长城优化升级混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

（2016年第2号）

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
二〇一六年十二月

长城优化升级混合型证券投资基金由长城优化升级股票型证券投资基金更名而成。根据《长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更基金名称、基金类别并相应修改基金合同条款的公告》,长城优化升级股票型证券投资基金自2015年8月3日起更名为“长城优化升级混合型证券投资基金”,基金类别由“股票型”变更为“混合型”,并相应修改基金合同和托管协议。长城优化升级股票型证券投资基金经2011年9月22日中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1538号文核准募集。基金合同于2012年4月20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2016年10月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2016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:何伟

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:袁江天

9、管理基金情况:目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、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、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、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、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金等三十八只基金。

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
长城证券股份有限公司	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

何伟先生,董事长,硕士。现任长城证券股份有限公司总裁、党委副书记。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。

熊科金先生,董事、总经理,硕士。曾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。

范小新先生,董事,博士,高级经济师。现任长城证券股份有限公司副总经理、党委委员、纪委书记。曾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。

杨玉成先生,董事,硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书,东方金融控股(香港)有限公司董事长,上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师,君安证券有限公司证券投资部总经理助理,上海大众科技创业(集团)股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理,上海申能资产管理有限公司董事、副总经理,东方证券股份有限公司财务总监、副总经理,申能集团财务有限公司董事、总经理。

姬宏俊先生,董事,硕士。现任中原信托有限公司副总裁。曾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。

金树良先生,董事,硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

王连洲先生,独立董事,现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行总行印制管理局工作,1983年调任全国人大财经委员会,历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。

万建华先生,独立董事,硕士。现任通联支付网络服务股份有限公司董事长。曾任中国人民银行资金管理司处长,招商银行总行常务副行长兼上海分行行长(期间兼任长城证券股份有限公司董事长、国通证券有限责任公司(现招商证券股份有限公司)董事长),中国银联股份有限公司总裁,上海国际集团总经理,国泰君安证券股份有限公司董事长。

徐英女士,独立董事,学士。现任新华资产管理股份有限公司副董事长。历任景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事,长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记,海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理,北京财贸学院金融系助教、讲师。

鄢维民先生,独立董事,学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任,深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长,深圳市证券管理办公室公司审查处处长,招银证券公司副总经理。

(2)监事

吴礼信先生,监事会主席,会计师、中国注册会计师(非执业)。现任长城证券股份有限公司董事会秘书、财务总监。曾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年进入长城证券股份有限公司,任财务部总经理。

曾广炜先生,监事,高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制部总经理,曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司,2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。

张今先生,监事,硕士。现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。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。

黄魁粉女士,监事,硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002年7月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

袁江天先生,监事,博士。现任长城基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书、综合管理部总经理。曾任职于广西国际信托投资公司投资管理部、国海(广西)证券有限责任公司投资银行部、证券营业部、总裁办、北方国际信托投资股份有限公司博士后工作站。

王燕女士,监事,硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理、综合管理部副总经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司,曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作,2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士,监事,硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。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。

(3)高级管理人员

何伟先生,董事长,简历同上。

熊科金先生,董事、总经理,简历同上。

彭洪波先生,副总经理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理,硕士。曾就职于长城证券股份有限公司,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。

桑煜先生,副总经理兼市场开发部总经理、广州管理部总经理,学士。曾任职于中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行营业部。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。

杨建华先生,副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理,硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司工作,历任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理、“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理。

卢盛春先生,副总经理兼机构理财部总经理,硕士。曾就职于中国人民银行江西省分行、交通银行海南分行、海通证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、西北证券有限责任公司、华商基金管理有限公司(筹备组)。2003年进入长城基金管理有限公司,历任上海分公司总经理、北京分公司总经理、公司总经理助理。

车君女士,督察长,监察稽核部总经理,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。

2.本基金基金经理简历

郑帮强先生,华中科技大学工业工程学士、华中科技大学管理科学与工程硕士。曾就职于长江证券股份有限公司。2013年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理助理。自2015年7月8日起担任“长城优化升级混合型证券投资基金”基金经理,自2016年1月21日起担任“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理。

