

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 6 月 5 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】1164 号文注册募集。本基金基金合同于 2015 年 7 月 6 日正式生效。本基金为混合型开放式基金。

重要提示

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金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等。

本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、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），投资者在投资本基金前，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。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

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。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为 2017 年 1 月 6 日，有关财务数据和净值截止日为 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人广发证券股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

基金管理人概况

名称 长信基金管理有限责任公司

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

办公地址 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

邮政编码 200120

批准设立机关 中国证券监督管理委员会

批准设立文号 中国证监会证监基金字[2003]63号

注册资本 壹亿伍仟万元人民币

设立日期 2003年5月9日

组织形式 有限责任公司

法定代表人 叶焯

电话 021-61009999

传真 021-61009800

联系人 魏明东

存续期间 持续经营

经营范围 基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

股权结构 股东名称 出资额 出资比例

长江证券股份有限公司 7350万元 49%

上海海欣集团股份有限公司 5149.5万元 34.33%

武汉钢铁股份有限公司 2500.5万元 16.67%

总计 15000万元 100%

注：

1、自2016年11月24日起，公司聘任成善栋先生担任公司董事长暨法定代表人，自

2017年1月13日起，公司已完成法定代表人工商变更手续；

2、我公司已于2017年2月8日发布《长信基金管理有限责任公司关于股东及股东出资比例变更的公告》，本公司的注册资本从1.5亿元人民币增至1.65亿元人民币。各公司股东出资占公司注册资本的比例分别为：长江证券股份有限公司为44.55%、上海海欣集团股份有限公司为31.21%、武汉钢铁股份有限公司为15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）为4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为4.54%。

（二）主要人员情况

1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员

姓名 职务 性别 简历

成善栋 董事长 男 中共党员，硕士研究生，EMBA，曾任职中国人民银行上海市分行静安区办事处办公室科员，中国人民银行上海市分行、工商银行上海市分行办公室科员、科长，上海巴黎国际银行信贷部总经理，工商银行上海市分行办公室副主任、管理信息部总经理、办公室主任、党委委员、副行长，并历任上海市金融学会副秘书长，上海城市金融学会副会长、秘书长。

陈谋亮 非独立董事 男 中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海海欣集团股份有限公司副总裁。曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁、总裁。

余汉生 非独立董事 男 中共党员，本科，正高职高级会计师。现任武汉钢铁股份有限公司

总会计师。历任武钢财务部机关费用科一科副科长、会计处主任科员，武钢工会财务部部长，武钢实业公司审计处处长、财务处处长，武钢计划财务部会计处处长，武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长，武汉钢铁股份有限公司副总会计师兼计划财务部部长，长信基金管理有限责任公司监事会主席。

田丹 非独立董事 男 中共党员，硕士，EMBA。现任长江证券股份有限公司监事长。曾任湖北省军区参谋、秘书，中国人民银行湖北省分行金融调研处科长，湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理，三峡证券公司副总经理，湖北证券有限责任公司董事、副总裁，长江证券有限责任公司董事、副总裁、财务负责人，长江证券有限责任公司董事、总裁，长信基金管理有限责任公司董事长。

覃波 非独立董事 男 中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。

胡柏枝 独立董事 男 中共党员，大专，高级会计师，注册会计师，注册税务师。曾任湖北省财政厅副厅长、党组副书记，湖北省国有资产管理局副局长、局长，中国三峡总公司财务部主任、副总会计师，三峡财务公司总经理，财政部驻湖北省专员办监察专员、党组书记、巡视员，湖北省人大财经委、预工委副主任。

吴稼祥 独立董事 男 经济学学士，研究员。现任中国生物多样性保护与绿色发展基金会副理事长、中国体制改革研究会公共政策研究部研究员。曾任职中共中央宣传部和中共中央书记处办公室、华能贵诚信托投资公司独立董事。

谢红兵 独立董事 男 中共党员，学士。曾任营教导员、军直属政治处主任，交通银行上海分行杨浦支行副行长、营业处处长兼房地产信贷部经理、静安支行行长、杨浦支行行长，交通银行基金托管部副总经理、总经理，交银施罗德基金管理有限公司董事长，中国交银保险(香港)副董事长。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

2、监事会成员

监事会成员

姓名 职务 性别 简历

吴伟 监事会主席 男 中共党员，研究生学历。现任武汉钢铁股份有限公司经营财务部总经理。历任武钢计划财务部驻工业港财务科副科长、科长、资金管理处主任科员、预算统计处处长，武汉钢铁股份有限公司计划财务部副部长。

