长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金

更新的招募说明书摘要

基金管理人：长城基金管理有限公司　　基金托管人：招商银行股份有限公司

长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金经中国证监会证监基金字【2004】51 号文批准发起设立。本基金合同于 2004 年 5 月 21 日正式生效。

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《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》、《长城久泰中信标普 300 指数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。

本基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险；

本招募说明书所载内容截止日为 2006 年 11 月 21 日，有关财务数据截止日为 2006 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）；

本基金托管人招商银行股份有限公司于 2006 年 12 月 19 日复核了本次招募说明书更新。

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：深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

3、办公地址：深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 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：0755–83662688

8、传真：0755–83662600

9、联系人：王大治

10、客户服务中心电话：400–8868–666、0755–83680399

11、注册资本：10000 万元

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	40%
西北证券有限责任公司	15%
东方证券股份有限公司	15%
中原信托投资有限公司	15%
北方国际信托投资股份有限公司	15%
合计	100%

13、本基金管理人长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2001]55 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、西北证券有限责任公司、中原信托投资有限公司以及北方国际信托投资股份有限公司共同发起设立，于 2001 年 12 月 27 日正式开业，注册资本为 1 亿元人民币。

公司在董事会下设了风险控制与审计委员会、资格审查与薪酬委员会，公司内设投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制与审计委员会负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。资格审查与薪酬委员会负责公司董事、监事、高级管理人员及相关人员的资格审查，董事、监事的提名和公司薪酬体系审订，对公司高级管理人员及其他相关人员进行考核、评价及奖惩。

公司下设十一个部门，分别是：基金管理部、市场开发部、固定收益部、创新业务部、北京管理总部、上海管理总部、深圳管理总部、监察稽核部、运行保障部、信息技术部、综合管理部。公司现有员工 62 人，62%以上具有研究生以上学历，大部分同时具有理工科及经济类专业背景，主要业务人员均具有 5 年以上证券或基金从业经历。所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

公司已经建立健全了内部风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理制度、人事管理制度、基金会计制度、信息披露制度等公司管理制度。

（二）主要人员情况

1、公司董事、监事及高管人员介绍

(1)公司董事

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。

邹平先生，博士研究生毕业，管理学博士，高级经济师。历任湖南省进出口总公司部门经理、中国宝安集团分公司副总经理、大鹏证券有限责任公司首席分析师、金元证券有限责任公司研究所所长，现任长城证券有限责任公司总裁助理。

龙熙霖先生，硕士研究生毕业，经济师。历任长城证券有限责任公司海口营业部总经理助理、总经理，公司经纪业务管理总部副总经理、资产管理总部总经理助理、证券投资部总经理，现任长城证券有限责任公司投资总监。

吕莉女士，中共党员，高级经济师。历任宁夏证券公司副总经理、总经理、董事长，西北证券有限责任公司董事长、监事长。

贺若先先生，中共党员，博士研究生毕业。历任国家财政部世界银行司科长，新城建设股份有限公司部门主任，光大证券有限责任公司投资银行总部副总经理、北方研究部总经理、资产经营部副总经理，东方证券股份有限公司办公室副主任兼战略办主任、总裁助理兼人力资源管理总部总经理、总裁助理兼资产管理业务总部总经理，现任东方证券股份有限公司总裁助理兼购并业务总部总经理。

崔泽军先生，中共党员，硕士研究生毕业，高级会计师。历任中原信托投资有限公司财务部副经理、经理、公司副总经理，现任中原信托投资有限公司总经理。

陆妍，女，1965 年生，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，现任北方国际信托投资股份有限公司证券管理总部总经理。

任俊杰先生，大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融机构同业协会首任秘书长、赛格投资有限公司（香港注册）董事总经理、祥安证券有限公司（香港联交所会员）董事、中国投资环境协会副理事长，现任深圳怀新企业投资顾问有限公司副总经理。

马原女士，中共党员，研究生毕业。历任最高人民法院法官、副庭长、庭长、副院长，中国女法官协会会长，人民大学兼职教授。

麦建光先生，香港注册会计师，英国特许公认会计师公会资深会员、香港会计师公会资深会员。历任安达信深圳、广州分公司主管合伙人，安达信国际组织合伙人，现任华隽创业投资管理（深圳）有限公司董事总经理。

刘杉，男，1964 年生，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早报社总编辑。现任职于中华工商时报社，曾任总编辑助理，现任副总编辑，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。