长城优化升级混合型证券投资基金历任基金经理如下:刘颖芳女士自2012年4月20日至2014年9月5日担任长城优化升级混合型证券投资基金的基金经理。于雷先生自2013年3月8日至2015年6月25日担任长城优化升级混合型证券投资基金的基金经理。何以广先生自2015年5月26日至2016年7月27日担任长城优化升级混合型证券投资基金的基金经理。

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,公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理。

钟光正先生,投资决策委员会委员,公司总经理助理、固定收益部总经理、基金经理。

吴文庆先生,投资决策委员会委员,公司研究部总经理、基金经理。

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:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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:田青

联系电话:(010) 67595096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年末,本集团资产总额18.35万亿元,较上年增长9.59%;客户贷款和垫款总额10.49万亿元,增长10.67%;客户存款总额13.67万亿元,增长5.96%。净利润2,289亿元,增长0.28%;营业收入6,052亿元,增长6.09%,其中,利息净收入增长4.65%,手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%,加权平均净资产收益率17.27%,成本收入比26.98%,资本充足率15.39%,主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展,综合性网点数量达1.45万个,综合营销团队2.15万个,综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点,智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显,电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%,较上年提升7.55个百分点;同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式,成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张,消费交易额2.22万亿元,多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%,客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元,承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元,增长67.36%;托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破,继伦敦之后,再获任瑞士、智利人民币清算行资格;上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年,本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项,并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中,以一级资本总额位列全球第二;在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

赵观甫,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、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。

张力铮,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,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2016年一季度末,中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国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。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

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://etrade.ccfund.com.cn/etrading/

2、代销机构

(1)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
传真:010-66275654
联系人:张静
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.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
客户服务电话:95588
传真:010-66107913
联系人:李鸿岩
网址:www.icbc.com.cn

(3)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
法定代表人:刘士余
电话:010-85108223
传真:010-85109219
联系人:牛峰
客户服务电话:95599
网站:www.abchina.com

(4)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:牛锡明
电话:021-58781234
传真:021-58408842
联系人:胡迪锋
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
电话:0755-83198888
传真:0755-83195049
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
网站:www.cmbchina.com

(6)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:010-56367136
传真:010-57092611
联系人:穆婷
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(7)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:常振明
电话:010-65550827
传真:010-65541230
联系人:丰靖
客户服务电话:95558
网站:www.bank.ecitic.com

(8)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
电话:021-38637673
传真:021-50979375
联系人:张莉
客户服务电话:95511-3
网址:http://bank.pingan.com/

(9)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:010-66223588
传真:010-66226045
联系人:孔超
客户服务电话:95526
网站:www.bankofbeijing.com.cn

(10)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:汤征成
联系电话:021-68475521
网址:www.bankofshanghai.com

(11)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
联系人:唐苑
传真:021-63604199
网址:www.spdb.com.cn
客户服务电话:95528

(12)深圳农村商业银行股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区3038号合作金融大厦
办公地址:深圳市罗湖区3038号合作金融大厦
法定代表人:李伟
联系电话:0755-25188269
传真电话:0755-25188794
联系人:王璇
客服电话:4001961200
公司网站:www.961200.net

(13)包商银行股份有限公司
注册(办公)地址:内蒙古包头市钢铁大街6号
法定代表人:李镇西
联系人:刘芳
联系电话:(0472)5109729
传真:(0472)5176541
客服电话:内蒙古地区:0472-96016;北京地区:010-96016 ;宁波地区:0574-967210 ;深圳地区:0755-967210;成都地区:028-65558555
公司网站:www.bsb.com.cn

(14)泉州银行股份有限公司
注册地址:福建省泉州市丰泽区云鹿路3号
法定代表人:傅子能
联系电话:0595-22551071
联系人:董培姗
客服电话:400-8896-312
公司网站:www.qzccbank.com

