券投资组合，并综合运用久期控制、期限结构配置、跨市场套利、相对价值判断和信用风险评估等管理手段实现债券组合的动态优化调整。

## **5、衍生金融工具套利和风险锁定策略**

本基金在进行权证等金融工具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。对于其他金融衍生产品则以控制风险为目标，作为主动型基金将始终保持较高的股票投资仓位，金融衍生产品将会是本基金锁定风险的工具，但不作为投资目标。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数收益率+25%×中信全债指数收益率。

## 十、基金的风险收益特征

本基金是较高预期收益较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

## 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。

本基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于2012年7月18日复核了投资组合报告，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，本报告中财务资料未经审计。

### 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	1,679,967,872.51	78.18
	其中：股票	1,679,967,872.51	78.18
2	固定收益投资	100,440,000.00	4.67
	其中：债券	100,440,000.00	4.67
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	80,000,320.00	3.72
	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	265,709,671.21	12.37
6	其他资产	22,767,171.00	1.06
7	合计	2,148,885,034.72	100.00

### 2、报告期末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	采掘业	730,500.00	0.03
C	制造业	1,397,944,943.85	65.29
C0	食品、饮料	726,657,678.80	33.94
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	11,157,232.40	0.52
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	660,130,032.65	30.83
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,706,430.80	0.27
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	195,740,397.86	9.14
I	金融、保险业	54,888,000.00	2.56
J	房地产业	24,957,600.00	1.17
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,679,967,872.51	78.46

### 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

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	000568	泸州老窖	4,200,000	177,702,000.00	8.30
2	600519	贵州茅台	680,000	162,622,000.00	7.60
3	000513	丽珠集团	4,830,286	134,233,647.94	6.27
4	000858	五粮液	4,000,414	131,053,562.64	6.12
5	600079	人福医药	4,000,000	92,760,000.00	4.33
6	600887	伊利股份	3,345,000	68,840,100.00	3.22
7	000028	国药一致	2,000,000	59,560,000.00	2.78
8	000869	张裕A	824,428	55,451,027.28	2.59
9	601318	中国平安	1,200,000	54,888,000.00	2.56
10	600557	康缘药业	3,600,000	53,208,000.00	2.49

### 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	100,440,000.00	4.69
	其中：政策性金融债	100,440,000.00	4.69
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	100,440,000.00	4.69

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	120218	12 国开 18	1,000,000	100,440,000.00	4.69
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

（1）本报告期内本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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	20,621,520.71
3	应收股利	51,488.55
4	应收利息	804,117.68
5	应收申购款	290,044.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,767,171.00

（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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

(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富核心成长股票型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
原封闭式基金成立以来至2007年2月9日	172.70%	2.54%	-	-	-	-
2007年2月12日至 2007年12月31日	97.03%	1.82%	64.84%	1.58%	32.19%	0.24%
2008年1月1日至 2008年12月31日	-44.82%	1.90%	-53.36%	2.28%	8.54%	-0.38%
2009年1月1日至 2009年12月31日	74.35%	1.77%	67.87%	1.54%	6.48%	0.23%
2010年1月1日至 2010年12月31日	2.65%	1.47%	-8.57%	1.19%	11.22%	0.28%
2011年1月1日至12月 31日	-22.94%	1.13%	-18.35%	0.98%	-4.59%	0.15%
2012年1月1日至2012 年6月30日	7.77%	1.35%	4.62%	1.00%	3.15%	0.35%
2007年2月12日(基金 转型日)至 2012年6月30日	61.58%	1.62%	11.83%	1.57%	49.75%	0.05%

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) 基金的证券交易费用；
- (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) 按照国家有关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

本基金的管理费率为 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

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，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首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费率为 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第（一）款第（3）至第（7）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

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率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

#### (二) 与基金销售有关的费用

##### 1、场内的申购与赎回费用

##### (1) 申购费用

本基金的申购费率最高不超过 1.5%，随申购金额的增加而递减。申购费用在申购时收取并由申购人承担，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

场内申购金额（M，含申购费）	申购费率
M<50 万元	1.5%
50 万元≤M<200 万元	1.0%
200 万元≤M<500 万元	0.5%
M≥500 万元	每笔 1000 元

##### (2) 赎回费用

本基金的赎回费用在投资人赎回基金份额时收取，所收取的赎回费 25% 归入基金财产，其余的用于支付注册登记费及其他必要的手续费。本基金的场内赎回费率统一为 0.5%。

(3) 基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费用和赎回费用标准，调整后的申购费用和赎回费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更，基金管理人最迟应于新的费用标准实施日前 3 日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

