

长信利丰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：中国农业银行股份有限公司

长信利丰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

委员会证监许可【2008】1252 号文核准募集。本基金基金合同于 2008 年 12 月 29 日正式生效。本基

金为债券型契约开放式基金。

重要提示

本基金经 2008 年 10 月 31 日中国证券监督管理委员会证监许可【2008】1252 号文核准募集。

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。

投资有风险，基金投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒

投资者，应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）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金投资要承担相应风险，

包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。

在投资者

作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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。

基金管理人不能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 29 日，有关财务数据和净值表现截至

2015 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国农业银行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

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 叶烨

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%

(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。曾任职君安证券股份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、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)公司市委常委、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。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

## 2、监事会成员

### 董事会成员

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。

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。

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。

注：

- 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

李小羽 基金经理 2008 年 12 月 29 日至今

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。

注：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。

#### 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

注：

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 29 日）

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。

中国农

业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行

网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务

功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信

誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商

业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足

县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分

支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大

客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国

SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业

银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强

能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获

“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保

险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安

全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律

师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上

金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2015 年 9 月 30 日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 306 只。

## (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、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,防止人为事故的发生,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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 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）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：邓炯鹏

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](http://www.spdb.com.cn)

( 9) 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 联系人: 姚健英  
电话: 010-58560666 传真: 010-57092611  
客户服务电话: 95568 网址: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

( 10) 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](http://bank.ecitic.com)

( 11) 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](http://www.cqcbank.com)

( 12) 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](http://www.hxb.com.cn)

( 13) 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](http://www.hkbchina.com)

( 14) 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](http://www.hzbank.com.cn)

( 15) 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

（16）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

（17）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

（18）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华 联系人：高峰

电话：0755-83516289 传真：0755-83515567

客户服务电话：400-6666-888 网址：www.cgws.com

（19）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

（20）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

（21）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

（22）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](http://www.firstcapital.com.cn)

（23）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军 联系人：沈燕

电话：021-63325888 传真：021-63326173

客户服务电话：95503 网址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

（24）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](http://www.dgzq.com.cn)

（25）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](http://www.dwzq.com.cn)

（26）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](http://www.ebscn.com)

（27）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](http://www.gzs.com.cn)

（28）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](http://www.hfzq.com.cn)

（29）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](http://www.gf.com.cn)

( 30) 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

( 31) 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

( 32) 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

( 33) 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

( 34) 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

( 35) 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

( 36) 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

( 37) 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

（ 38）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

（ 39）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

（ 40）华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层  
办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层  
法定代表人：马昭明 联系人：庞晓芸  
电话：0755-82492000 传真：0755-82492962  
客户服务电话：95513 网址：www.lhzq.com

（ 41）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

（ 42）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

（ 43）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

（ 44）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

（45）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

（46）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

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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

（51）湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼  
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼  
法定代表人：林俊波 联系人：钟康莺  
电话：021-68634518 传真：021-68865680

客户服务电话：400-888-1551 网址：www.xcsc.com

（52）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

（53）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

（54）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

（55）中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层

法定代表人：赵大建 联系人：姜建平

电话：010-59355543 传真：010-66553791

客户服务电话：40088-95618 网址：www.e5618.com

（56）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

（57）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

（58）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

（59）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](http://www.citicssd.com)

（60）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](http://www.zszq.com.cn)

（61）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](http://www.cindasc.com)

（62）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](http://www.swsc.com.cn)

（63）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](http://www.fund123.cn)

（64）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](http://www.erichfund.com)

（65）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](http://www.noah-fund.com)

（66）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  
(67)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  
(68)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

(69)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

(70)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

(71)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

(72)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

(73)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

（74）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

### 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>

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）与本基金有关的注册登记机构、律师事务所、会计师事务所信息：

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

有限责任公司 上海源泰律师事务所 毕马威华振 所 会计师事务

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

长信利丰债券型证券投资基金

### 五、基金的类型

契约开放式

### 六、基金的投资目标

通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，为投资者提供稳定增长的投资收益。

### 七、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、公司债券、企业债券、短

期融资券、可转换债券、资产支持证券、央行票据、回购、银行定期存单、股票、权证，以

及中国证监

会允许基金投资的其他金融工具。

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。

本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于公司债、企业债、短期

融资券等以企业为主体发行的债券资产投资比例不低于基金债券资产的 20%； 投资于股票等权

益类品种的比例不高于基金资产的 20%； 现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产

净值的 5%。

## 八、基金的投资策略

本基金为债券型基金，基金资产主要投资于固定收益类品种，其中投资于以企业为主体发行的债券不低于基金债券资产的 20%，并通过投资国债、金融债和资产支持证券等，增加企业债投