(15)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
联系人:邱艇
电话:0574-87050397
客服电话:95574
公司网站:www.nbcb.cn

(16)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:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
电话:010－85130577
联系人:权唐
客户服务电话:4008888108
网站:www.csc108.com

(17)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:黄婵君
电话:0755-82960167
传真:0755-82943636
客户服务电话:95565
网站:www.newone.com.cn

(18)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:010-60838995
联系人:侯艳红
客户服务电话:95558
网站:www.cs.ecitic.com

(19)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:宋明
电话:010-66568450
客户服务电话:4008-888-888
网站:www.chinastock.com.cn

(20)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:021-53594566
联系人:沈笑天
客户服务电话:95553、4008888001
网站:www.htsec.com

(21)申万宏源证券股份有限公司
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
联系人:曹晔
电话:021-33388215
传真:021-33388224
客服电话:95523/4008895523/4008000562
网址:www.swhysc.com

(22)中泰证券有限责任公司
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:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网址:www.zts.com.cn

(23)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
电话:021-38565785
联系人:黄英
客户服务热线:95562
网站:www.xyzq.com.cn

(24)长城证券股份有限公司
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:刘阳
电话:0755-83516289
传真:0755-83515567
客户服务电话:0755-33680000、4006666888
网站:www.cgws.com

(25)华西证券股份有限公司
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:张曼
电话:010-52723273
客户服务电话:4008-888-818
公司网站:www.hx168.com.cn

(26)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:王宜四
联系人:戴蕾
电话:0791-86868681
传真:0791-86770178
客服电话:400-8866-567
网站:www.avicsec.com

(27)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人:周易
电话:0755-82492193
联系人:庞晓芸
客户服务电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

(28)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:周一涵
电话:021-38637436
传真:021-33830395
客户服务电话:4008816168
网站:www.pingan.com

(29)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区宾水西道8号
法定代表人:杜庆平
联系人:蔡霆
电话:022-28451991
传真:022-28451892
客户服务电话:400-651-5988
网站:www.bhzq.com

(30)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
法人代表人:何如
联系人:周杨
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn

(31)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:周欣玲
网站:www.gsstock.com

(32)国都证券股份有限公司
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
联系电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

(33)广州证券股份有限公司
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:邱三发
电话:020-87323735
传真:020-88836654
联系人:林洁茹
客服电话:020-961303
网站:www.gzs.com.cn

(34)世纪证券有限责任公司
注册地址: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:姜昧军
联系人:袁媛
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
客户服务电话:0755-83199599
网站:www.csco.com.cn

(35)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
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20层
法定代表人:杨宝林
联系电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
联系人:吴忠超
客户服务电话:95548
公司网址:www.citicssd.com

(36)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
联系人:郑向溢
电话:0755-82558038
传真:0755-82558355
公司网址:www.essence.com.cn
客服热线:4008001001

(37)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:上海市延平路135号
法定代表人:杨德红
联系人:芮敏祺
电话:021－38676161
传真:021－38670161
客户服务电话:4008888666
网站:www.gtja.com

(38)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:李芳芳
客服电话:4008888788、10108998
公司网址:www.ebscn.com

(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:0471-4972042
传真:0471-4930707
联系人:孙伟
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
联系人:祝丽萍
客户服务电话: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、95532
网址:www.china-invs.cn

(42)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:奚博宇
电话:021-68751860
传真:021-51062920
客服热线:4008-888-999或95579
网址:www.95579.com

(43)国融证券股份有限公司
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:陈文彬
电话:010-83991888
传真:010-88086637
客户服务电话:400-660-9839

(44)网址:www.grzq.com华宝证券有限责任公司
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人:陈林
联系人:刘闻川
电话:021-68778790
传真:021-50122200
客户服务电话:4008209898
网址:www.cnhbstock.com

(45)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
法定代表人:岳献春
电话:010-85127622
传真:010-85127917
联系人:赵明
客户服务电话:4006198888
网址:www.mszq.com