陈水元 监事 男 硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司执行副总裁、财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理、总裁特别助理。

杨爱民 监事 男 中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。

李毅 监事 女 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼零售服务部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监。

孙红辉 监事 男 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。

魏明东 监事 男 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

3、经理层成员

经理层成员

姓名 职务 性别 简历

覃波 总经理 男 简历同上。

周永刚 督察长 男 经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。

邵彦明 副总经理 男 硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。

李小羽 副总经理 男 上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

程燕春 副总经理 男 华中科技大学技术经济学士，具有基金从业资格，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，曾任中国建设银行江西省分行南昌城东支行副行长，中国建设银行纪检监察部案件检查处监察员，中国建设银行基金托管部市场处、信息披露负责人，融通基金管理有限公司筹备组成员、总经理助理兼北京分公司总经理、上海分公司总经理、执行监事，金元惠理基金管理有限公司首席市场官，历任长信基金管理有限责任公司总经理销售助理、总经理助理。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

4、基金经理

本基金基金经理情况

姓名 职务 任职时间 简历

谈洁颖 投资管理部总监 自基金合同生效之日起 管理学学士，中国人民大学工商企业管理专业本科毕业，具有基金从业资格。曾就职于北京大学，从事教育管理管理工作。2004年8月加入长信基金管理有限责任公司，历任研究助理、基金经理助理、专户理财投资经理。现任长信基金投资管理部总监、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：自2017年1月17日起，投资管理部更名为权益投资部，谈洁颖为权益投资部总监

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员

姓名 职务

覃波 总经理、投资决策委员会主任委员

李小羽 副总经理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理

程燕春 副总经理、投资决策委员会执行委员

常松 总经理助理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理

安昀 总经理助理、投资决策委员会执行委员

薛天 国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金和长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理

谈洁颖 投资管理部总监、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理

高远 研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理

易利红 股票交易部总监兼债券交易部总监

张文琍 固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理

陆莹 长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理

邓虎 FOF 投资部总监、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金和长信新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理

注：

- 1、上述人员之间均不存在近亲属关系；
- 2、自 2017 年 1 月 12 日起，公司聘任陆莹女士为长信稳健纯债债券型证券投资基金和长信纯债半年债券型证券投资基金的基金经理；
- 3、自 2017 年 1 月 17 日起，投资管理部更名为权益投资部，谈洁颖为权益投资部总监；
- 4、自 2017 年 1 月 17 日起，公司聘任常松为混合策略部总监，常松不再担任量化投资部总监。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：广发证券股份有限公司（简称：广发证券）

注册地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 5 楼、7 楼、8 楼、18 楼、19 楼、38 楼、39 楼、40 楼、41 楼、42 楼、43 楼和 44 楼

法定代表人：孙树明

成立时间：1994 年 1 月 21 日

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】510 号

注册资本：人民币 7,621,087,664 元

存续期间：长期

联系人：崔瑞娟

联系电话：020-87555888

广发证券成立于 1991 年，是国内首批综合类证券公司。公司先后于 2010 年和 2015 年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所主板上市（股票代码：000776.SZ，1776.HK）。截至 2016 年 6 月 30 日，公司共有分公司 20 家、证券营业部 264 家，营业网点分布于全国 31 个省、直辖市、自治区。广发证券旗下拥有五家全资子公司，分别是广发期货有限公司、广发控股（香港）有限公司、广发信德投资管理有限公司、广发乾和投资有限公司和广发证券资产管理（广东）有限公司，控股广发基金管理有限公司，参股易方达基金管理有限公司、广东金融高新区股权交易中心有限公司等公司，间接全资持有广发金融交易（英国）有限公司（伦敦金属交易所 LME 第一类交易会员）和广发证券（加拿大）有限公司，形成了以证券业务为核心、业务跨越境内外的金融控股集团架构。

截至 2016 年 6 月 30 日，广发证券注册资本 76.21 亿元，总资产 3,576.09 亿元，归属于上市公司股东的所有者权益 735.99 亿元；2016 年 1-6 月营业收入为 101.30 亿元，归属于上市公司股东的净利润为 40.30 亿元。资本实力及盈利能力在国内证券行业持续领先，总市值居国内上市证券公司前列。