##### 2、场内基金申购份额、赎回金额的计算方式

本基金根据基金份额净值计算申购份额和赎回金额。

##### (1) 基金申购份额的计算方法：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购手续费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

场内申购份额保留到整数位，不足 1 份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某投资人投资 10 万元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.016 元，则



其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.016 = 96,970.64 \text{ 份}$$

因场内份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 96,970 份，不足 1 份部分对应的申购资金返还给投资者。

$$\text{实际净申购金额} = 96,970 \times 1.016 = 98,521.52 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 100,000 - 98,521.52 - 1,477.83 = 0.65 \text{ 元}$$

(2) 基金赎回金额的计算方法：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回手续费} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回手续费}$$

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份基金份额，持有时间为 10 个月，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.0250 = 10,250 \text{ 元}$$

$$\text{赎回手续费} = 10,250 \times 0.5\% = 51.25 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,250 - 51.25 = 10,198.75 \text{ 元}$$

即投资人赎回 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则可得到 10,198.75 元净赎回金额。

### 3、场外的申购与赎回费用

(1) 申购费率

本基金的申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减，具体费率如下所示：

申购金额(M, 含申购费)	申购费率
M < 50 万元	1.5%
50 ≤ M < 200 万元	1.0%
200 ≤ M < 500 万元	0.5%
M ≥ 500 万元	每笔收取 1000 元

申购费由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

## (2) 赎回费率

场外赎回费率根据投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

持有期限(N)	赎回费率
N<1年	0.5%
1年≤N<2年	0.25%
N≥2年	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用的75%用于注册登记费及相关手续费等，25%归入基金财产。

(3) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，经相关监管部门核准，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 4、场外基金申购份额、赎回金额的计算方式

### (1) 基金申购份额的计算

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购手续费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

申购份额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资人投资10万元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为1.016元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.016 = 96,970.64 \text{ 份}$$

### (2) 基金赎回金额的计算

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回手续费} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回手续费}$$

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资人赎回本基金 10,000 份基金份额，持有时间为 1 年半，适用的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值为 1.025 元，则：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.025 = 10,250 \text{ 元}$$

$$\text{赎回手续费} = 10,250 \times 0.25\% = 25.63 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,250 - 25.63 = 10,224.37 \text{ 元}$$

即投资者赎回 10,000 份基金份额，可得到 10,224.37 元赎回金额。

## 5、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。

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：某基金份额持有人将持有的长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金场外份额 10,000 份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 1.155 元，转入基金的份额净值是 1.215 元，对应赎回费率为 0.25%，申购补差费率为 0.3%，则可得到的转换份额计算如下：

$$\text{转出金额} = 10,000 \times 1.155 = 11,550 \text{ 元}$$

$$\text{转出基金赎回费} = 11,550 \times 0.25\% = 28.88 \text{ 元}$$

$$\text{转入总金额} = 11,550 - 28.88 = 11,521.12 \text{ 元}$$

$$\text{转入基金申购费补差} = 11,521.12 - 11,521.12 / (1 + 0.3\%) = 34.46 \text{ 元}$$

$$\text{转入净金额} = 11,521.12 - 34.46 = 11,486.66 \text{ 元}$$

$$\text{转入份额} = 11,486.66 / 1.215 = 9,454.04 \text{ 份}$$

基金转换费用=28.88+34.46=63.34 元

即：该基金份额持有人完成本次转换后，可得到本基金场外份额 9,454.04 份。

②如转出基金的申购费率 $\geq$ 转入基金的申购费率

基金转换费用=转出金额 $\times$ 转出基金赎回费率

例：某基金份额持有人将持有的本基金场外份额 10,000 份转换为长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金场外份额，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 1.215 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计算如下：

转出金额=10,000 $\times$ 1.215=12,150 元

转出基金赎回费=12,150 $\times$ 0.25%=30.38 元

转入总金额=12,150-30.38=12,119.62 元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=12,119.62-0=12,119.62 元

转入份额=12,119.62/1.155=10,493.17 份

基金转换费用=12,150 $\times$ 0.25%=30.38 元

即：该基金份额持有人完成本次转换后，可得到长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金场外份额 10,493.17 份。

(2) 转出基金赎回费的 25% 计入转出基金资产。

(3) 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，但最迟应在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （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》、《证券投资基金信息披露管理办

法》等法律法规及《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)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2012年3月26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、在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人的基本情况及主要人员情况。

2、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。

3、在第五部分“相关服务机构”中，更新了代销机构信息、注册登记机构信息和经办律师信息。

4、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了基金的转换与定期定额投资的内容。

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2012年6月30日的数据。

6、在第九部分“基金的业绩”中，披露了截至2012年6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  
二〇一二年九月二十四日