

长城积极增利债券型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：中国建设银行股份有限公司

二〇一七年五月

长城积极增利债券型证券投资基金经 2011 年 1 月 21 日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】124 号文批准发起设立。

基金合同于 2011 年 4 月 12 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《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 2017 年 4 月 11 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 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、成立日期：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、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债

券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金等四十只基金。

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。现任上海银行独立非执行董事，上海市互联网金融行业协会会长，珠海华润银行股份有限公司独立非执行董事，通联支付网络股份有限公司董事。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党委书记、总裁，上海国际集团党委副书记、副董事长、总经理，国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长，证通股份有限公司董事长。

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

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。

杨斌先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司首席风险官、合规总监。曾任就职于中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处，自 1998 年 7 月至 2015 年 5 月先后于上海证监局稽查处、案件审理处、案件调查一处、机构监管一处、期货监管处、法制工作处等部门任职，历任科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长。

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。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、研究部总经理、投资决策委员会执行委员、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、“长城久富核心成长混合型证券投资基金

(LOF)”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

钟光正先生，经济学硕士。具有13年债券投资管理经历。曾就职于安徽安凯汽车股份有限公司、广发银行总行资金部、招商银行总行资金交易部。2009年11月进入长城基金管理有限公司，曾任债券研究员、长城货币市场证券投资基金基金经理、长城稳健增利债券型证券投资基金基金经理，现任公司总经理助理、固定收益部总经理、投资决策委员会委员。自2011年4月12日起担任“长城积极增利债券型证券投资基金”基金经理，自2012年8月至今任“长城保本混合型证券投资基金”基金经理，自2013年9月至今任“长城增强收益定期开放债券型

证券投资基金”基金经理，自 2015 年 1 月至今任“长城稳固收益债券型证券投资基金”基金经理，自 2015 年 11 月至今任“长城久祥保本混合型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 5 月 20 日起任“长城久利保本混合型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 6 月 21 日起任“长城久源保本混合型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 7 月 14 日起任“长城新视野混合型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 11 月 4 日起担任“长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 11 月 30 日起担任“长城久信债券型证券投资基金”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、研究部总经理、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。

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

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：何伟

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、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

联系人：张静

电话：010-66275654

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

联系人：李宏岩

电话：010-66107913

客户服务电话：95588

网址: www.icbc.com.cn

(3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址: 北京市海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人: 周慕冰

联系人: 马秀艳

电话: 010-85108206

传真: 010-85109230

客户服务电话: 95599

网站: www.abchina.com

(4) 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: 田国立

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

(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: 李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网站：www.cmbchina.com

(6) 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：陈秀良

电话：010-85238820

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(7) 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：闫竹冰

联系人：孔超

电话：010-66223588

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

网站: www.bankofbeijing.com.cn

(8) 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

(9) 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

联系人: 丰靖

电话: 010-65550827

传真: 010-65541230

客户服务电话: 95558

公司网站: <http://bank.ecitic.com/>

(10) 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

(11) 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：冯博

电话：021-50979511

传真：021-50979375

网址：<http://bank.pingan.com/>

客户服务电话：95511-3

(12) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东二路 585 号

办公地址：上海市中山东二路 585 号

法定代表人：陈辛

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-63370777

联系人：张萍

联系电话：021-63370888

网址：www.bankofshanghai.com

(13) 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

联系人：王璇

电话：0755-25188269

传真：0755-25188794

客服电话：4001961200

公司网站：www.961200.net

(14) 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：杨亢

电话：0769-22866270

传真：0769-22320896

客服电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

(15) 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

（16）泉州银行股份有限公司

注册（办公）地址：福建省泉州市云鹿路3号

法定代表人：傅子能

联系人：董培姗

电话：0595-22551071

客服电话：400-8896-312

公司网站：www.qzccb.com

（17）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

（18）武汉农村商业银行股份有限公司

住所：武汉市江岸区建设大道618号

法定代表人： 徐小建

联系人： 邹君

联系电话： 027-85497270

客服热线： 96555

网站： www.whrcbank.com

(19) 广发银行

办公地址： 广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人： 杨明生

联系人： 陈泾渭

联系电话： 020-3832256

传真： 020-87310955

客服电话： 400-830-8003

网站： www.cgbchina.com.cn

(20) 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

网站： www.csc108.com

客户服务电话： 4008888108

(21) 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

联系人：程丽辉

电话：021-23219991

传真：021-23219100

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

(22) 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：021-62580818-213

传真：021-62569400

客户服务电话：4008888666

(23) 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

(24) 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

电话：010-66568047

联系人：田薇

网站：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：4008-888-888

(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 A 座 38—45 层

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

(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：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-33830395