关林戈先生，中共党员，经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任，中共天津市委领导同志秘书，南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理，长城证券有限责任公司总裁助理，长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，现任长城基金管理有限公司总经理。

（2）公司监事

阮争先生，大学本科毕业。历任黄河证券有限责任公司发行部经理，港澳信托投资有限公司信托基金部投资经理，中国电力信托投资有限公司投资基金部经理，现任中原信托投资有限公司投资管理部经理，并担任长城基金管理有限公司监事。

杨传益女士，会计师。历任伊斯兰国际信托投资公司计划财务部经理兼证券交易营业部主任，宁夏证券登记公司经理，宁夏证券财务总监兼财务部经理，西北证券有限责任公司总裁助理。

罗世容女士，大学本科毕业，会计师。历任四川轻工厅盐业学校财经教研室主任，海南信托投资公司证券部主办会计，长城证券总部财务主管、长城证券总部深圳二部财务部经理，长城证券有限责任公司成都营业部副总经理兼财务部经理、深圳一部副总经理兼财务部经理、公司审计部总经理、公司审计监控部总经理，现任长城证券有限责任公司财务部副总经理。

张建辉先生，中共党员，硕士研究生毕业。历任上海浦东发展银行信托证券发行部科员，东方证券股份有限公司经济业务管理总部辽宁管理总部副总经理、总经理，现任东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理。

田德良，男，1966 年生，2005 年毕业于中央广播电视大学会计学专业，经济师。曾任职于中国建设银行天津开发区分行，任经理助理、事后总稽核。现任职于北方国际信托投资股份有限公司，曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部经理、监察稽核部副经理、项目评估部项目经理、业务发展总部客户经理，现任自营业务总部项目经理。

李建中先生，研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资金计划部总经理、资产监理部总经理，长城基金管理有限公司董事会秘书、运行保障部经理、综合管理部经理、长城基金管理有限公司督察长。

（3）公司高级管理人员

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。

关林戈先生，中共党员，经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任，中共天津市委领导同志秘书，南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理，长城证券有限责任公司总裁助理，长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，现任长城基金管理有限公司董事、总经理。

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经理，现任长城基金管理有限公司副总经理兼综合管理部经理。

汪钦先生，中共党员，博士研究生毕业。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处，海南港澳国际信托投资公司证券部，历任三亚东方实业股份有限公司副总经理，国信证券有限责任公司研究所所长，长城基金管理有限公司总经理助理，并先后兼任研究策划部经理、市场开发部经理，现任长城基金管理有限公司副总经理兼市场开发部经理。

韩浩先生，硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部总经理，长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理部经理、“久嘉证券投资基金”基金经理、总经理助理、“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理，现任长城基金管理有限公司副总经理、投资总监兼基金管理部经理。

2、本基金基金经理简历

杨建华先生，37 岁，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。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部，2001 年 10 月进入长城基金管理公司基金投资部任基金经理助理，自 2004 年 5 月 21 日基金成立至今任“长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金”基金经理，具有 7 年证券从业经历。

3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

关林戈先生，投资决策委员会主席，公司董事、总经理。

韩浩先生，投资决策委员会执行委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部经理。

汪钦先生，投资决策委员会委员，公司副总经理兼市场开发部经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、概况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称招商银行）

设立日期：1987 年 4 月 8 日

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

注册资本：122.79 亿元

法定代表人：秦晓

行长：马蔚华

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】83 号

电话：0755—83195226

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：姜然

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月同时采用中国公认会计准则和国际财务报告准则成功发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上海证券交易所挂牌交易（股票代码：600036）。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），9 月 27 日行使 10%的 H 股超额配售权后，共发行了 24.2 亿 H 股。目前，招商银行总资产逾 8000 亿元，在英国《银行家》杂志“世界 1000 家大银行”的最新排名中，资产总额位居 114 位。

经过 19 年的发展，招商银行已从当初偏居深圳蛇口一隅的区域性小银行，发展成为了一家具有一定规模与实力的全国性商业银行，初步形成了立足深圳、辐射全国、面向海外的机构体系和业务网络。目前在境内 30 多个大中城市、香港设有分行，网点总数 400 多家，在美国设立了代表处，并与世界 80 多个国家和地区的 1100 多家银行建立了代理行关系。

