

# 长信利鑫分级债券型证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

2016 年第【1】号

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

长信利鑫分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由基金管理人根据中国证券监督管理委员会证监许可【2011】603 号文核准募集。本基金合同于 2011 年 6 月 24 日正式生效。本基金为契约型分级债基金。

### 重要提示

本基金于 2011 年 4 月 27 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】603 号文核准募集。本基金合同于 2011 年 6 月 24 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金经基金份额分级后，自本基金基金合同生效之日起 5 年内，利鑫 A 为低风险、收益相对稳定的基金份额；利鑫 B 为较高风险、较高收益的基金份额。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。投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券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，由于基金投资者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，以及本基金投资策略所特有的风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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 2015 年 12 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人基本情况

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		
成立日期	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	<b>股东名称</b>	<b>出资额</b>	<b>出资比例</b>
	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%

### （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
叶焯	董事长	男	中共党员，经济学硕士，中南财经大学工业经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。2015年6月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司董事长。曾任职君安证券有限公司石家庄营业部总经理、公司副总裁，国泰君安证券股份有限公司武汉分公司总经理、资产委托管理部总监，长信基金管理有限责任公司总经理，长城证券有限责任公司总经理，长江证券股份有限公司董事、总裁，长江证券承销保荐有限公司董事长。
杨泽柱	董事	男	中共党员，博士研究生，曾任湖北省松滋县老城公社党委副书记、书记，松滋县检察院检察长，松滋县政府常务副县长、县委常委，巴东县政府县长、县委副书记，荆州地区(荆沙市)计委主任、党组副书记，荆沙市副市长，荆州市委常委、副市长、市行政学院院长，荆门市委副书记、副市长、市行政学院院长，荆门高新技术开发区党委第一书记，湖北省委台湾工作办公室、湖北省政府台湾事务办公室主任，湖北省国资委主任、党委书记，湖北省联合发展投资集团有限公司党委书记，湖北省人大常委会委员会委员、长江证券股份有限公司党委书记、董事长。
陈谋亮	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。
邹继新	董事	男	中共党员，高级工程师，大学学历，硕士学位。现任武汉钢铁(集团)公司党委常委、副总经理、武汉钢铁股份有限公司总经理。曾任武汉钢铁股份有限公司三炼钢厂副厂长兼总工程师，武汉钢铁股份有限公司总经理助理兼武汉钢铁股份有限公司炼钢总厂厂长，武汉钢铁股份有限公司副总经理兼制造部部长，武汉钢铁(集团)公司副总经理，武汉钢铁(集团)公司副总经理兼武汉钢铁股份有限公司总经理。
覃波	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。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。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>			

## 2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
余汉生	监事会主席	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。曾任武钢实业公司审计处处长、武钢实业公司财务处处长、武汉钢铁（集团）公司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。
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

			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。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>			

### 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。
宋小龙	副总经理	男	理学硕士，北京大学计算机软件专业研究生毕业，具有基金从业资格。2012年10月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会主任委员，兼任长信金利趋势混合型证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金和长信内需成长混合型证券投资基金的基金经理。曾任北京北大青鸟公司项目经理、富国基金管理公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。
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）。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、固定收益部总监，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和长

			信利保债券型证券投资基金的基金经理。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，先后任基金经理助理、交易管理部总监、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基金经理、总经理助理。
<b>注：</b> 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、李小羽先生自 2016 年 1 月 27 日起担任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，自 2016 年 1 月 29 日起担任长信利广灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。			

#### 4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
张文琍	基金经理	自基金合同生效之日起	高级工商管理硕士，上海财经大学 EMBA 毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理职务。现任固定收益部副总监、本基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金和长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理。

#### 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
宋小龙	副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信内需成长混合型证券投资基金和长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理
谈洁颖	投资管理部总监、投资决策委员会执行委员、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信新利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、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理



李小羽	副总经理、固定收益部总监、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和长信利保债券型证券投资基金的基金经理
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的基金经理
黄建中	专户投资部投资经理、投资决策委员会执行委员
朱君荣	专户投资部副总监、投资经理
高远	研究发展部副总监
易利红	交易管理部副总监
<b>注：</b> 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、李小羽先生自2016年1月27日起担任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，自2016年1月29日起担任长信利广灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	

### （三）内部组织结构及员工情况

内部组织结构及员工情况	
股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。	
公司经营管理层下设的委员会	内部控制委员会、投资决策委员会
公司内部组织结构	量化投资部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、交易管理部、基金事务部、零售服务部、机构业务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、专户理财部、国际业务部、产品开发部、电子商务部、财务管理部、机构服务部、专户投资部
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉办事处
员工总数	140人（截至2015年12月24日）

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年03月06日

组织形式：股份有限公司

注册资本：570 亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复【2006】484 号

基金托管业务批准文号：证监许可【2009】673 号

联系人：王瑛

联系电话：（010）68858126

## 2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工 20 人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

## 3、基金托管业务经营情况

2009 年 7 月 23 日，中国邮政储蓄银行获得中国证监会和中国银监会联合批复的证券投资基金托管资格，是我国第 16 家托管银行。2012 年 7 月 19 日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、高效的业务处理模式，为广大投资者和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2015 年 12 月 31 日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 44 只，包括中欧行业成长混合型证券投资基金 (LOF) (原中欧中小盘股票型证券投资基金 (LOF)) (166006)、长信纯债壹号债券型证券投资基金 (原长信中短债证券投资基金) (519985)、东方保本混合型开放式证券投资基金 (400013)、万家添利债券型证券投资基金 (LOF) (161908)、长信利鑫分级债券型证券投资基金 (163003)、天弘丰利债券型证券投资基金 (LOF) (164208)、鹏华丰泽债券型证券投资基金 (LOF) (160618)、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金 (400015)、长安宏观策略股票型证券投资基金 (740001)、金鹰持久增利债券型证券投资基金 (LOF) (162105)、中欧信用增利债券型证券投资基金 (LOF) (166012)、农银汇理消费主题股票型证券投资基金 (660012)、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 (519117)、天弘现金管家货币市