广发证券设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经历，具备基金从业资格，员工的学历均在本科以上，专业分布合理，是一支诚实勤勉、积极进取的资产托管从业人员团队。

2、主要人员情况

孙树明先生自 2012 年 5 月起获委任为公司的董事长兼执行董事。孙先生的主要工作经历包括：1984 年 8 月至 1990 年 8 月历任中国财政部条法司科员、副主任科员及主任科员，1990 年 8 月至 1994 年 9 月任中国财政部条法司副处长，1994 年 9 月至 1996 年 3 月任中国财政部条法司处长，1994 年 7 月至 1995 年 7 月任河北涿州市人民政府副市长（挂职），1996 年 3 月至 2000 年 6 月任中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理，2000 年 6 月至 2003 年 3 月任中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，2003 年 9 月至 2006 年 1 月任中国银河证券有限公司监事会监事，2006 年 1 月至 2007 年 4 月任中国证监会会计部副主任，2007 年 4 月至 2011 年 3 月任中国证监会会计部主任，自 2015 年 3 月起兼任中证机构间报价系统股份有限公司副董事长。孙先生于 1984 年 7 月取得位于武汉的湖北财经学院（现名中南财经政法大学）经济学学士学位，并于 1997 年 8 月取得位于北京的财政部财政科学研究所经济学博士学位。

杨龙先生自 2014 年 5 月起获委任为本公司副总经理，其主要工作经历包括：1991 年 7 月至 1993 年 8 月任天津市政府研究室科员，1993 年 8 月至 1994 年 6 月任天津水利局办公室科员，1994 年 7 月至 1998 年 1 月任本公司深圳红宝路营业部总经理，1998 年 1 月至 2004 年 3 月任深圳业务总部总经理，2004 年 3 月至 2004 年 10 月任经纪业务总部常务副总经理兼深圳业务总部总经理，2004 年 10 月至 2005 年 3 月任人力资源部副总经理，2005 年 3 月至 2005 年 9 月任银证通营销中心总经理，2005 年 10 月至 2008 年 12 月任联通华建网络有限公司顾问，2009 年 1 月至 2014 年 9 月任本公司总经理助理（彼同时于

2009年10月至2012年11月任深圳分公司总经理以及于2011年9月至2011年12月任深圳高新南一道证券营业部总经理)。杨先生自2015年8月任广东广发互联小额贷款股份有限公司董事长。杨先生于1988年6月获得位于天津的南开大学经济学学士学位,于1991年7月获得位于北京的中共中央党校经济学硕士学位,于2013年5月取得香港科技大学高层管理工商管理硕士学位及于2003年12月取得位于天津的南开大学管理学博士学位。刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘先生于2000年7月获得北京大学理学学士,并于2003年7月获得北京大学经济学硕士学位。

3、基金托管业务经营情况

广发证券于2014年5月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责,不断加强风险管理和内部控制,确保基金资产的完整性和独立性,切实维护基金份额持有人的合法权益,提供高质量的基金托管服务。截至2016年6月,广发证券已托管宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、平安大华睿亨文娱灵活配置混合型证券投资基金15只证券投资基金。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

广发证券严格遵守国家有关托管业务的法律法规、监管规则和内部规章制度,防范和化解基金托管业务经营风险,保证托管资产的安全完整;维护基金份额持有人的合法权益;确保托管资产的运作及相关信息披露符合国家法律法规、监管规则及相关合同、协议的规定;保障托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部控制组织结构

广发证券风险控制委员会对资产托管业务的风险管理与内部控制进行监督和评价。广发证券风险管理部负责拟定风险管理政策、对业务进行风险监控和评估;广发证券合规与法律事务部负责托管业务法律审核与合规检查;广发证券稽核部对托管业务的内部控制进行独立、客观的检查和监督。资产托管部设置专门的内部控制岗,配备了专职监察稽核人员,对业务的运行独立行使监督稽核职权。各业务岗位在各自范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部控制制度及措施

广发证券制订了完善的托管业务管理制度,包括《广发证券资产托管业务管理办法(2016年9月修订)》、《广发证券证券投资基金托管业务操作规程》、《广发证券证券投资基金托管业务会计核算规定》、《广发证券证券投资基金托管业务基金清算管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务投资监督管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务信息披露管理规定》、《广发证券资产托管业务印章及加密设备管理规定》、《广发证券资产托管业务授权管理办法》、《广发证券证券投资基金托管业务系统维护管理规定》、《广发证券资产托管部岗位备份及员工轮岗管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务保密与档案管理规定》、《广发证券证券投资基金托管业务重大可疑情况报告规定》、《广发证券证券投资基金托管业务应急处理流程》、《广发证券证券投资基金托管业务