19 年来，招商银行以敢为天下先的勇气，不断开拓，锐意创新，在革新金融产品与服务方面创造了数十个第一，较好地适应了市场和客户不断变化的需求，被广大客户和社会公众称誉为国内创新能力强、服务好、技术领先的银行。为中国银行业的改革和发展作出了有益的探索，同时也取得了良好的经营业绩。根据 2006 年半年度报告，招商银行人均效益、股本回报率等重要经营指标位居国内银行业前列。近年来，招商银行连续被境内外媒体授予“中国本土最佳商业银行”、“中国最受尊敬企业”、“中国十佳上市公司”等多项殊荣。

招商银行坚持“科技兴行”的发展战略，立足于市场和客户需求，充分发挥拥有全行统一的电子化平台的巨大优势，率先开发了一系列高技术含量的金融产品与金融服务，打造了“一卡通”、“一网通”、“金葵花理财”、“点金理财”、招商银行信用卡、“财富账户”等知名金融品牌，树立了技术领先型银行的社会形象。招商银行于 1995 年 7 月推出的银行卡——“一卡通”，被誉为我国银行业在个人理财方面的一个创举；截至 06 年 6 月，累计发卡量已近 4000 万张，卡均存款余额逾 5000 元，居全国银行卡前列。1999 年 9 月在国内首家全面启动的网上银行——“一网通”，无论是在技术性能还是在业务量方面在国内同业中都始终处于领先地位。2003 年 6 月，“一网通”作为中国电子商务和网上银行的代表，登上了被誉为国际信息技术应用领域奥斯卡的 CHP 大奖的领奖台，这是中国企业首次获此殊荣。2002 年 12 月，招商银行在国内率先推出一卡双币国际标准信用卡，目前发卡量已突破 500 万张，占有了国内双币种信用卡市场超过 30%的份额，成为国内最大的国际标准信用卡发卡行。

招商银行秉承“因您而变”的经营理念，在国内业界率先通过各种方式改善客户服务，致力于为客户提供高效、便利、体贴、温馨的服务，带动了国内银行业服务观念和方式的变革，拉近了银行与客户的距离。招商银行在国内率先构筑了网上银行、电话银行、手机银行、自助银行等电子服务网络，为客户提供“3A”式现代金融服务。根据市场细分理论，招商银行在继续做好大众服务的同时，致力于为高端客户提供量身定制的“一对一”的尊贵服务，不断提高金融服务的专业化、个性化水平。2004 年 8 月，招行又率先在国内建立了“客户满意度指标体系”，为管理质量和服务质量的持续提升提供了有力保障。

在稳健快速的发展中，招商银行坚持“效益、质量、规模协调发展”的战略指导思想，大力营造以风险文化为主要内容的管理文化，规范化的经营管理为国内外监管机构的一致公认。在国内同业中，招商银行较早地实行了资产负债比例管理、审贷分离和贷款五级分类制度，建立了比较完善的稽核内控体系，同时成功地在全行推行了储蓄、会计业务质量认证，获得了英国 BSI 太平洋有限公司和中国船级社质量认证公司颁发的 ISO9001 质量体系认证书，成为中国国内第一家获得 ISO9001 证书的商业银行。由于注重防范风险，招商银行的资产质量得以不断优化，按照五级分类口径，不良贷款率为 2.30%，是国内资产质量最好的银行之一。

面对经济全融全球化带来的机遇与挑战，招商银行将以“力创股市蓝筹、打造百年招银”为目标，以改革创新为动力，加快推进经营战略调整和管理国际化进程，不断增强核心竞争力，努力把招商银行建设成为有知名品牌、有鲜明特色、有较高社会认同度的现代商业银行，实现股东、客户、员工长期利益的最大化。

3、财务概况

截至 2006 年 6 月 30 日，招行总资产达到 8243.16 亿元，比 2005 年 12 月 31 日增加 903.33 亿元，增长 12.31%；股东权益 327.43 亿元，每股净资产 2.67 元，2006 年上半年每股收益 0.23 元，实现主营业务收入 169.73 亿元，实现净利润 27.99 亿元。

4、资产托管情况

截至 2006 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、中信经典配置证券投资基金、长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金和友邦华泰中短期债券投资基金、海富通强化回报混合证券投资基金、光大新增长股票型基金及其它托管资产，托管资产总规模已近 331 亿元人民币。

5、主要人员情况

秦晓先生，英国剑桥大学经济学博士，高级经济师。第十届全国政协委员，招商局集团有限公司董事长，招商银行董事长，清华大学管理学院和中国人民银行研究生部兼职教授。曾任中国国际信托投资公司总经理、副董事长，中信实业银行董事长，国家外汇管理局外汇政策顾问，国际商会中国国家委员会副主席，亚太经济合作组织工商咨询理事会（ABAC）2001 年主席，第九届全国人大代表。