资组合的投资收益。

本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。

图：本基金投资策略体系

### 1、债券类资产投资策略

#### A、利率预期策略

基于对宏观经济、货币政策、财政政策等利率影响因素的分析判断，合理确定投资组合的目标久期，提高投资组合的盈利潜力。 如果预测利率趋于上升，则适当降低投资组合的修正久期；如

果预测利率趋于下降，则适当增加投资组合的修正久期。

#### B、收益率曲线策略

债券市场的收益率曲线随时间变化而变化，本基金将根据收益率曲线的变化，和对利率走势变化情况的判断，在长期、中期和短期债券间进行配置，并从相对变化中获利。 适时采用哑铃型、

梯型或子弹型投资策略，以最大限度地规避利率变动对投资组合的影响。

#### C、优化配置策略

根据基金的投资目标和管理风格，分析符合投资标准的债券的各种量化指标，包括预期收益指标、预期风险指标、流动性指标等，利用量化模型确定投资组合配置比例，实现既定条件下投资

收益的最优化。

#### D、久期控制策略

久期作为衡量债券利率风险的指标，反映了债券价格对收益率变动的敏感度。 本基金通过建

立量化模型，把握久期与债券价格波动之间的关系，根据未来利率变化预期，以久期和收益率变

化评估为核心，严格控制组合的目标久期。 根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加

组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债

券价格下降的风险。通过久期控制，合理配置债券类别和品种。

#### E、风险可控策略

根据公司的投资管理流程和基金合同，结合对市场环境的判断，设定基金投资的各项比例控制，确保基金投资满足合规性要求；同时借助有效的数量分析工具，对基金投资进行风险预算，使

基金投资更好地完成投资目标，规避潜在风险。

#### F、现金流管理策略

统计和预测市场交易数据和基金未来现金流，并在投资组合配置中考虑这些因素，使投资组合具有充分的流动性，满足未来基金运作的要求。本基金的流动性管理主要体现在申购赎回资金

管理、交易金额控制和修正久期控制三个方面。

#### G、对冲性策略

利用金融市场的非有效性和趋势特征，采用息差交易、价差交易等方式，在不占用过多资金的情况下获得息差收益和价差收益，改善基金资产的风险收益属性，获取更高的潜在收益。

息差

交易通过判断不同期限债券间收益率差扩大或缩小的趋势，在未来某一时点将这两只债券进行

置换，从而获取利息差额；买入较低价格的资产，卖出较高价格的资产，赚取中间的价差收益。

#### 2、可转换债券投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换

债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持

有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

#### 3、资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在

内的资产支持证券。本基金将在严格控制组合投资风险的前提下投资于这类金融工具。在具体

品种和分支的选择上，本基金主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、

证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券各个分支的风险与收益状况进行评估，

根据基金投资组合管理的目标选择合适的分支进行投资。

#### 4、新股申购投资策略

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。本基金对于

通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

## 5、股票投资策略

本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的个股选择策略。在“自上而下”的分析

中，本基金将在经济运行周期的分析框架下，通过国家分析和行业分析进行深度的研究和预测，

具体包括长期和短期的国家经济周期、行业特征、行业运行趋势、行业周期、产业政策等多因素的

分析和预测，确定各经济变量和其他影响因素的变动对各行业的潜在影响，寻找出最具投资价值的

行业。基于行业的分析选取，再对其中具有竞争力的上市公司进行投资。在“自下而上”的分析

中，本基金将在相对投资价值和投资时机分析的基础上，挑选具有投资价值和潜力的上市公司

公司。具体包括：长信品质分析模型、估值模型和风险收益分析三个方面。

（1）长信基金的品质评估模型包括：财务品质评估、经营品质评估，从多个角度的对上市公司

的情况进行分析和评估。在财务品质评估中，分析的因素包括：盈利能力、成长能力、股本扩张

能力、现金流量、营运能力、财务预警；在经营品质评估中，分析的因素包括：经营环境、公司竞争

力、管理能力、公司治理结构。

（2）估值分析；个股的估值主要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，

Franchise P/E 模型等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）风险因素分析；风险因素分析主要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。另一个是利用对风险的影响因

素，利用线性回归模型对风险因素进行敏感性分析。

## 6、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资；首先综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，对权证的合理价值做出判断；其次基于权证

的价值分析以及对权证标的股票未来走势的预期，对权证进行单向投资；最后基于权证价值对标

的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配

置进行结构性组合投资。

#### 九、基金的业绩比较基准

中证全债指数×90%+中证 800 指数×10%

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行

相应调整。

#### 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

#### 十一、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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 2015 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 624,771,532.64 17.15