客户服务电话：4008816168

网址：www.pingan.com

(27) 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

(28) 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：杨玲

电话：0755-83025430

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

网站：www.hx168.com.cn

(29) 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

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

网站：www.guosen.com.cn

(30) 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

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：400-6515-988

网址：www.bhzq.com

(31) 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

联系人：谢高得

电话：021-38565785

客户服务热线：95562

网站: www.xyzq.com.cn

(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

电话: 010-84183333

传真: 010-84183311

客户服务电话: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

(33) 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

网站: www.gsstock.com

(34) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人: 李梅

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

（35） 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：020-88836999

传真：020-88836654

联系人：林洁茹

客户服务电话：020-961303

网站：www.gzs.com.cn

（36） 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.cscoc.com.cn

(37) 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：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(38) 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

(39) 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

(40) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-68816000

传真：021-68815009

联系人：李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(41) 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

网址：www.longone.com.cn

(42) 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：孙伟

客服电话：0471-4961259

网址：www.cnht.com.cn

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 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

联系人：刘莹

电话：029-87406649

客服热线：029-87419999

网址：www.westsecu.com.cn

(47) 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

(48) 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

网址：www.grzq.com

(49) 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

(50) 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 层

法定代表人：余政

电话：010-85127622

传真：010-85127917

联系人：赵明

客户服务电话：4006198888

网址：www.msza.com

(51) 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

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客户服务电话：95548

网站：www.cs.ecitic.com

(52) 九州证券有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦 6 楼

法定代表人：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.jzsec.com

(53) 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：400-898-9999

公司网站：www.hrsec.com.cn

(54) 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

(55) 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

(56) 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

客户服务热线：400-7121-212

网址：www.dtsbc.com.cn

(57) 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

(58) 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

(59) 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：广东省广州天河区大都会广场 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

(60) 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

(61) 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

(62) 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

(63) 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

(64) 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

(65) 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

(66) 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：张玉静

电话：0755-33227953

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(67) 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

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(68) 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

(69) 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：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

联系电话：021-54509998

客服电话：400-1818-188

公司网站：www.1234567.com.cn

(70) 众升财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

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：李艳

联系电话：010-59497361

传真：010-64788016

客服电话：400-059-8888

公司网站：www.zscffund.com

(71) 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

(72) 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

(73) 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

(74) 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：胡锴隼

联系电话：021-20613635

客服电话：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

(75) 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

(76) 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

(77) 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

(78) 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

(79) 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：李兴春

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533-3011

客服电话：400-921-7755

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(80) 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

(81) 深圳金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦

18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元

7 楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

电话：0755-66892301

传真：0755-66892399

客服电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

(82) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座

17 层

法定代表人：陈超

客服电话：400-0988-511/ 400-0888-816

公司网站：kenterui.jd.com

(83) 北京汇成基金销售有限公司

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：010-56282140

客服电话：400-619-9059

公司网站：www.fundzone.cn

(84) 南京苏宁基金销售有限公司

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

联系人：王锋

电话：025-66996699-887226

客服电话：95177

公司网站：www.snjijin.com

(85) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼

B 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼

B 座

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：13818306630

客服电话：400-821-0203

网址：www.520fund.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：0755-33256666

传真：0755-33206888

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：长城积极增利债券型证券投资基金

五、基金的类型和运作方式

本基金类型：债券型

本基金运作方式：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金将在控制组合风险和保持资产流动性的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票（包括中小板与创业板）、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具及其衍生工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转债所产生的权证等，以及法律法规或监管机构允许基金投资的其他权益类金融工具。