从业人员管理规定》、《广发证券资产托管部员工投资证券投资基金管理办法》等。确保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，防止人工操作风险，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

根据《基金法》等有关法律法规以及基金合同、基金托管协议相关规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》等有关法律法规或基金合同、基金托管协议相关规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销中心：长信基金管理有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼

法定代表人：叶焯 联系人：王瑞英

电话：021-61009916 传真：021-61009917

客户服务电话：400-700-5566 公司网站：www.cxfund.com.cn

2、场外代销机构

（1）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 联系人：张宏革

电话：021-58781234 传真：021-58408483

客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com

（2）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

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

电话：021-61618888 传真：021-63604199

客户服务电话：95528 网址：www.spdb.com.cn

（3）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：张莉
电话：0755-22166118 传真：0755-25841098
客户服务电话：95511-3 网址：bank.pingan.com

(4) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人：尤习贵 联系人：李良
电话：027-65799999 传真：027-85481900
客户服务电话：95579 或 4008-888-999 网址：www.95579.com

(5) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼
办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼
法定代表人：刘学民 联系人：吴军
电话：0755-23838751 传真：0755-25831754
客户服务电话：95358 网址：www.firstcapital.com.cn

(6) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号
办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号
法定代表人：范力 联系人：陆晓
电话：0512-62938521 传真：0512-65588021
客户服务电话：400 860 1555 网址：www.dwzq.com.cn

(7) 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 联系人：刘晨
电话：021-22169999 传真：021-22169134
客户服务电话：95525 网址：www.ebscn.com

(8) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层
办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层
法定代表人：黄金琳 联系人：张腾
电话：0591-87383623 传真：0591-87383610
客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591） 网址：www.hfzq.com.cn

(9) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼
办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明 联系人：黄岚
电话：020-87555888 转各营业网点 传真：020-87557985
客户服务电话：95575 或致电各地营业部 网址：www.gf.com.cn

(10) 国金证券股份有限公司
注册地址：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、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058 传真：028-86690126
客户服务电话：95310 网址：www.gjq.com.cn

(11) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 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
法人代表人：杨德红 联系人：芮敏祺
电话：95521 传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666 网址：www.gtja.com

(12) 华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号
办公地址：合肥市蜀山区南二环 959 号 B1 座华安证券
法定代表人：李工 联系人：汪燕
电话：0551-5161666 传真：0551-5161600
客户服务电话：96518、400-80-96518 网址：www.hazq.com

(13) 华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层
法定代表人：陈林 联系人：刘闻川
电话：021-68777222 传真：021-68777822
客户服务电话：400-820-9898 网址：www.cnhbstock.com

(14) 华龙证券股份有限公司
注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦
法定代表人：李晓安 联系人：邓鹏怡
电话：0931-4890208 传真：0931-4890628
客户服务电话：4006898888 网址：www.hlzqgs.com.cn

(15) 江海证券有限公司
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人：孙名扬 联系人：高悦铭
电话：0451-82336863 传真：0451-82287211

客户服务电话：400-666-2288 网址：www.jhzq.com.cn

(16) 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

办公地址：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：0791-86768681 传真：0791-86770178

客户服务电话：400-8866-567 网址：www.avicsec.com

(17) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)

法定代表人：杨宇翔 联系人：周一涵

电话：0755-22626391 传真：0755-82400862

客户服务电话：95511—8 网址：www.stock.pingan.com

(18) 中泰证券股份有限公司

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：王霖

电话：0531-68889155 传真：0531-68889752

客户服务电话：95538 网址：www.qlzq.com.cn

(19) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号上海证券

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄 联系人：许曼华

电话：021-53519888 传真：021-53519888

客户服务电话：4008918918、021-962518 网址：www.962518.com

(20) 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 40 层

法定代表人：李梅 联系人：黄莹

电话：021-33389888 传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523 网址：www.swhysc.com

(21) 天风证券股份有限公司

注册地址：中国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

法定代表人：余磊 联系人：翟璟

电话：027-87618882 传真：027-87618863

客服电话：028-86711410 网址：www.tfzq.com

(22) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层
法定代表人：林义相 联系人：尹伶
电话：010-66045529 传真：010-66045518
客户服务电话：010-66045678 网址：www.txsec.com