(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:祝献忠
联系人:李慧灵
联系电话:010-58315221
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
法定代表人:张雅锋
联系人:程一天
电话:0755-83709350
传真:0755-83700205
客服电话:95563
公司网站:www.ghzq.com.cn

(49)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:潘鑫军
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务热线:400-8888-506、021-962506
网址:www.dfzq.com.cn

(50)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588

(51)网址:www.longone.com.cn方正证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观40-43层法定代表人:何其聪
联系人:高洋
联系电话:010-59355546
客服电话:95571
网址:www.foundersc.com

(52)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
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
电话:0351-4130322
客户服务热线:400-7121-212
网址:www.dtsbc.com.cn

(53)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
公司网址:www.dxzq.net.cn

(54)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

(55)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
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87557985
客服电话:95575或致电各地营业网点
公司网站:www.gf.com.cn

(56)西南证券股份有限公司
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
客服电话:4008096096
公司网站:www.swsc.com.cn

(57)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人:李学东
电话:010-85679888
传真:010-85679535
联系人:秦朗
客服电话:400-910-1166
网站:www.cicc.com.cn

(58)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
法定代表人:张磊
联系人:洪成
电话:0755-23953913
传真:0755-83217421
客服电话:400-990-8826
公司网站:www.citicsf.com

(59)申万宏源西部证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)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(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:李季
联系人: 李巍
传真:010－88085195
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

(60)国金证券股份有限公司
注册地址: 四川省成都市东城根上街95号
办公地址: 四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘婧漪
电话:028-86690057
客户服务电话:95310
网址:www.gjzq.com.cn

(61)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16－17层
地址:西安市东新街232号陕西信托大厦16－17层
法定代表人:刘建武
联系人:刘莹
电话:029-87406649
客服热线:029-87419999
网址:www.westsecu.com.cn

(62)深圳众禄金融控股股份有限公司
住所:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客服电话:4006-788-887
公司网址:www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

(63)杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
联系人:朱晓超
联系电话:021-60897840
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

(64)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人:汪静波
联系人:徐诚
联系电话:021-38509636
客服电话:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com

(65)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190号2号楼2层
法定代表人:其实
联系人:高莉莉
联系电话:020-87599121
客服电话:400-1818-188
公司网站:www.1234567.com.cn

(66)众升财富(北京)基金销售有限公司
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人:李招弟
联系人:付少帅
联系电话:010-59497361
传真:010-64788105
客服电话:400-808-0069
公司网站:www.wy-fund.com

(67)北京展恒基金销售股份有限公司
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:翟飞飞
联系电话:010-62020088
客服电话:400-888-6661
公司网站:www.myfund.com

(68)北京增财基金销售有限公司
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:王昌庆
联系人:张蕾
联系电话:010-67000988
客服电话:400-001-8811
公司网站:www.zcvc.com.cn

(69)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:吴阿婷
联系电话:0755-82721106
客服电话:400-9200-022
公司网站:licaike.hexun.com

(70)上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人:杨文斌
联系人:胡锴隽
联系电话: 021-2061 3635
客服电话:400-700-9665
公司网站:www.ehowbuy.com

(71)上海联泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
法定代表人:燕斌
联系人:凌秋艳
联系电话:021-52822063-8105
客服电话:4000-466-788
公司网站:www.66zichan.com

(72)珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号
法定代表人:肖雯
联系电话:020-89629099
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网站:www.yingmi.cn

(73)上海陆金所资产管理有限公司
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
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
客户服务热线:4008219031
公司网站:www.lufunds.com

(74)上海中正达广投资管理有限公司
住所:上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼
法定代表人:黄欣
联系人:戴珉微
联系电话:021-33768132
客服电话:4006767523
网址:www.zzwealth.cn

(75)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
法定代表人:盛大
联系人:徐雪吟
联系电话:021-50583533-3011
客服电话:400-067-6266
网址:http://a.leadfund.com.cn/