场基金（420006）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）、东方安心收益保本混合型证券投资基金（400020）、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金（519662）、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（166021）、银河灵活配置混合型证券投资基金（519656）、天弘通利混合型证券投资基金（000573）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（000552）、南方通利债券型证券投资基金（000563）、中邮货币市场基金（000576）、易方达财富快线货币市场基金（000647）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金（000774）、中邮核心科技创新灵活配置混合证券投资基金（000966）、中信建投凤凰货币市场基金（001006）、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金（001194）、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金（001183）、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金（001216）、易方达改革红利混合型证券投资基金（001076）、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金（001250）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金（001249）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金（001285）、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金（001210）、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金（001447）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金（001314）、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金（001431）、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金（001433）、南方利安灵活配置混合型证券投资基金（001570）、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金（002107）。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达 22,508.33 亿元。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

<b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>	
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：叶烨	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
<b>2、场外代销机构</b>	
(1) 中国邮政储蓄银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区金融大街3号	
办公地址：北京市西城区金融大街3号	
法定代表人：李国华	联系人：孙小雅
电话：010-68858101	传真：010-68858117
客户服务电话：95580	网址：www.psbc.com
(2) 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	
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号	
法定代表人：刘士余	联系人：刘一宁
传真：010-85109219	
客户服务电话：95599	网址：www.abchina.com
(3) 中国工商银行股份有限公司	
注册地址：中国北京复兴门内大街55号	
办公地址：中国北京复兴门内大街55号	
法定代表人：姜建清	联系人：李鸿岩
电话：010-66105662	
客户服务电话：95588	网址：www.icbc.com.cn
(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	
法定代表人：田国立	联系人：宋亚平
电话：010-66593657	
客户服务电话：95566	网址：www.boc.cn
(5) 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：010-67596084	
客户服务电话：95533	网址：www.ccb.com
(6) 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：张作伟
电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
(7) 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	
办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
法定代表人：李建红	联系人：林本
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
(8) 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
电话：021-61618888	传真：021-63604199
客户服务电话：95528	网址：www.spdb.com.cn
(9) 中信银行股份有限公司	
注册地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座	
办公地址：北京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：方爽
电话：010-65558888	
客户服务电话：95558	网址：bank.ecitic.com
(10) 重庆银行股份有限公司	
注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
法定代表人：马千真	联系人：孔文超
电话：023-63799379	传真：023-63792412
客户服务电话：(023)63836229	网址：www.cqcbank.com
(11) 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 号华夏银行大厦	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
法定代表人：吴建	联系人：刘军祥
电话：010-85238667	传真：010-85238680
客户服务电话：010-95577	网址：www.hxb.com.cn
(12) 汉口银行股份有限公司	

注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号	
法定代表人：陈新民	联系人：李星
电话：027-82656224	传真：027-82656236
客户服务电话：(027) 96558, 4006096558	网址：www.hkbchina.com
(13) 杭州银行股份有限公司	
注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦	
法定代表人：吴太普	联系人：严峻
电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
客户服务电话：96523, 400-8888-508	网址：www.hzbank.com.cn
(14) 平安银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
法定代表人：孙建一	联系人：张莉
电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
(15) 厦门银行股份有限公司	
注册地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
办公地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦	
法定代表人：吴世群	联系人：林黎云
电话：0592-5365735	传真：0592-5061952
客户服务电话：400-858-8888	网址：www.xmbankonline.com
(16) 安信证券股份有限公司	
注册地址：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	
法定代表人：牛冠兴	联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
客户服务电话：4008-001-001	网址：www.essence.com.cn
(17) 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：杨泽柱	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

(18) 大通证券股份有限公司	
注册地址: 辽宁省大连市中山区人民路 24 号	
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层	
法定代表人: 张智河	联系人: 谢立军
电话: 0411-39673202	传真: 0411-39673219
客户服务电话: 4008-169-169	网址: www.daton.com.cn
(19) 德邦证券有限责任公司	
注册地址: 上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼	
办公地址: 上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼	
法定代表人: 姚文平	联系人: 王志琦
电话: 021-68761616	传真: 021-68767032
客户服务电话: 400-8888-128	网址: www.tebon.com.cn
(20) 第一创业证券股份有限公司	
注册地址: 深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层	
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: 钟兴
电话: 0755-25832852	传真: 0755-25831754
客户服务电话: 400-888-1888	网址: www.firstcapital.com.cn
(21) 东莞证券有限责任公司	
注册地址: 东莞市莞城区可园南路 1 号	
办公地址: 东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼	
法定代表人: 张运勇	联系人: 乔芳
电话: 0769-22112062	传真: 0769-22119423
客户服务电话: 0769-961130	网址: www.dgzq.com.cn
(22) 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
(23) 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: 4008888788、10108998、95525	网址: www.ebscn.com