(23) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号
办公地址：上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号
法定代表人：贾绍君 联系人：汪尚斌
电话：021-36533017 传真：021-36533017
客户服务电话：400-8811-177 网址：www.xzsec.com

(24) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号
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 联系人：夏中苏
电话：021-38565785
客户服务电话：400-8888-123 网址：www.xyzq.com.cn

(25) 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
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层
法定代表人：宫少林 联系人：黄婵君
电话：0755-82960223 传真：0755-82943121
客户服务电话：95565 或 400-8888-111 网址：www.newone.com.cn

(26) 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 联系人：宋明
电话：010-66568888 传真：010-66568990
客户服务电话：4008-888-888 网址：www.chinastock.com.cn

(27) 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 联系人：张颢
电话：010-85130588 传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108 网址：www.csc108.com

(28) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

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 联系人：侯艳红

电话：010-60838888 传真：010-60833739

客户服务电话：95558 网址：www.citics.com

(29) 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（266061）

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（266061）

法定代表人：杨宝林 联系人：吴忠超

电话：0532-85022326 传真：0532-85022605

客户服务电话：95548 网址：www.citicssd.com

(30) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良 联系人：罗艺琳

电话：0755-83734659 传真：0755-82960582

客户服务电话：4001022011 网址：www.zszq.com.cn

(31) 信达证券股份有限公司

注册地址：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：张志刚 联系人：鹿馨方

电话：010-63081000 传真：010-63080978

客服热线：95321 网址：www.cindasc.com

(32) 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：吴坚 联系人：张煜

电话：023-63786633 传真：023-63786212

客服热线：4008096096 网址：www.swsc.com.cn

(33) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼

法定代表人：陈柏青 联系人：韩爱彬

电话：0571-81137494 传真：4000-766-123

客户服务电话：4000-766-123 网址：www.fund123.cn

(34) 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 联系人：马良婷

电话：021-20691832 传真：021-20691861
客户服务电话：400-820-2899 网址：www.erichfund.com

(35) 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：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801
法定代表人：汪静波 联系人：徐诚
电话：021-38602377 传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399 网址：www.noah-fund.com

(36) 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：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室
法定代表人：杨文斌 联系人：苗汀
电话：021-58870011 传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665 网址：www.ehowbuy.com

(37) 和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址：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：吴卫东
电话：021-68419822 传真：021-20835779
客户服务电话：400-920-0022 网址：www.licaike.com

(38) 上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 7 楼
法定代表人：其实 联系人：朱钰
电话：021-54509998 传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188 网址：fund.eastmoney.com

() 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼
法定代表人：凌顺平 联系人：吴强
电话：0571-88911818 传真：0571-86800423
客户服务电话：4008-773-772 公司网站：www.5ifund.com

(39) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
法定代表人：冯修敏 联系人：陈云卉
电话：021-33323999-5611 传真：021-33323830
客户服务电话：4008202819 网址：www.chinapnr.com

(40) 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 联系人：宁博宇

电话：021-20665952 传真：021-22066653

客户服务电话：4008219031 网址：www.lufunds.com

(41) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明 联系人：朱真卿

电话：021-22267943 传真：021-22268089

客户服务电话：400-928-2266 网址：www.dtfortune.com

(42) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼

法定代表人：燕斌 联系人：陈东

电话：021-52822063 传真：021-52975270

客户服务电话：400-046-6788 网址：www.66zichan.com

(43) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼

法定代表人：刘惠 联系人：毛林

电话：021-80133597 传真：021-80133413

客户服务电话：4008081016 网址：www.fundhaiyin.com

(44) 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 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武 联系人：葛佳蕊

电话：021-80365020 传真：021-63332523

客户服务电话：4006433389 网址：www.lingxianfund.com

(45) 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：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟 联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533 传真：86-021-50583633

客户服务电话：400-067-6266 网站：<http://a.leadfund.com.cn/>

(46) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3451
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人：肖雯 联系人：钟琛
电话：020-89629012 传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066 网站：www.yingmi.cn

(47) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
法定代表人：王伟刚 联系人：丁向坤
电话：18001102931 传真：010-62680827
客户服务电话：400-619-9059 网站：www.fundzone.cn