(76)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
办公地址: 深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:陈勇军
电话:0755-83999913
传真:0755-83999926
客服电话:0755-83999907
网址:www.jinqianwo.cn

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。

(二)基金注册登记机构
名称:长城基金管理有限公司
注册地址: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:何伟
成立时间:2001年12月27日
电话:0755-23982338
传真:0755-23982328
联系人:张真珍
客户服务电话:400-8868-666

(三)律师事务所与经办律师
律师事务所名称:北京市中伦律师事务所
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街甲6号SK大厦36-37层
负责人:张学兵
电话:0755-23993388
传真:0755-86186205
联系人:李雅婷

(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(特殊普通合伙)
住所(办公地址):北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:李妍明

四、基金的名称

本基金名称:长城优化升级混合型证券投资基金

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

本基金在合理的资产配置基础上,积极寻找受益于我国经济结构优化升级而实现成长的企业的投资价值,力争实现基金资产的持续增值。

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,包括国内依法发行上市的股票(含中小板股票和创业板股票)、债券、货币市场工具、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。

本基金股票投资占基金资产净值的比例范围为60-95%,其中,以不低于80%的股票资产投资于优化升级企业;债券投资占基金资产净值的比例范围为0-35%;权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

如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.大类资产配置策略

本基金为混合型证券投资基金,将依据市场情况进行基金的大类资产配置。本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素,在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素,如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等;对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况,对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上,本基金将参考基金流动性要求,以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。

2.股票投资策略

本基金先通过定性的优化升级行业精选和优化升级企业精选筛选出符合优化升级条件的企业;再利用定量的优化升级企业精选指标对企业的优化升级情况进行检验;最后结合股票市场评价方法,将基金资产配置于已经实现或有能力实现优化升级的上市公司。本基金股票投资策略的评价体系如下表所示:

优化升级企业评价体系

优化升级行业精选	行业关键因子	基本价值
		预期价值
		行业风险
	集中度	行业集中度
		主要产品构成及其市场份额
		区域市场份额占比
优化升级企业精选	定性分析	业务构成变化
		商业模式
		管理能力
		研发能力
	定量分析	盈利能力
		运作效率
		成长性
股票市场评价		相对估值指标
		流动性、换手率

(1)优化升级行业精选

① 行业关键因子

行业关键因子分析的目的在于对行业特性、运营模式、企业构成、竞争态势等方面有基本的认识,以此作为评估行业优化升级进程的出发点,选择优化升级效果显著的行业。行业关键因子分析包括以下三个方面:

I.基本价值部分

主要分析行业规模、行业环境、行业绩效、行业结构以及需求等方面。

II.预期价值部分

主要分析行业对国家政策受益程度、行业成长性、行业的技术进步潜力、商业模式创新等因素。

III.行业风险部分

主要分析行业要素的波动性、行业对国家制度和政策的敏感性、行业上下游产业链的相互作用力等因素。

② 集中度

I.行业集中度

通过分析行业集中度有利于分析行业的竞争态势,为未来行业运作和整合提供一定参考。行业整合所带来的集中度提升有助于提高行业运作效率,即行业结构发生了优化。行业整合通常以政策和行业内并购等事件为触发点,本基金将跟踪行业对国家相关政策反应的敏感性和整合的预期进度,分析整合后行业竞争态势,资源运作效率等指标评价整合效果。

II.主要产品构成及其市场份额

行业产品构成由低效产品占主导发展到由高效产品占主导有助于提高资源的利用效率,提升产品使用效率。通过考察行业产品构成变化,有助于筛选行业产品线优化过程中在业内占主导地位的企业。

III.区域市场份额占比

对于区域进入壁垒较高的行业,本基金将分析上市公司在特定区域内市场份额占比、份额集中度及潜在的提升空间,以考察细分市场竞争态势及具有区域竞争优势的上市公司。

(2)优化升级企业精选

① 定性分析

I.业务构成变化

业务构成变化主要分析企业业务构成中核心业务占比的变化情况。这里指的核心产品包括:高附加值产品,效能提高的换代产品,优化行业产品线构成的产品或服务。对于那些核心业务占比稳步提升的企业,可以认为其对产品结构进行了有效优化,以生产和提供高效产品来提升企业的竞争力,提高了资源的利用效率。核心业务占比变化情况利用企业营业收入中核心业务收入占比的变化情况进行分析。