(24) 广州证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼	
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼	
法定代表人：邱三发	联系人：林洁茹
电话：020-88836999	传真：020-88836654
客户服务电话：020-961303	网址：www.gzs.com.cn
(25) 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
(26) 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
(27) 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10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10层	
法定代表人：常喆	联系人：李弢
电话：010-84183389	传真：010-84183311-3389
客户服务电话：400-818-8118	网址：www.guodu.com
(28) 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：成都市东城根上街95号	
法定代表人：冉云	联系人：刘一宏
电话：028-86690126	传真：028-86690126
客户服务电话：4006600109	网址：www.gjzq.com.cn
(29) 国联证券股份有限公司	
注册地址：江苏省无锡市县前东街168号	
办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号国联金融大厦702	
法定代表人：雷建辉	联系人：沈刚
电话：0510-82831662	传真：0510-82830162



客户服务电话：95570	网址：www.glsc.com.cn
(30) 国盛证券有限责任公司	
注册地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）	
办公地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）	
法定代表人：曾小普	联系人：陈明
电话：0791-6281061	传真：0791-6281061
客户服务电话：4008-222-111	网址：www.gsstock.com
(31) 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：021-38676666	传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666	网址：www.gtja.com
(32) 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 号国信证券大厦十六层至二十六层	
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
法定代表人：何如	联系人：周杨
电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
客户服务电话：95536	网址：www.guosen.com
(33) 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：李笑鸣
电话：021-23219000	传真：021-23219100
客户服务电话：400-8888-001 或 95553	网址：www.htsec.com
(34) 华安证券股份有限公司	
注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 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
(35) 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：刘闰川

电话：021-68777222	传真：021-68777822
客户服务电话：400-820-9898	网址：www.cnhbstock.com
(36) 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
(37) 华泰证券股份有限公司	
注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
法定代表人：吴万善	联系人：郭琳
电话：025-83290979	传真：025-84579763
客户服务电话：95597	网址：www.htsc.com.cn
(38) 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.jhjq.com.cn
(39) 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
(40) 平安证券有限责任公司	
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：石静武
电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511-8	网址：www.stock.pingan.com
(41) 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
(42) 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
(43) 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
(44) 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
(45) 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
(46) 西藏同信证券股份有限公司		
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
(47) 日信证券有限责任公司		
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号		

办公地址：北京西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层	
法定代表人：孔佑杰	联系人：陈文彬
电话：010-83991743	传真：010-66412537
客户服务电话：010-83991888	网址：www.rxzq.com.cn
(48) 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.xyjq.com.cn
(49) 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
(50) 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
(51) 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
(52) 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
(53) 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
（54）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
（55）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
（56）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：余维佳	联系人：张煜
电话：023-63786633	传真：023-63786212
客服热线：4008096096	网址：www.swsc.com.cn
（57）杭州数米基金销售有限公司	
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
（58）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

(59) 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
(60) 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
(61) 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
(62) 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
(63) 宜信普泽投资顾问(北京)有限公司	
注册地址: 北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809	
办公地址: 北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809	
法定代表人: 沈伟桦	联系人: 程刚
电话: 010-52855713	传真: 010-85894285
客户服务电话: 4006099400	网址: www.yixinfund.com
(64) 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



(65) 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
(66) 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
(67) 大泰金石投资管理有限公司	
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
(68) 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：凌秋艳
电话：021-52822063	传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788	网址：www.66zichan.com
<b>3、场内销售机构</b>	
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： <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	

注：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	注册登记机构	律师事务所	会计师事务所
名称	中国证券登记结算有限	上海源泰律师事务所	毕马威华振会计师事

	责任公司		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	金颖	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（石海云、陈 启明为经办注册会计 师）

#### 四、基金的名称

长信利鑫分级债券型证券投资基金

#### 五、基金的类型

契约型

#### 六、基金份额的分级

##### （一）基金份额的分级

本基金将基金份额持有人初始有效认购的基金份额按照不超过 2: 1 的份额配比，分为预期收益和预期风险不同的两级基金份额，即利鑫 A 和利鑫 B。自本基金基金合同生效之日起 5 年内，利鑫 A 和利鑫 B 的基金资产合并运作。

##### （二）基金份额的运作

###### 1、利鑫 A、利鑫 B 运作方式

本基金基金合同生效之日起 5 年内，利鑫 A 在基金合同生效后每满 6 个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。利鑫 A 的开放日原则上为自基金合同生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日（利鑫 A 的开放日以及开放办理申购与赎回业务的具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准）。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形

影响因素消除之日的下一个工作日。利鑫 A 的第一次开放日为基金合同生效日至 6 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第二次开放日为基金合同生效之日起至 12 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；以此类推。

利鑫 B 封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。利鑫 B 的封闭期为自基金合同生效之日起至 5 年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

## 2、利鑫 A 基金份额的折算

基金管理人可在基金份额折算基准日对利鑫 A 进行基金份额折算。折算后利鑫 A 的基金份额净值为 1.0000 元，基金份额持有人持有的利鑫 A 的份额数按折算比例相应增减。利鑫 A 的基金份额折算基准日与开放日为同一天。具体份额折算方法参照基金合同中“七、利鑫 A 的基金份额折算”以及基金管理人届时在指定媒体上发布的相关公告。