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。

本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产投资比例不低于基金资产净值的 80%，其中非政策性金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券等信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债除外）的投资比例不低于基金资产净值的 30%；股票等权益类资产投资比例不高于基金资产净值的 20%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

八、基金的投资策略

1. 大类资产配置策略

本基金为债券型基金，债券等固定收益类资产投资比例不低于基金资产净值的 80%，股票等权益类资产投资比例不高于基金资产净值的 20%。本基金将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置，主要通过对宏观经济运行周期、财政政策、货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响资本市场的重要因素进行研究和预测，分析债券市场、债券品种、股票市场、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，以控制系统性风险。本基金将择机利用债券回购交易放大组合债券资产杠杆，在严格控制信用风险、流动性风险的基础上增强基金整体收益。

2. 固定收益类资产投资策略

本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。

本基金将在科学的大类资产配置及券种配置、完整的信用评价系统和严格的投资风险管理基础上获取基准收益，同时争取获得超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。

本基金投资组合中固定收益类资产的超额收益主要通过以下几种策略实现：

（1）久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。本基金的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标包括GDP、CPI、PPI、固定资产投资、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量、新增贷款、新增存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将用于估计央行货币政策，以考察央行调整利率、存款准备金率，进行公开市场操作和窗口指导等操作对市场利率的影响程度。当预测利率和收益率水平上升时，建立较短平均久期组合或缩短现有固定收益类资产组合的平均久期；当预测利率和收益率水平下降时，建立较长平均久期组合或增加现有固定收益类资产组合的平均久期。本基金将在对

市场利率变动进行充分分析的基础上，选择建立和调整最优久期固定收益类资产组合。

（2）收益率曲线策略

本基金将在确定固定收益类资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

（3）个券选择策略

利率产品和信用产品是债券市场构成的两个方面，为了捕捉这两类债券品种在不同市场环境中可能出现的不同投资机会，突出基金管理人对于信用产品的整体配置能力和个券选择能力，本基金对于非政策性金融债、公司债、企业债、分离交易可转债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券等信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债除外）的投资比例不低于基金资产净值的 30%。

在对利率产品和信用产品的资产配置上，本基金将综合对宏观周期、利率市场、行业基本面和企业基本面等方面的分析结果，考察信用产品相对利率产品的信用溢价，结合市场情绪，动态调整信用产品的配置比例，获取超越业绩基准的超额收益。具体在个券选择方面，本基金将在信用风险管理基础上重点关注：预期信用评级上升的个券、具有某些特殊优势条款的个券、估

值合理的个券、信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券、经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。本基金将通过对个券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。

（4）把握市场低效或失效状况下的交易机会

在市场低效或失效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对固定收益类资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。

1) 新券发行溢价策略

在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。

2) 信用利差策略

不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，将会出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。

3) 套利策略

套利策略包括跨市场套利和跨期限套利。跨市场套利是指利用同一只固定收益类投资工具在不同市场（主要是银行间市场与交易所市场）的交易价差进行套利，从而提高固定收益类资产组合的投资收益。跨期限套利是指当短期回购利率低于长期回购利率时，可通过短期融资、长期融券实现跨期限套利。

（5）可转换债券投资策略

当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。

（6）债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求固定收益类资产的超额收益。

3. 权益类资产投资策略

本基金将以不高于基金资产净值 20% 的基金资产适度参与权益类资产投资。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转债所产生的权证等，以及法律法规或监管机构允许投资的其他权益类金融工具。

（1）新股申购策略

本基金将根据市场情况，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）策略主要是从上市公司基本面、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。

（2）权证投资策略

本基金不直接从二级市场买入权证，但可持有因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转换债券所产生的权证。本基金的权证投资策略主要是深入分析权证标的证券基本面，结合期权定价模型确定权证的投资价值。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。

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：中债综合财富指数。

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。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因

子，每日计算债券市场整体表现，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。

选择中债综合财富指数作为本基金的业绩比较基准，体现了基金产品本身的投资特征与目标客户群的风险收益偏好，且该指数合理、透明、公开，具有较好的市场接受度。

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的债券指数时，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

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为中低风险、中低收益的基金产品。

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2017年4月26日复核了本基金招募说明书更新中的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 12 月 31 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 - -