II.商业模式

本基金将根据行业、企业特点,分析商业模式调整对企业成长的贡献,重点分析存货管理、上下游关系和销售渠道控制能力等。

存货管理:包括产成品和生产资料存货管理能力将对企业生产成本造成影响。存货管理不仅涉及到企业对日常生产和销售计划的安排,也与企业对该行业短期或长期发展形势的判断密切相关。不断升级、完善的存货管理将有利于企业的可持续发展。

上下游关系:企业的上下游关系是企业存续和发展的主要影响因素之一。本基金将分析企业在上下游关系建设方面所做的努力,考察企业对上下游关系的处理和控制能力,以分析企业管理层对企业发展的定位和眼光。

销售渠道控制能力:企业的销售渠道除了能够反馈市场信息供管理层制定相应的企业发展战略,同时也对企业盈利能力的稳定性及盈利质量产生重要影响。渠道控制能力较强的企业对业绩的锁定能力和管理能力较强。本基金将关注销售渠道控制力提升的企业及其投资价值。

III.管理能力

管理能力主要考察企业的经营独立性,管理层对股东的责任感,管理层长效约束与激励机制的建立,管理层的长远眼光及战略能力等定性指标。

IV.研发能力

本基金对企业研发能力的考察集中于分析上市公司过往的研发投入比例,研发团队的稳定性,管理层对创新的态度及已市场化的研发成果对利润的贡献度等。

② 定量分析

前述行业精选和企业定性精选过程筛选出的优化升级企业的可投资性都须经过下述定量指标的分析来进行进一步确认。这是因为本基金认为,企业在经历了优化升级以后,能够分享优化升级所带来的收益,获得成长。而这些成长是可以通过可量化的指标加以反映的。下述指标将通过企业财务报告或行业研究员的预测得到。

I.盈利能力

企业经过持续的优化升级,可望将盈利能力维持在一个稳定水平,甚至出现稳步的提升。盈利能力分析中主要考察毛利率和净利率指标。本基金将对企业未来毛利率和净利率指标进行预测和趋势分析,以判断优化升级是否为企业带来了盈利能力的提高。

II.运作效率

优化升级企业运作效率的提升可以反映在人均营业收入方面和周转率指标上。当企业实现了优化升级,人均营业收入将能由于营业收入的较快增长或自动化生产对人员需求的降低获得提升;周转率方面,推进优化升级的企业运作效率将获得提高,表现为周转率的提升。本基金将评价人均营业收入和周转率指标来衡量企业运作效率是否由于优化升级而获得提升。

III.成长性

企业的优化升级是一个较长的过程,需要以发展的眼光来分析企业优化升级的成果。因此本基金将滚动分析近三年每股盈利的复合增长率和近三年主营业务收入复合增长率指标的变化情况,以考察企业的成长能力及其成长空间。

(3)股票市场评价

①相对估值指标

相对估值指标用以判断优化升级企业的估值高低,以选择恰当的买入时点。相对估值指标如PE、PB、PEG反映了市场价格、企业盈利或企业净资产和企业成长性之间的关系。相对估值指标可以被分解成市场价格维度(P)和企业盈利(E)或净资产(B)维度。综合考察行业相对估值指标的两个维度与市场相对估值指标两个维度之间的变化方向和幅度,以及行业相对估值指标两个维度的历史变化情况,能将企业基本面信息与价格信息结合起来,辅以成长因子的分析,帮助基金管理人判断行业估值的合理区间,选择相应的投资时点。本基金将通过对行业相对估值指标的横向、纵向分析,选择估值位于合理区间下限的优化升级企业进行投资,动态构建资产组合。