## 3、基金份额配比与规模控制

利鑫 A、利鑫 B 的份额分开募集、资产合并运作。本基金募集设立时，利鑫 A、利鑫 B 的份额配比原则上不超过 2:1。本基金基金合同生效之日起 5 年内，基金管理人可在基金份额折算基准日对利鑫 A 进行份额折算，并确保开放日利鑫 A 的基金份额净值为 1.0000 元，基金份额持有人持有的利鑫 A 的份额数按折算比例相应增减。在每一个开放日的下一个工作日，即 T+1 日，所有经确认有效的利鑫 A 的赎回申请全部予以成交确认，所有经确认有效利鑫 A 的申购申请，基金管理人按照历史累计申购份额数不超过历史累计赎回份额数的原则进行成交确认。

具体规模控制及其控制措施见招募说明书、发售公告以及基金管理人在指定媒体上发布的其他相关公告。

### (三) 利鑫 A、利鑫 B 基金份额收益分配规则

利鑫 A 根据基金合同的规定获取约定收益，其收益率将在每个开放日设定一次并公告。计算公式为：

利鑫 A 的年收益率（单利）=1.1×1 年期银行定期存款利率+0.8%

利鑫 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到以百分比计算的小数点后第 2 位。

在基金合同生效日当日，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率设定利鑫 A 的首次年收益率；在利鑫 A 的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定利鑫 A 的年收益率，且约定收益率为单利。

如届时法律法规及其他规定对 1 年期银行存款利息征收利息税，则利鑫 A 的年收益率（单利）的计算公式中“1 年期银行定期存款利率”指征税后的利率。例如：假设某一开放日中国人民银行公布的 1 年期银行定期存款利率为 2.5%，利息税为 5%，则 1 年期银行定期存款利率为  $2.5\% \times (1-5\%) = 2.375\%$ 。

本基金的净资产将优先支付利鑫 A 的本金及约定收益，在扣除利鑫 A 的应计收益后的全部剩余收益归利鑫 B 享有；如本基金的净资产等于或低于利鑫 A 的本金及其约定应得收益的总额，则本基金净资产全部分配予利鑫 A 后，仍存在额外未弥补的利鑫 A 本金及约定收益总和的差额，则不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证封闭期满时利鑫 A 份额持有人的约定应得收益，即如果在封闭期末本基金资产出现极端损失的情况下，利鑫 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金损失的风险。

#### （四）基金份额发售

利鑫 A、利鑫 B 将分别通过各自销售机构的销售网点独立进行公开发售。

#### （五）本基金的基金份额净值计算

本基金的基金份额净值计算公式如下：

$T$ 日基金份额净值 =  $T$ 日闭市后的基金资产净值 /  $T$ 日基金份额的余额数量

本基金基金合同生效之日起 5 年内， $T$ 日基金份额的余额数量为利鑫 A 和利鑫 B 的份额总额；本基金基金合同生效后 5 年期满并转为上市开放式基金（LOF）后， $T$ 日基金份额的余额数量为该 LOF 基金的份额总额。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （六）利鑫A和利鑫B的基金份额参考净值计算

本基金基金合同生效后5年期内，基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算并公告利鑫A和利鑫B的基金份额参考净值，其中利鑫A的基金份额参考净值计算日不包括利鑫A的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

#### 1、利鑫A的基金份额参考净值计算

本基金《基金合同》生效后5年期内，在利鑫A的非开放日（t日），设 $t_a$ 为自利鑫A上一次开放日（如t日之前利鑫A尚未进行开放，则为基金成立日）至t日的运作天数， $NV_t$ 为t日闭市后的基金资产净值， $F_{at}$ 为t日利鑫A的份额余额， $NAV_{at}$ 为t日利鑫A的基金份额参考净值， $r$ 为在利鑫A上一次开放日（如t日之前利鑫A尚未进行开放，则为基金成立日）设定的利鑫A的年收益率。

（1）如果t日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00元乘以t日利鑫A的份额余额加上t日全部利鑫A份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{at} = 1.00 \times \left( 1 + \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times t_a \right)$$

“t日全部利鑫A份额应计收益”计算公式如下：

$$t \text{ 日全部利鑫A 份额应计收益} = F_{at} \times 1.00 \times \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times t_a \quad (\text{下同})$$

以上各式中，运作当年实际天数指利鑫A上一次开放日（如t日之前利鑫A尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

（2）如果t日闭市后的基金资产净值小于“1.00元乘以t日利鑫A的份额余额加上t日全部利鑫A份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{at} = \frac{NV_t}{F_{at}}$$

## 2、利鑫 B 的基金份额参考净值计算

设  $NAV_{bt}$  为 t 日利鑫 B 的基金份额参考净值， $F_{bt}$  为 t 日利鑫 B 的份额余额，利鑫 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

$$NAV_{bt} = \frac{NV_t - NAV_{at} \times F_{at}}{F_{bt}}$$

利鑫 A、利鑫 B 的基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

t 日的利鑫 A 和利鑫 B 的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 t+1 日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### (七) 利鑫 A 与利鑫 B 开放日基金份额净值的计算