其中：股票 - -

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 4,539,364,954.30 98.07

其中：债券 4,539,364,954.30 98.07

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 8,114,669.56 0.18

8 其他资产 81,443,066.04 1.76

9 合计 4,628,922,689.90 100.00

2、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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 217,524,337.50 5.61

2 央行票据 - -

3 金融债券 454,261,000.00 11.72

其中：政策性金融债 - -

4 企业债券 3,550,359,111.80 91.63

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 317,023,000.00 8.18

7 可转债 197,505.00 0.01

8 同业存单 - -

9 其他 - -

10 合计 4,539,364,954.30 117.15

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 122494 15 华夏 05 2,000,000 201,140,000.00 5.19

2 136304 16 紫金 01 2,000,000 196,300,000.00 5.07

3 101570007 15 光明 MTN001 1,700,000 170,646,000.00 4.40

4 122444 15 冠城债 1,500,000 150,600,000.00 3.89

5 136012 15 梅花 02 1,500,000 148,935,000.00 3.84

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
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。

9、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

注：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。

(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。

(3) 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

10、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) 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 | 31,068.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | 221,325.35 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 78,724,167.05 |
| 5 | 应收申购款 | 2,466,505.14 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 81,443,066.04 |

(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不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

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较（截止 2016 年 12 月 31 日）

长城积极增利债券 A

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差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

自基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日 -4.00% 0.17% 4.50%

0.09% -8.50% 0.08%

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 12.50% 0.14% 3.60%

0.06% 8.90% 0.08%

2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 2.61% 0.16% -0.47%

0.09% 3.08% 0.07%

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 21.67% 0.28% 10.34%

0.11% 11.33% 0.17%

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 11.29% 0.32% 8.15%

0.08% 3.14% 0.24%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 1.90% 0.11% 1.85%

0.09% 0.05% 0.02%

自基金合同生效日起至 2016 年 12 月 31 日 52.90% 0.21%

30.97% 0.09% 21.93% 0.12%

长城积极增利债券 C

阶段 份额净值增长率① 份额净值增长率标准差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

自基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日 -4.30% 0.17% 4.50%

0.09% -8.80% 0.08%

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 11.91% 0.14% 3.60%

0.06% 8.31% 0.08%

2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 2.26% 0.16% -0.47%

0.09% 2.73% 0.07%

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 21.26% 0.28% 10.34%

0.11% 10.92% 0.17%

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 10.72% 0.31% 8.15%

0.08% 2.57% 0.23%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 1.48% 0.10% 1.85%

0.09% -0.37% 0.01%

自基金合同生效日起至 2016 年 12 月 31 日 49.23% 0.21%

30.97% 0.09% 18.26% 0.12%

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) 销售服务费：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- (4) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (5) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 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 0.65% 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，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 0.2% 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) 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 0.4%。

在通常情况下，本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

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基金销售服务费划付指令，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注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

基金销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

基金销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

(4)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

(1) 申购费率

1) 本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 A 类基金份额自 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：

A. 申购费率

申购金额（M，含申购费） A类份额申购费率

$M < 50$ 万 0.80%

$50 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$ 0.50%

$200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$ 0.30%

$M \geq 500$ 万元 1000 元/笔

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。

B. 特定申购费率

申购金额（M，含申购费） A类份额申购费率

$M < 50$ 万 0.16%

$50 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$ 0.10%

$200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$ 0.06%

$M \geq 500$ 万元 1000 元/笔

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，包括基本养老保险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。

2) 本基金 C 类基金份额不收取申购费用，但从 C 类基金份额的基金财产中计提销售服务费，销售服务费年费率为 0.4%。本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

(2) 申购份额的计算

① 申购 A 类基金份额，基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，申购份额的计算公式为：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 前端申购费率)

(注：对于 500 万(含)以上的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费用)

前端申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类基金份额净值

例：某投资者投资 20000 元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.100 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 = $20000 / (1 + 0.80\%) = 19841.27$ 元

前端申购费用 = $20000 - 19841.27 = 158.73$ 元

申购份额 = $19841.27 / 1.100 = 18037.52$ 份

即：投资者投资 20000 万元申购本基金的 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.100 元，则其可得到