马蔚华先生，经济学博士，高级经济师。第十届全国人大代表，政协深圳市第四届委员会常委。招商银行董事、行长。兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长、招商局集团有限公司董事、TOM 在线有限公司独立董事。同时担任中国企业家协会副会长、深圳市国内银行同业公会会长、深圳上市公司协会会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事和北京大学、南京大学、吉林大学、西南财经大学等十多所高校兼职教授等职。曾任中国人民银行办公厅副主任，中国人民银行计划资金司副司长，中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长。曾经获评“2001–CCTV 中国经济年度人物”、英国《银行家》杂志（The Banker）“2004 年度银行业希望之星”（Rising Stars of Banking）。

李浩先生，副行长，工商管理硕士，高级会计师。主要工作经历：1982 年至 1988 年，历任交通部财务会计局水运财务干部、主任科员；1988 年至 1994 年，历任交通部财务会计司企业财务处副处长、处长；1994 年至 1997 年，历任交通部财务会计司司长助理、副司长；1997 年至 2001 年任本行行长助理，2000 年至 2001 年兼任本行上海分行行长；2002 年 1 月至今任本行副行长。

夏博辉先生，男，1963 年 11 月出生，湖南人，管理学博士（厦门大学），教授、注册会计师。现任招商银行资产托管部总经理，财政部会计准则咨询专家、金融会计组负责人，中国会计学会理事、中国金融会计学会理事。1992－1999 年历任湖南财经学院会计系副主任、科研处副处长、科研研究生处长、科研处处长及讲师、副教授、教授，2000－2005 年 6 月历任深圳发展银行会计出纳部总经理、财务会计部总经理、计划财务部总经理、财务执行总监等职；2005 年 7 月，加盟招商银行。1993－1996 年，受聘担任世界银行技术援助中国人民银行会计改革体系项目金融会计准则研究组中方工作组组长。曾获“全国优秀教师并授予全国优秀教师奖章”（1993），湖南省普通高校优秀教学成果一等奖（1993），湖南省第五届优秀社会科学成果（著作）二等奖（1999），中国青年科技论坛二等奖（1999）。

胡家伟先生，大学本科学历，现任招商银行资产托管部副总经理。30 多年银行业务及管理工作经历，已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

6、基金托管部门的设置及员工情况

2002 年 11 月 6 日，招商银行股份有限公司经中国证券监督委员会和中国人民银行批准，取得证券投资基金托管人资格，是国内第一家取得基金托管人资格的上市银行。除基金托管资格外，招商银行现已取得受托投资管理托管业务资格，合格境外机构投资者托管人资格（QFII），全国社会保障基金托管资格和企业年金基金托管人资格及保险资金托管资格。

招商银行总行设立资产托管部负责证券投资基金托管业务，内设综合管理室、核算清算室、稽核监察室三个职能部门，并在上海设立了分部。招商银行资产托管部拥有安全可靠的财务核算计价、交易监督系统及高效快捷的先进的“网银通”电子化资金清算服务体系，现有员工 20 人。