#### 1、利鑫 A 开放日基金份额净值的计算

本基金基金合同生效后，截止利鑫 A 的某一开放日或者利鑫 B 的封闭期届满日（T 日），设  $T_a$  为自利鑫 A 上一次开放日（如 T 日之前利鑫 A 尚未进行开放，则为基金成立日）至 T 日的运作天数， $NVT$  为 T 日闭市后的基金资产净值， $F_{aT}$  为 T 日利鑫 A 的份额余额， $NAV_{aT}$  为 T 日利鑫 A 的基金份额净值， $r$  为在利鑫 A 上一次开放日（如 T 日之前利鑫 A 尚未进行开放，则为基金成立日）设定的利鑫 A 的年收益率。

(1) 如果 T 日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00 元乘以 T 日利鑫 A 的份额余额加上 T 日全部利鑫 A 份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{aT} = 1.00 \times \left( 1 + \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a \right)$$

“T 日全部利鑫 A 份额应计收益”计算公式如下：

$$T \text{ 日全部利鑫 A 份额应计收益} = F_{aT} \times 1.00 \times \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a \quad (\text{下同})$$

以上各式中，运作当年实际天数指利鑫 A 上一次开放日（如 T 日之前利鑫 A 尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

(2) 如果 T 日闭市后的基金资产净值小于“1.00 元乘以 T 日利鑫 A 的份额



余额加上 T 日全部利鑫 A 份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{aT} = \frac{NV_T}{F_{aT}}$$

## 2、利鑫 B 的基金份额净值计算

设  $NAV_{bT}$  为 T 日利鑫 B 的基金份额净值， $F_{bT}$  为 T 日利鑫 B 的份额余额，利鑫 B 的基金份额净值计算公式如下：

$$NAV_{bT} = \frac{NV_T - NAV_{aT} \times F_{aT}}{F_{bT}}$$

利鑫 A、利鑫 B 的基金份额净值的计算，保留到小数点后 8 位，小数点后第 9 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### （八）利鑫 A 与利鑫 B 基金份额净值的公告

本基金《基金合同》生效后 5 年期内，在利鑫 A 的非开放日，本基金将公告利鑫 A 和利鑫 B 的基金份额参考净值；在利鑫 A 的开放日，本基金将公告利鑫 A 的基金份额净值和利鑫 B 的基金份额参考净值。

在利鑫 B 的 5 年封闭期届满日，本基金将公告利鑫 A 和利鑫 B 的基金份额净值。

## 七、利鑫 A 的基金份额折算

本基金基金合同生效之日起 5 年内，基金管理人可在利鑫 A 的折算基准日按以下规则进行基金份额折算。

### （一）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的所有利鑫 A 份额。

### （二）折算基准日

本基金基金合同生效之日起 5 年内利鑫 A 的基金份额折算基准日（T 日）与其开放日为同一天，原则上为自基金合同成立之日起每满 6 个月的最后一个工作日。（利鑫 A 的开放日以及开放办理申购与赎回业务的具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准）。基金份额折算基准日（T 日）的具体计算（主要

涉及到折算基准日（T日）折算前利鑫A基金份额净值的计算）见基金合同中

“四、基金份额的分级”中有关利鑫A的运作方式的相关内容。

### （三）折算频率

自基金合同生效之日起5年内，每满6个月的基金份额折算基准日折算一次。

本招募说明书更新期间，利鑫A于2015年12月23日进行了本基金的第九次份额折算。

### （四）具体折算方法

折算基准日日终，利鑫A的基金份额净值调整为1.0000元，折算后，基金份额持有人持有的利鑫A的份额数按照折算比例相应增减。

利鑫A的基金份额折算公式为：

$$\text{利鑫A的折算比例} = \frac{\text{折算基准日（T日）折算前利鑫A的基金份额净值}}{1.0000}$$
$$\text{利鑫A折算后的份额数} = \text{折算前利鑫A的份额数} \times \text{利鑫A的折算比例}$$

利鑫A折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前利鑫A的基金份额净值、利鑫A的折算比例的具体计算方法详见基金管理人届时发布的相关公告。

### （五）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停利鑫B的上市交易等业务，详见基金管理人届时发布的相关公告。

### （六）基金份额折算的公告

1、基金管理人须最迟于基金份额折算方案实施日前2日，在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

2、基金管理人应在基金份额折算结束后2日内，在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

## 八、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市交易

本基金基金合同生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，利鑫 B 的基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）份额后的基金份额经深圳证券交易所批准后将在深圳证券交易所上市交易。

### （二）上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

利鑫 B 上市后，登记在证券登记结算系统中的利鑫 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的利鑫 B 份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）份额后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

### （三）上市交易的时间

利鑫 B 已于 2011 年 9 月 23 日开始在深圳证券交易所上市交易（场内简称：利鑫 B；代码：150042）。

本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF）份额。本基金将自转换为上市开放式基金（LOF）之日起 45 日内开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### （四）上市交易的规则

- 1、利鑫 B 上市首日的开盘参考价为其前一工作日的基金份额参考净值；
- 2、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金上市首日的开盘参考价为前一个工作日的基金份额净值；
- 3、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 4、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 5、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 6、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

#### （五）上市交易的费用

本基金（本基金基金合同生效之日起 5 年内，指利鑫 B）上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

#### （六）上市交易的行情揭示

本基金（本基金基金合同生效之日起 5 年内，指利鑫 B）在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值（本基金基金合同生效之日起 5 年内，为利鑫 B 的基金份额参考净值）。

#### （七）上市交易的停复牌与暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金（本基金基金合同生效之日起 5 年内，指利鑫 B）的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