3、场内销售机构

场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站：
<http://www.sse.com.cn>

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 其他相关机构

信息类型 登记机构 律师事务所 会计师事务所
名称 中国证券登记结算有限责任公司 上海源泰律师事务所 毕马威华振会计师事务所
注册地址 北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层
办公地址 北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼
法定代表人 周明 廖海（负责人） 姚建华
联系电话 010-59378856 021-51150298 021-22122888
传真 010-59378907 021-51150398 021-62881889
联系人 崔巍 廖海、刘佳 王国蓓（王国蓓、虞京京为经办注册会计师）

四、基金的名称

长信睿进灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

本基金通过积极灵活的资产配置，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、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，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：股票资产占基金资产的 0%-95%；债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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占基金资产的 5%-100%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金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，应当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。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。

2、股票投资策略

1) 行业配置策略

在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。

2) 个股投资策略

本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。

① 品质评估分析

品质评估分析是本基金管理人基于企业的全面评估，对企业价值进行的有效分析和判断。上市公司品质评估分析包括财务品质评估和经营品质评估。

② 风险因素分析

风险因素分析是对个股的风险暴露程度进行多因素分析，该分析主要从两个角度进行，一个是利用个股本身特有的信息进行分析，包括竞争引致的主营业务衰退风险、管理风险、关联交易、投资项目风险、股权变动、收购兼并等。另一个是利用统计模型对风险因素进行敏感性分析。

③ 估值分析

个股的估值是利用绝对估值和相对估值的方法，寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里我们主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折现模型、P/E 模型、EV/EBIT 模型、Franchise P/E 模型等估值模型针对不同类型的产业和个股进行估值分析，另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响，排除通胀的影响因素。

3、债券投资策略

本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

对于中小企业私募债券，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。

4、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。

（1）权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险，有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过权证标的股票基本面的研究，并结合期权定价模型，评估权证的合理投资价值，在有效控制风险的前提下进行权证投资；

本基金将通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略，杠杆交易策略等，利用权证进行对冲和套利等。

（2）资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录和损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析，形成对资产证券的风险和收益进行综合评估，同时依据资产支持证券的定价模型，确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上，本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率，对资产支持证券进行跟踪和测评，从而形成有效的风险评估和控制。

（3）股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{中证全债指数收益率} \times 40\%$

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于

货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月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 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

(一) 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	60,459,823.17	74.08
	其中：股票	60,459,823.17	74.08
2	基金投资	--	--
3	固定收益投资	--	--
	其中：债券	--	--
	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	20,911,555.87	25.62
8	其他资产	243,133.67	0.30
9	合计	81,614,512.71	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	20,702,238.76	26.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
E	建筑业	15,864.66	0.02
F	批发和零售业	4,303,370.01	5.45
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	5,003,667.74	6.33
J	金融业	21,003,202.00	26.59
K	房地产业	2,903,980.00	3.68
L	租赁和商务服务业	6,527,500.00	8.26
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 60,459,823.17 76.53

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

(三) 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	002625	龙生股份	165,000	7,124,700.00	9.02
2	601198	东兴证券	323,500	7,104,060.00	8.99
3	600990	四创电子	99,904	7,033,241.60	8.90
4	000796	凯撒旅游	350,000	6,527,500.00	8.26
5	601688	华泰证券	300,000	5,385,000.00	6.82
6	000034	神州数码	150,000	4,297,500.00	5.44
7	002544	杰赛科技	129,803	4,165,378.27	5.27
8	600369	西南证券	500,000	3,605,000.00	4.56
9	002500	山西证券	233,000	3,259,670.00	4.13
10	000718	苏宁环球	339,250	2,903,980.00	3.68

(四) 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。

(五) 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
本基金本报告期末未持有债券。

(六) 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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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
本基金本报告期末未投资贵金属。

(八) 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
本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中，四创电子（600990）的发行主体于 2015 年 12 月 23 日收到上海证券交易所下发的《关于对安徽四创电子股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》（纪律处分决定书（2015）56 号）。通报批评原因为公司办理股票延期复牌事项不审慎，其停牌期间的信息披露不充分，限制了投资者的正当交易权利，违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《股票上市规则》”）第 2.1 条、第 7.5 条、第 12.2 条的规定。公司时任董事会秘书作为公司信息披露事务部门负责人，对公司前述违规行为负有责任，其行为违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.2.2 条的规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