18037.52 份基金份额。

②申购 C 类基金份额，不收取申购费用，申购份额的计算公式为：

申购份额 = 申购金额 / 申购当日 C 类基金份额净值

例：某投资者投资 20000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.100 元，则可得到的申购份额为：

申购份额 = 20000 / 1.100 = 18181.82 份

即：投资者投资 20000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.100 元，则其可得到 18181.82 份基金份额。

2. 赎回费用

(1) 赎回费率

本基金 A 类基金份额的最高赎回费率不超过 5%，赎回费率见下表：

A 类基金份额

持有年限 (Y) 赎回费率

Y < 1 年 0.10%

1 年 ≤ Y < 2 年 0.05%

Y ≥ 2 年 0%

注：上表中，1 年按 365 天计算。

C 类基金份额

赎回费率 持有期限在 30 日以内的基金份额，赎回费率为 0.10%；持有期限超过 30 日（含 30 日）的基金份额，不收取赎回费用。

注：本基金从 C 类基金份额的基金财产中计提销售服务费，销售服务费年费率为 0.4%。

赎回费总额扣除用于支付注册登记费和必要的手续费后余额计入基金财产，赎回费计入基金财产的比例不低于赎回费总额的 25%。

(2) 赎回金额的计算

本基金的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日（T 日）的基金份额净值为基准进行计算，计算公式如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

① 本基金 A 类基金份额赎回金额的计算：

例：某投资者赎回本基金 A 类基金份额 10000 份，持有时间为 50 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额 = $10000 \times 1.200 = 12000$ 元

赎回费用 = $12000 \times 0.10\% = 12$ 元

净赎回金额=12000-12.00=11988 元

即：投资者赎回本基金 A 类基金份额 10000 份，持有时间为 50 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为 11988 元。

②本基金 C 类基金份额赎回金额的计算：

例：某投资者赎回本基金 C 类基金份额 10000 份，持有时间为 30 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10000×1.200=12000 元

净赎回金额=12000 元

即：投资者赎回本基金 C 类基金份额 10000 份，持有时间为 30 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.200 元，则其可得到的赎回金额为 12000 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：某投资者持有本基金 A 类基金份额 10 万份，持有期为
100 天，决定转换为长城久泰沪深 300 指数证券投资基金，假
设转换当日转出基金（本基金 A 类基金份额）份额净值是
1.185 元，转入基金（长城久泰沪深 300 指数证券投资基金）
份额净值是 1.5800 元，转出基金对应赎回费率为 0.1%，申购
补差费率为 0.7%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.185=118,500 元

转出基金赎回费=118,500×0.1%=118.50 元

转入总金额=118,500-118.50=118,381.50 元

转入基金申购费补差=118,381.50-118,381.50/(1+0.7%)=
822.91 元

转入净金额=118,381.50-822.91=117,558.59 元

转入份额=117,558.59/1.58=74,404.17 份

基金转换费=118.50+822.91=941.41 元

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：某投资者持有长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 10 万份基金份额，持有期为 100 天，决定转换为本基金 A 类基金份额，假设转换当日转出基金（长城久泰沪深 300 指数证券投资基金）份额净值是 1.5800 元，转入基金（本基金 A 类基金份额）份额净值是 1.185 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 \times 1.58=158,000 元

转出基金赎回费=158,000 \times 0.5%=790 元

转入总金额=158,000-790=157,210 元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=157,210-0=157,210 元

转入份额=157,210/1.185=132,666.66 份

基金转换费=158,000 \times 0.5%=790 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。

（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、基金托管费率和销售服务费率。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。调低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。

（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《长城积极增利债券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 11 月 24 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、在第五部分“相关服务机构”中，更新了代销机构的信息。
- 4、在第六部分“基金的募集与基金合同的生效”中，增加了基金的类型。
- 5、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了基金的转换及定期定额投资的内容。
- 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 12 月 31 日的数据。
- 7、在第九部分“基金的业绩”中，披露了截至 2016 年 12 月 31 日本基金的业绩数据。
- 8、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。

2017年5月25日