（八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

### 九、五年期届满基金的转换

### （一）五年期届满后基金的存续形式

本基金基金合同生效后5年期届满，无需召开基金份额持有人大会自动转换为上市开放式基金（LOF），本基金名称变更为“长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）”。利鑫A、利鑫B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

### （二）五年期届满基金转换时利鑫A的处理方式

本基金基金合同生效后5年期届满日，利鑫A份额的基金份额持有人可选择将持有的份额赎回、或转入“长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）”。若投资者不做选择，其持有的利鑫A份额将被默认转入“长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）”份额。

本基金基金合同生效后5年期届满日前，基金管理人将提前公告并提示利鑫A的基金份额持有人作出选择申请，利鑫A的基金份额持有人可在届时公告规定的时间内按照公告规定的方式作出选择申请。

### （三）五年期届满基金份额的转换规则

#### 1、份额转换基准日

本基金的份额转换基准日为基金合同生效后5年期届满日，即本基金基金合同生效之日起5年后的对应日，如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

#### 2、份额转换方式

在份额转换基准日，本基金转换成上市开放式基金（LOF）后的基金份额净值调整为1.0000元。在份额转换基准日日终，以份额转换后1.0000元的基金份额净值为基准，利鑫A、利鑫B按照各自的基金份额净值转换成上市开放式基金（LOF）份额。

本基金的份额转换计算公式：

利鑫A份额（或利鑫B份额）的转换比率=份额转换基准日利鑫A（或利

鑫 B) 的基金份额净值/1.0000

利鑫 A (或利鑫 B) 基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金 (LOF) 份额 = 基金份额持有人持有的转换前利鑫 A (或利鑫 B) 的份额数 × 利鑫 A 份额 (或利鑫 B 份额) 的转换比率

在进行份额转换时, 利鑫 A、利鑫 B 的场外份额将转换成上市开放式基金 (LOF) 场外份额, 且均登记在注册登记系统下; 利鑫 B 的场内份额将转换成上市开放式基金 (LOF) 场内份额, 仍登记在证券登记结算系统下。

在实施基金份额转换时, 利鑫 A 份额 (或利鑫 B 份额) 的转换比率、利鑫 A (或利鑫 B) 基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金 (LOF) 份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

### 3、份额转换后的基金运作

利鑫 A、利鑫 B 的份额全部转换为上市开放式基金 (LOF) 份额之日起 45 日内, 本基金将开始上市交易, 并接受场外与场内申购和赎回。份额转换后本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

### 4、份额转换的公告

(1) 在本基金基金合同生效后 5 年期届满日前 30 个工作日, 基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告。

(2) 本基金基金合同生效后 5 年期届满时, 本基金将转换为上市开放式基金 (LOF), 基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告, 并报中国证监会备案;

(3) 利鑫 A、利鑫 B 进行份额转换后, 基金管理人应在指定媒体公告, 并报中国证监会备案。

### (四) 五年期届满基金转换后的投资管理

本基金基金合同生效后 5 年期届满, 本基金转换为上市开放式基金 (LOF) 后, 本基金的投资目标、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等保持不变。



### （五）特殊情况下基金份额的转换

本基金基金合同生效之日起 5 年内，利鑫 A、利鑫 B 的基金份额持有人可以通过基金份额持有人大会申请转换基金的运作方式，基金份额持有人大会的具体召开方式参见基金合同中“基金份额持有人大会”部分。上述“转换时利鑫 A 的处理方式、基金份额的转换规则及基金转换后的投资管理”也同样适用于本情况下基金份额的转换。

## 十、基金的投资目标

本基金的投资目标是在严格控制投资风险与追求基金资产稳定增值的前提下，力争为各级投资者谋求与其风险公正匹配的投资回报。

## 十一、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、次级债、短期融资券、政府机构债、央行票据、银行同业存款、回购、可转债、可分离债、资产证券化产品等固定收益类金融工具。

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，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证及因投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类品种。

基金的投资组合比例为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如出现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。

## 十二、基金的投资策略

本基金 A、B 两级虽然分别募集及申购、赎回，但两级资金将融合一起来进行投资管理。

本基金根据对宏观经济、宏观调控政策走向以及各类资产市场风险收益特征及其演变趋势的综合分析、比较，首先采用类属配置策略进行大类资产的配置，在此基础上，再根据对各类资产风险收益特征的进一步分析预测，制定各自策略。

#### 1、类属资产配置策略

本基金根据对宏观经济、货币、财政政策走向以及各类资产的风险来源、收益率水平、利息税务处理和市场流动性等因素的综合分析，将市场细分为普通债券（含国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券等）、附权债券（含可转换公司债、各类附权债券等）、资产证券化产品、新股申购四个子市场，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权数，力求在较低风险下获得较高组合收益。

#### 2、普通债券投资策略

本基金根据自上而下和自下而上的分析方法对宏观经济和债券市场的走势做出分析。

自上而下：通过对基本面和资金面的分析对债券市场走势做出判断，以作为确定组合久期大小的依据。主要根据中长期的宏观经济走势和经济周期性特征，对收益率的未来变化趋势做出判断，从而对组合久期进行动态调整，以获取稳健的超越市场的投资收益。当中长期经济高速增长，通货膨胀压力浮现，央行政策趋于紧缩时，我们将缩短组合久期，以本金安全为主要策略；反之，在经济增长趋于回落，通货膨胀率下降，甚至通货紧缩出现时，我们将增加组合久期，以获取更高的票息和价差收益。