报告期内本基金投资的前十名证券中，华泰证券（601688）的发行主体于 2015 年 8 月 24 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（编号：渝证调查字 2015004 号），因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会决定对公司进行立案调查。

报告期内本基金投资的前十名证券中，西南证券（600369）的发行主体于 2016 年 6 月 23 日收到中国证监会下发的《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：深专调查通字 2016975 号）。因公司涉嫌未按规定履行职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）决定对公司立案调查。

对如上股票投资决策程序的说明：研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该责令整改事件发生后，本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余七名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产的构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 160,208.34

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 2,685.48

5 应收申购款 80,239.85

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 243,133.67

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 基金各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

1、长信睿进混合 A 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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

2015 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日 19.20% 2.66% 0.67% 1.56%
18.53% 1.10%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 3 月 31 日 -15.60% 3.37% -7.64% 1.46% -7.96% 1.91%

2016 年 4 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 -3.08% 1.74% -0.98% 0.61% -2.10% 1.13%

2016 年 7 月 1 日至 2016 年 9 月 30 日 -1.85% 1.02% 2.82% 0.48% -4.67% 0.54%

2、长信睿进混合 C 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 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

2015 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日 18.40% 2.67% 0.67% 1.56%
17.73% 1.11%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 3 月 31 日 -15.88% 3.37% -7.64% 1.46% -8.24% 1.91%

2016 年 4 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 -3.31% 1.74% -0.98% 0.61% -2.33% 1.13%

2016 年 7 月 1 日至 2016 年 9 月 30 日 -2.08% 1.02% 2.82% 0.48% -4.90% 0.54%

(二) 自基金合同生效以来基金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

1、长信睿进混合 A 自基金合同生效以来基金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

2、长信睿进混合 C 自基金合同生效以来基金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：1、图示日期为 2015 年 7 月 6 日至 2016 年 9 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

十三、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

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 1.5% 年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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 0.25% 的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，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 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.8%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.8% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费用

投资者在申购本基金时交纳申购费用，申购费用按申购金额采用比例费率。投资者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 A 类和 C 类基金份额的申购费率如下（场内外申购费率相同）：

基金份额类别 单笔申购金额（M，含申购费） 申购费率

A 类基金份额 M < 100 万元 1.5%

100 万元 ≤ M < 500 万元 1.0%

M≥500 万元 每笔 1000 元

C 类基金份额 0

2、赎回费用

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，本基金 A 类和 C 类基金份额的赎回费率如下（场内外赎回费率相同）：

费用种类 持有时间（Y） 赎回费率

A 类基金份额 Y<7 天 1.5%

7 天≤Y<30 天 0.75%

30 天≤Y<1 年 0.50%

1 年≤Y<2 年 0.25%

Y≥2 年 0

C 类基金份额 Y<30 天 0.5%

Y≥30 天 0

注：Y 为持有期限

对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

3、基金的转换费

本公司已开通了长信睿进混合基金与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信利丰债券基金、长信恒利优势混合基金、长信双利混合基金、长信量化先锋混合基金、长信内需成长混合基金、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信纯债壹号债券基金、长信多利混合基金、长信利保债券基金之间、长信利泰混合基金、长信先锐债券基金、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利信混合基金的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

根据中国证监会[2009]32 号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，本公司从 2010 年 4 月 23 日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下：

1、投资者进行基金转换时，转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

2、转换份额的计算公式：

（1）非货币基金之间转换

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时,补差费为零)

(2) 货币基金转至非货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益

补差费=转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(货币基金份额净值为 1.00 元,没有赎回费)

(3) 非货币基金转至货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-赎回费

转入确认份额=转入确认金额÷货币基金份额净值

(货币基金份额净值为 1.00 元,补差费为零)

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金原招募说明书(《长信睿进灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》)进行了更新,主要更新的内容如下:

- 1、在“三、基金管理人”部分,更新了基金管理人信息;
- 2、在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的基本信息;
- 3、在“五、相关服务机构”部分的内容,更新了代销机构的信息;
- 4、在“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分,更新了基金的转换信息;
- 5、在“十、基金投资组合报告”、“十一、基金的业绩”部分,根据基金定期报告更新了相应内容;
- 6、更新了“二十二、基金份额持有人服务”中的部分内容;
- 7、更新了“二十三、其它应披露的事项”部分的相应内容。

长信基金管理有限责任公司

2017年2月18日