三、相关服务机构

（一）销售机构

1、直销机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

法定代表人：杨光裕

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755–83662688

传真：0755–83662600

联系人：黄念英

客户服务中心电话：400–8868–666、0755–83680399

2、代销机构

（1）招商银行

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

行长：马蔚华

电话：（0755）83195487，82090060

传真：（0755）83195049，83195050

联系人：朱小姐、刘小姐

（2）中国建设银行股份有限公司（以下简称中国建设银行）

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：郭树清

成立时间：2004 年 09 月 17 日

客户服务电话：95533

（3）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

法定代表人：王东明

电话：010–84864818—63266

联系人：陈忠

（4）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市新中街 68 号

办公地址：北京市朝阳门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：010－65186758

联系人：权唐

（5）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：021–53830794

联系人：高莉

（6）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

电话：021－62580818

联系人：芮敏祺

（7）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东大道 720 号 20 层

法定代表人：肖时庆

客户服务电话：021–962506

联系人：盛云

（8）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：蓝荣

联系人：潘峰

电话：0591–7541476

（9）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：魏云鹏

联系人：高峰

客户服务电话：0755–82288968

（10）中国银河证券有限责任公司

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：朱利

联系人：郭京华

客户服务电话：010–68016655

（11）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 39－45 层

法定代表人：宫少林

联系人：钟俊杰

客户服务电话：4008888111、0755–26951111

（12）天同证券有限责任公司

注册地址：山东济南市泉城路 180 号齐鲁国际大厦 5 层

法定代表人：段虎

联系电话：0531–5689888–9690

联系人：罗海涛

(13)平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：杨秀丽

联系人：任磊、苗永华

电话：0755–82422251、82440136

传真：0755–82433794、82400862

全国统一客户服务热线：95511

（14）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

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

（15）江南证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市象山北路 208 号

法定代表人：姚江涛

联系人：肖军生

电话：0755–83325909

传真：0755–83366612

客户服务热线：0791–6794944

网址：www.scstock.com

(16) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10–13 楼

法定代表人：管荣升

联系电话：0791–6289771

传真电话：0791–6289395

联系人：万齐志

公司网址：www.gsstock.com

（17）国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法人代表人：何如

联系人：林建闽

电话：0755–82133066

传真：0755– 82133302

客户服务电话：800–810–8868

公司网址：www.guosen.com.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）基金注册登记人

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层

法定代表人：杨光裕

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755–83662688

传真：0755–83662600

联系人：杜京果

客户服务中心电话：400–8868–666、0755–83680399

（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：北京市朝阳区光华路 1 号嘉里中心北楼 30 层

负责人：王玲

经办律师：靳庆军、宋萍萍

电话：0755–22163307

传真：0755–22163380

联系人：宋萍萍

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：深圳大华天诚会计师事务所

注册地址：深圳市福田区滨河大道 5022 号联合广场 B 座 11 楼

负责人：李秉心

经办注册会计师：李秉心、徐海宁

电话：0755–82900952

传真：0755–82900965

四、基金的名称

本基金名称：长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金

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

以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票，包括中信标普 300 指数的成份股（投资组合中持有的中信标普 300 指数成份股的数量不低于 240 只）；因增强性投资而选择的其他投资品种；在不增加额外风险的前提下，还可适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发），以提高收益水平。

本基金债券投资部分主要投资于国债、政策性金融债。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金为增强型指数基金，以中信标普 300 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。

在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90～95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。

2、股票投资策略

本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对中信标普 300 指数的跟踪，即按照中信标普 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以中信标普 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。

（1）成份股调整

非成份股的入选主要基于以下原因：①有望入选中信标普 300 指数的准成份股；②少量为提高组合流动性而可能投资的其他品种；③新股配售得到的非成份股，本基金将在新股上市后 1 个月以内择机卖出此类股票。

成份股出现以下几种情况可剔除：①公司经营状况、财务状况恶化，基本面发生重大变化，导致投资价值严重降低的上市公司；②成份股中流动性太差的个股。

（2）增强性投资

指数化基础上的增强投资将通过证券选择实现。基金管理小组将对组合品种的流动性和公司基本面进行评估，根据中信标普 300 指数的行业配置情况，采取有限度的增强投资。

① 流动性优化

组合品种的流动性评价指标包括：股票的流通市值、股票近半年的累积换手率、单位换手率对应的当日股票价格波动幅度（B 值），B＝（H–L）/V/CAP，H 为当日最高价，L 为当日最低价，V 为当日成交量，CAP 为流通股本。

要求组合品种的流动性同时达到以下要求：近半年累积换手率居前 4/5，近半年的累积 B 值居前 4/5，优先选择大市值股票。

② 基本面优化

本基金基于对上市公司及行业的基本面分析对指数化投资组合进行优化，具体而言，本基金将提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

A. 上市公司基本面较好，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力；

B. 中长期估值水平明显高于目前股价水平，在同行业中，股票相对价格偏低；

C. 预期将纳入指数的个股；

D. 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成份股。

本基金将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重（极端情况下可降低至零）：

A. 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑；

B. 中长期估值水平明显低于目前股价水平；在同行业中，股票相对价格偏高；

C. 短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调；

D. 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

3、债券投资策略

本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。

九、基金的业绩比较基准

本基金为增强型指数基金，业绩比较基准主要根据所跟踪的目标指数和投资范围来确定。本基金的业绩比较基准为 95%×中信标普 300 指数收益率 +5%×银行同业存款利率。

十、基金的风险收益特征

承担市场平均风险，获取市场平均收益。

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。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2006 年 10 月 23 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 2006 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产比例（%）
1	股票	362,115,389.12	94.18
2	债券	1,924,521.20	0.50
3	权证	0.00	0.00
4	银行存款和清算备付金合计	18,312,429.19	4.76
5	其他资产	2,148,325.36	0.56
	合计：	384,500,664.87	100.00