自下而上：通过对个券的分析来选择投资品种。主要根据各品种的收益率、流动性和信用风险等指标，挑选被市场低估的品种。在严控风险的前提下，获取稳定的收益。在确定债券组合久期之后，本基金将通过对不同信用类别债券的收益率基差分析，结合税收差异、信用风险分析、期权定价分析、利差分析以及交易所流动性分析，判断个券的投资价值，以挑选风险收益相匹配的券种，建立具体的个券组合。

本基金具体的普通债券投资策略主要有骑乘策略、息差策略及利差策略等。

#### (1) 骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度。若收益率曲线较为陡峭，则随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会有较大下滑，进而获得较高的资本利得。

#### (2) 息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

#### (3) 利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势做出判断，进而相应地进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

### 3、附权债券投资策略

#### (1) 可转换公司债券投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征。本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债种。本基金利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的安全性；本基金利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资

机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

在选择可转换债券品种时，本基金将与本公司的股票投研团队积极合作，深入研究，力求选择被市场低估的品种，来构建本基金可转换债券的投资组合。

## （2）其它附权债券投资策略

分离交易可转换公司债券，是认股权证和公司债券的组合产品，该产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易，即发行时是组合在一起的，而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。一方面，本基金因认购分离交易可转换公司债券所获得的认股权证可以择时卖出或行使新股认购权；另一方面，分离交易可转换公司债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

## 4、资产证券化产品投资策略

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

## 5、新股申购策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差。在我国证券市场上，新股申购是一种风险较低的投资方式。本基金将研究股票首次发行（IPO）股票及增发新股的上市公司基本面因素，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，从而制定相应的新股申购策略。

在新股变现上，本基金对新股实行择机变现策略，即根据对新股流通价格的分析和预测，结合股票市场发展态势，适时选择新股变现时机，以获取较好的股票变现收益。

## 十三、基金的业绩比较基准

### 1、本基金的业绩比较基准

中债综合指数。

## 2、选择业绩比较基准的理由

中债综合指数由在沪深证券交易所及银行间市场上市的国债、金融债、企业债、央行票据、及企业短期融资券所构成，该类人民币债券均为投资级以上，其剩余期限大于一个月，且付息方式均为固定利率付息和一次还本付息。中债综合指数样本每月调整一次，符合上述基本条件的债券自下个月第一个交易日起计入指数；不合格债券将在每月最后一个交易日被剔除。

由于本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，并以为投资者创造持续稳健投资收益为目标，因此以中债综合指数作为本基金的业绩比较基准能比较贴切体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

若未来市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告。

## 十四、基金的风险收益特征

总体上，本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

利鑫 A 级为低风险、收益稳定的基金份额；利鑫 B 级为较高风险、较高收益的基金份额。

## 十五、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定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 2015 年 9 月 30 日（摘自本基金 2015 年三季度报），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	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	619,124,770.70	95.96
	其中：债券	619,124,770.70	95.96
	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	9,735,606.06	1.51
8	其他资产	16,299,790.90	2.53
9	合计	645,160,167.66	100.00

**(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合**

本基金本报告期末未持有股票。

**(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  
投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	20,044,000.00	5.31
	其中：政策性金融债	20,044,000.00	5.31
4	企业债券	548,622,770.70	145.44
5	企业短期融资券	50,458,000.00	13.38



6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	619, 124, 770. 70	164. 13

**(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**

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	122762	11吴江债	200, 000	21, 920, 000. 00	5. 81
2	124137	13赣发投	199, 990	21, 640, 917. 90	5. 74
3	1480283	14仁怀城投债	200, 040	21, 572, 313. 60	5. 72
4	111063	11富阳债	202, 030	21, 176, 784. 60	5. 61
5	124370	13虞新区	200, 000	20, 944, 000. 00	5. 55

**(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持有贵金属。

**(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**

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

本基金本报告期末投资国债期货。

### （十一）投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

2、本基金本报告期末投资股票，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 3、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	43,925.79
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	16,255,865.11
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	16,299,790.90

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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。

## 十六、基金的业绩部分

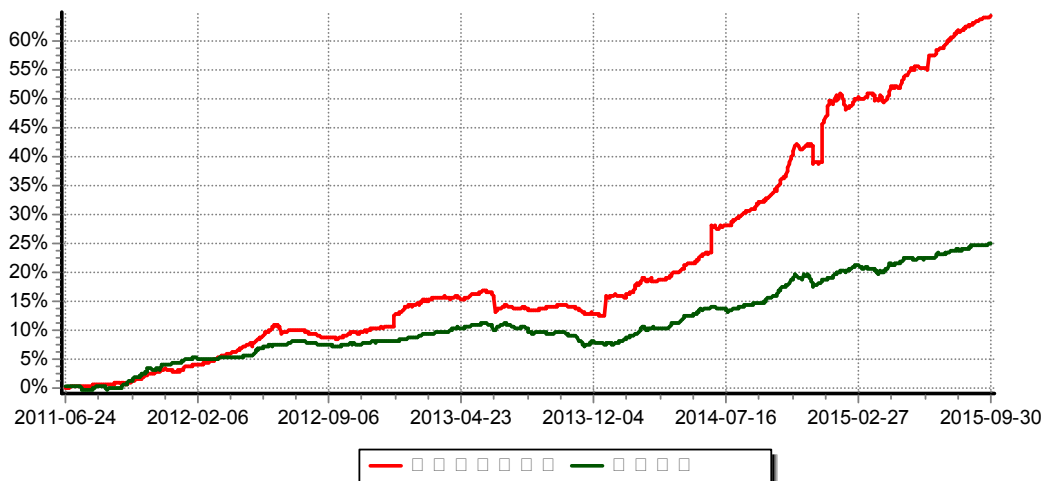
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说