②流动性、换手率

本基金的投资限于具有良好流动性的金融工具。进行股票资产配置时,本基金将考察行业和企业的流动性和换手率指标,参考基金的流动性需求,以降低股票资产的流动性风险。

3、债券投资策略

当股票市场投资风险和不确定性增大时,本基金将择机把部分资产转换为债券资产,或通过参与一级债券市场交易获取低风险收益,以此降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础,在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整,并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。

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),以增加收益。本基金组合的新股申购(含增发新股)策略主要体现在从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况,结合新股发行当时的市场环境,根据可比公司股票的基本面因素和价格水平,预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格,指导新股询价,在有效识别和防范风险的前提下,获取较高的低风险收益。

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

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。

沪深300指数选取了A股市场上规模最大、流动性最好的300只股票作为其成份股,较好地反映了A股市场的总体趋势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制和维护。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券,综合反映了债券市场整体价格和回报情况,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。

本基金是混合型证券投资基金,股票投资范围为60-95%,债券投资范围为0-35%。本基金对沪深300指数和中债综合财富指数分别赋予80%和20%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经与基金托管人协商一致,本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金的长期平均风险和预期收益率低于指数型基金、股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金,属于较高风险、较高收益的基金产品。

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2016年11月10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2016年6月30日,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	197,860,388.73	87.04
	其中:股票	197,860,388.73	87.04
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	3,508,350.80	1.54
	其中:债券	3,508,350.80	1.54
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	25,211,611.67	11.09
8	其他资产	737,267.14	0.32
9	合计	227,317,618.34	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	采矿业	–	–
C	制造业	117,829,306.01	52.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	42,174.72	0.02
F	批发和零售业	6,456,640.00	2.89
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	52,261,698.00	23.43
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	17,096,220.00	7.66
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	4,174,350.00	1.87
	合计	197,860,388.73	88.69

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	300008	天海防务	513,400	17,096,220.00	7.66
2	600303	曙光股份	1,100,000	16,335,000.00	7.32
3	300367	东方网力	350,000	8,690,500.00	3.90
4	300263	隆华节能	700,000	7,826,000.00	3.51
5	300340	科恒股份	90,000	7,130,700.00	3.20
6	300380	安硕信息	136,682	7,039,123.00	3.16
7	600110	诺德股份	680,000	6,691,200.00	3.00
8	603788	宁波高发	139,947	6,581,707.41	2.95
9	603002	宏昌电子	850,000	6,528,000.00	2.93
10	300260	新莱应材	179,969	6,453,688.34	2.89

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	3,508,350.80	1.57
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	3,508,350.80	1.57

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	019515	15国债15	35,080	3,508,350.80	1.57
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序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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与股指期货交易。

10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1

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。

11.2

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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	287,965.55
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	85,411.43
5	应收申购款	363,890.16
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	737,267.14

11.4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。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末投资前十名股票中未存在流通受限的情况。

11.6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

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较(截至2016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12月31日	8.00%	0.83%	-1.54%	0.95%	9.54%	-0.12%
2013年1月1日至2013年12月31日	6.59%	1.68%	-5.91%	1.12%	12.50%	0.56%
2014年1月1日至2014年12月31日	34.24%	1.55%	42.73%	0.97%	-8.49%	0.58%
2015年1月1日至2015年12月31日	32.08%	2.81%	7.41%	1.99%	24.67%	0.82%
2016年1月1日至2016年6月30日	-8.42%	2.82%	-12.01%	1.47%	3.59%	1.35%
基金合同生效日至2016年6月30日	86.92%	2.04%	24.97%	1.37%	61.95%	0.67%

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)基金财产拨划支付的银行费用;

(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)基金的开户费用、账户维护费用

(9)在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;

(10)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1.5%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年管理费率÷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0.25%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年托管费率÷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)除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人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、申购费用

本基金的申购费按申购金额进行分档,投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金自2015年3月13日起对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下:

(1)申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
50万元以下	1.5%
50万元(含)-200万元	1.0%
200万元(含)-500万元	0.5%
500万元以上(含)	每笔1000元