2、期末按行业分类的股票投资组合

（1）本报告期末基金积极类股票投资按行业分类的投资组合：

分 类	市值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 农、林、牧、渔业	62,990.00	0.02
B 采掘业	0.00	0.00
C 制造业	0.00	0.00
C0 食品、饮料	0.00	0.00
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2 木材、家具	0.00	0.00
C3 造纸、印刷	0.00	0.00
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00
C5 电子	0.00	0.00
C6 金属、非金属	0.00	0.00
C7 机械、设备、仪表	0.00	0.00
C8 医药、生物制品	0.00	0.00
C99 其他制造业	0.00	0.00
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E 建筑业	0.00	0.00
F 交通运输、仓储业	0.00	0.00
G 信息技术业	0.00	0.00
H 批发和零售贸易业	0.00	0.00
I 金融、保险业	3,688,010.00	0.96
J 房地产业	0.00	0.00
K 社会服务业	0.00	0.00
L 传播与文化产业	0.00	0.00
M 综合类	0.00	0.00
合 计	3,751,000.00	0.98

（2）本报告期末基金指数类股票投资按行业分类的投资组合：

分 类	市值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 农、林、牧、渔业	1,234,031.34	0.32
B 采掘业	18,325,832.45	4.80
C 制造业	164,389,080.28	43.09
C0 食品、饮料	32,154,908.38	8.43
C1 纺织、服装、皮毛	5,622,024.22	1.47
C2 木材、家具	0.00	0.00
C3 造纸、印刷	1,607,773.22	0.42
C4 石油、化学、塑胶、塑料	18,356,562.11	4.81
C5 电子	8,339,728.80	2.19
C6 金属、非金属	45,585,447.68	11.95
C7 机械、设备、仪表	39,381,698.15	10.32
C8 医药、生物制品	11,978,992.52	3.14
C99 其他制造业	1,361,945.20	0.36
D 电力、煤气及水的生产和供应业	18,782,116.86	4.92
E 建筑业	2,363,322.10	0.62
F 交通运输、仓储业	25,741,258.28	6.75
G 信息技术业	23,903,368.62	6.26
H 批发和零售贸易业	19,859,991.83	5.20
I 金融、保险业	36,914,525.28	9.68
J 房地产业	20,371,596.73	5.34
K 社会服务业	6,183,013.61	1.62
L 传播与文化产业	2,777,857.24	0.73
M 综合类	17,518,394.50	4.59
合 计	358,364,389.12	93.92

3、基金投资前五名股票明细

（1）本报告期末基金积极类股票投资前五名明细：

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	期末市值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600015	华夏银行	760,000	3,298,400.00	0.86
2	601988	中国银行	117,000	389,610.00	0.10
3	002069	獐子岛	1,000	62,990.00	0.02

（注：报告期末基金共持有三种积极投资类股票）

（2）本报告期末基金指数类股票投资前五名明细：

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	期末市值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	2,088,366	11,256,292.74	2.95
2	600030	中信证券	718,348	10,753,669.56	2.82
3	000002	万科 A	1,132,621	8,573,940.97	2.25
4	600000	浦发银行	737,719	7,834,575.78	2.05
5	600900	长江电力	1,190,444	7,821,217.08	2.05

4、按券种分类的债券组合

序号	债券类别	市值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国债	1,924,521.20	0.50
2	金融债	0.00	0.00
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债	0.00	0.00
5	央行票据	0.00	0.00
	合 计：	1,924,521.20	0.50

5、基金投资前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010411	04国债(11)	1,924,521.20	0.50

(注：报告期末基金共持有一种债券)

6、投资组合报告附注

（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。

（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。

（3）其他资产的构成：

序号	项目	金额（元）
1	交易保证金	1,550,772.93
2	应收证券清算款	524,829.86
3	应收利息	50,833.54
4	应收股利	7,114.03
5	应收申购款	14,775.00
	合 计：	2,148,325.36

（4）本基金报告期未未持有可转换债券。

（5）本基金本报告期内权证投资情况：

权证代码	权证名称	获得认购（沽）权证数量（份）	期间买入数量(份)	买入成本总额(元)	期间卖出数量(份)	卖出收入(元)	期末数量(份)
580008	国电 JTB1	58,996	0	0.00	58,