说明书。

(一) 基金 2015 年第三季度及历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

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
2011年6月24日(基金合同生效日)至2011年12月31日	2.86%	0.07%	4.37%	0.10%	-1.51%	-0.03%
2012年1月1日至2012年12月31日	9.53%	0.16%	3.60%	0.06%	5.93%	0.10%
2013年1月1日至2013年12月31日	2.74%	0.26%	-0.47%	0.09%	3.21%	0.17%
2014年1月1日至2014年3月31日	2.47%	0.15%	2.46%	0.08%	0.01%	0.07%
2014年4月1日至2014年6月30日	7.57%	0.49%	3.28%	0.08%	4.29%	0.41%
2014年7月1日至2014年9月30日	4.82%	0.10%	1.65%	0.07%	3.17%	0.03%
2014年10月1日至2014年12月31日	9.92%	0.70%	2.58%	0.18%	7.34%	0.52%
2015年1月1日至2015年3月31日	1.82%	0.27%	0.74%	0.09%	1.08%	0.18%
2015年4月1日至2015年6月30日	5.11%	0.26%	2.35%	0.10%	2.76%	0.16%
2015年7月1日至2015年9月30日	4.42%	0.07%	2.10%	0.06%	2.32%	0.01%

(二) 自基金合同生效之日(2011年6月24日)至2015年9月30日期间, 本基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比:



注：1、本基金基金合同生效日为2011年6月24日，图示日期为2011年6月24日至2015年9月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。

### （三）其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2015年7月1日-2015年9月30日）
长信利鑫分级债A与长信利鑫分级债B基金份额配比	0.17468574：1
期末长信利鑫分级债A份额参考净值	1.0089
期末长信利鑫分级债A份额累计参考净值	1.1772
期末长信利鑫分级债B份额参考净值	1.6022
期末长信利鑫分级债B份额累计参考净值	1.6022
长信利鑫分级债A约定年收益率（单利）	3.28%

注：根据《基金合同》的规定，在基金合同生效日当日，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率设定利鑫A的首次年收益率；在利鑫A的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率重新设定利鑫A的年收益率，且约定收益率为单利。截至本报告期末，长信利鑫分级债A年收益率为3.28%，根据本合同成立后利鑫A的第八个开放日，即2015年6月23日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率2.25%的

1.1倍+0.8%（小数点后2位）进行计算。

## 十七、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；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的上市交易费用；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金年管理费率为年费率 0.70%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提。

计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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3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，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

## 2、基金托管人的托管费

本基金年托管费率为年费率0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提。

计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

## 3、基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

本基金年销售服务率为年费率0.35%。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.35%的年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

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款指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致



使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

4、上述（一）中第 4 到第 9 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （四）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。其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。基金募集期间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，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

#### （五）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

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。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；降低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率的，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体刊登公告。

#### （六）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关法律法规的规定进行公告或备案。

#### （七）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。

#### （八）与基金销售有关的费用

##### 1、利鑫 A 的申购、赎回费用

利鑫 A 自基金合同生效后 5 年内每满 6 个月的最后一个工作日开放一次，

接受投资者的申购与赎回申请。

利鑫 A 的申购、赎回费率为 0。

## 2、在基金合同生效后五年期届满转为 LOF 基金后的申购赎回费用

在基金合同生效后五年期届满转为 LOF 基金后，本基金不收取申购费用。本基金的赎回费用由基金赎回人承担。本基金的赎回费率最高不超过 5%。

### (1) 申购费用

本基金的申购费率为 0

### (2) 赎回费用

#### 1) 场内赎回费率

在基金合同生效后五年期届满转为 LOF 基金后，本基金场内赎回费率为固定 0.10%；

#### 2) 场外赎回费率

本基金在基金合同生效后五年期届满转为 LOF 基金后，本基金场外赎回费率如下表所示：

持有期限	赎回费率
90 天以内	0.10%
90 天以上（含 90 天）	0

(3) 基金合同生效后五年期届满，由原有利鑫 A、利鑫 B 份额转为 LOF 基金的场外份额不收取赎回费，由原有利鑫 A、利鑫 B 份额转为 LOF 基金的场内份额赎回费率为固定 0.10%。

(4) 基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在指定媒体公告。

## 十八、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》、《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，并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动，对本基金招募说明书（《长信利鑫分级债券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，对主要人员情况和内部组织结构及员工情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管业务经营情况有关资料；
- 3、更新了“五、相关服务机构”部分的相应内容，更新了代销机构的基本信息；
- 4、更新了“九、利鑫 A 的基金份额折算”中份额折算的时间；
- 5、更新了“十、基金份额的申购、赎回与转换”中本次利鑫 A 开放申购、赎回的情况；
- 6、更新“十四、基金的投资组合报告、十五、基金的业绩”中最近一期投资组合报告的内容和基金的投资业绩；
- 7、更新“二十七、其它应披露的事项”部分的相应内容，披露了本次更新以来涉及本基金的相关公告事项。

长信基金管理有限责任公司

2016年2月5日