注:上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

(2)特定申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
50万元以下	0.3%
50万元(含)-200万元	0.2%
200万元(含)-500万元	0.1%
500万元以上(含)	每笔1000元

注:上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户,包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:全国社会保障基金;可以投资基金的地方社会保障基金;企业年金单一计划以及集合计划;企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;企业年金养老金产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金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),对于500万元(含)以上的申购,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

申购份数＝净申购金额/T日基金份额净值

例:投资者申购本基金6,000.00元,T日基金份额净值为1.200元,其获得的基金份额计算如下:

净申购金额＝6,000.00/(1＋1.5%)＝5,911.33 元

申购费用＝6,000.00－5,911.33＝88.67 元

申购份额＝5,911.33/1.200＝4,926.11 份

即投资者缴纳申购款6,000.00元,获得4,926.11份本基金的基金份额。

2、赎回费用

本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减,费率如下:

持有期	赎回费率
1年以内	0.5%
1年(含)-2年	0.25%
2年(含)以上	0

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中,

赎回总额＝赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－赎回费用

例:假定T日本基金的基金份额净值为1.200元,投资者赎回其持有的10,000份基金份额,持有期10个月,则:

赎回总额＝10,000×1.200＝12,000.00 元

赎回费用＝12,000.00×0.5%＝60.00 元

赎回金额＝12,000.00－60＝11,940.00 元?

即投资者赎回其持有的10,000份本基金的基金份额,获得赎回金额11,940.00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

转出金额＝转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额＝转出金额－转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率＝转入基金适用申购费率－转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差＝转入总金额－转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额＝转入总金额－转入基金申购费补差

转入份额＝转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费＝转出基金赎回费＋转入基金申购费补差

例:某投资者持有长城货币市场证券投资基金10万份基金份额,持有期为100天,决定转换为本基金,假设转换当日转入基金(本基金)份额净值是1.250元,转出基金(长城货币市场证券投资基金)对应赎回费率为0,申购补差费率为1.5%,则可得到的转换份额及基金转换费为:

转出金额＝100,000×1＝100,000 元

转出基金赎回费＝0

转入总金额＝100,000－0＝100,000元

转入基金申购费补差＝100,000－100,000/(1+1.5%)＝1,477.83元

转入净金额＝100,000－1,477.83＝98,522.17元

转入份额＝98,522.17/1.25＝78,817.73份

基金转换费＝0＋1,477.83＝1,477.83元

②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

基金转换费用＝转出金额×转出基金赎回费率

例:某投资者持有本基金10万份基金份额,持有期为100天,决定转换为长城货币市场证券投资基金,假设转换当日转出基金(本基金)份额净值是1.250元,转出基金对应赎回费率为0.5%,申购补差费率为0,则可得到的转换份额及基金转换费为:

转出金额＝100,000×1.25＝125,000元

转出基金赎回费＝125,000×0.5%＝625元

转入总金额＝125,000－625＝124,375元

转入基金申购费补差＝0

转入净金额＝124,375－0＝124,375元

转入份额＝124,375/1＝124,375份

基金转换费＝125,000×0.5%＝625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(基金合同或招募说明书另有规定的除外)。

(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。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人可以在不违反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,按相关监管部门要求履行必要手续后,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、本基金的申购费用由基金申购人承担,归基金管理人及代销机构所有,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担,赎回费将按照赎回当时适用的费率收取,所收取赎回费的25%归入基金资产,其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

(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》、《公开募集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《长城优化升级混合型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2016年6月2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,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信息。

4、在第五部分“相关服务机构”中,更新了代销机构、基金注册登记机构的信息。

5、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信息。

6、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2016年6月30日的数据。

7、在第九部分“基金的业绩”中,披露了截至2016年6月30日本基金的业绩数据。

8、在第十九部分“基金托管协议的内容摘要”中,更新了基金管理人的法定代表人信息。

9、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
2016年12月2日