其中：股票 624,771,532.64 17.15

2 基金投资 — —

3 固定收益投资 2,684,757,990.28 73.70

其中：债券 2,684,757,990.28 73.70

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 226,562,350.82 6.22

8 其他资产 106,753,897.03 2.93

9 合计 3,642,845,770.77 100.00

##### （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 — —

B 采矿业 — —

C 制造业 336,015,610.53 10.11

D 电力、热力、燃气及水生产

和供应业 — —

E 建筑业 1,610,000.00 0.05

F 批发和零售业 20,915,411.51 0.63  
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 233,058,337.40 7.01  
J 金融业 — —  
K 房地产业 — —  
L 租赁和商务服务业 16,518,600.00 0.50  
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 14,751,573.20 0.44  
S 综合 1,902,000.00 0.06  
合计 624,771,532.64 18.80

(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 600410 华胜天成 1,399,915 26,962,362.90 0.81  
2 300007 汉威电子 607,338 26,886,853.26 0.81  
3 002407 多氟多 696,500 25,457,075.00 0.77  
4 002466 天齐锂业 383,315 24,317,503.60 0.73  
5 300016 北陆药业 889,923 23,805,440.25 0.72  
6 002439 启明星辰 939,874 23,778,812.20 0.72  
7 300124 汇川技术 602,817 21,526,595.07 0.65  
8 002339 积成电子 1,169,976 21,071,267.76 0.63  
9 002405 四维图新 818,635 20,588,670.25 0.62  
10 300369 绿盟科技 549,950 18,588,310.00 0.56

(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 42,668,000.00 1.28  
2 央行票据 — —  
3 金融债券 341,711,799.80 10.28  
其中: 政策性金融债 341,711,799.80 10.28  
4 企业债券 1,767,578,397.48 53.19  
5 企业短期融资券 202,133,000.00 6.08  
6 中期票据 82,232,000.00 2.47  
7 可转债 248,434,793.00 7.48  
8 同业存单 — —  
9 其他 — —  
10 合计 2,684,757,990.28 80.78

(五) 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)	占基金例资(产%)	净值比
----	------	------	----	-----	---------	-----------	-----

1	113008	电气转债	1,604,940				
---	--------	------	-----------	--	--	--	--

			210,487,881.00	6.33			
--	--	--	----------------	------	--	--	--

2	150206	15 国开 06	2,000,000				
---	--------	----------	-----------	--	--	--	--

			201,340,000.00	6.06			
--	--	--	----------------	------	--	--	--

3	150416	15 农发 16	1,000,000				
---	--------	----------	-----------	--	--	--	--

			100,030,000.00	3.01			
--	--	--	----------------	------	--	--	--

4	1480284	14 武安债	500,000	54,425,000.00	1.64		
---	---------	--------	---------	---------------	------	--	--

5	1380005	13 资阳城投债	500,000	52,420,000.00	1.58		
---	---------	----------	---------	---------------	------	--	--

(六) 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  
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名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持有股指期货。

(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，多氟多（002407）的发行主体于 2015 年 2 月 3 日收

到深圳证券交易所中小板公司管理部《关于对多氟多化工股份有限公司未及时披露诉讼进展情

况的监管函》（中小板监管函【2015】第 10 号）。监管函认为，公司未及时披露诉讼进展情况的行

为违反了深交所《股票上市规则（2014 修订）》第 2.1 条、第 11.1.1 条、第 11.1.5 条的规定。对该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九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、本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定的备选股票库的情形。

3、其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 1,492,534.10

2 应收证券清算款 10,796,706.51

3 应收股利 —

4 应收利息 64,010,390.67

5 应收申购款 30,454,265.75

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 106,753,897.03

4、本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券

序号 债券代码 债券名称 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1 113008 电气转债 210,487,881.00 6.33

2 128009 歌尔转债 37,946,912.00 1.14

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、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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：

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1日至

2015年9月30日 -1.18% 0.96% -0.83% 0.33% -0.35% 0.63%

2015年4月1日至

2015年6月30日 8.46% 0.94% 3.53% 0.28% 4.93% 0.66%

2015年1月1日至

2015年3月31日 9.91% 0.63% 2.77% 0.19% 7.14% 0.44%  
 2014年10月1日至  
 2014年12月31日 14.93% 0.79% 6.00% 0.21% 8.93% 0.58%  
 2014年7月1日至  
 2014年9月30日 7.73% 0.40% 2.99% 0.10% 4.74% 0.30%  
 2014年1月1日至  
 2014年6月30日 7.66% 0.44% 4.57% 0.12% 3.09% 0.32%  
 2013年1月1日至  
 2013年12月31日 5.71% 0.49% -0.98% 0.17% 6.69% 0.32%  
 2012年1月1日至  
 2012年12月31日 12.77% 0.34% 3.95% 0.14% 8.82% 0.20%  
 2011年1月1日至  
 2011年12月31日 -6.92% 0.35% 2.17% 0.18% -9.09% 0.17%  
 2010年1月1日至  
 2010年12月31日 10.81% 0.33% 2.29% 0.18% 8.52% 0.15%  
 2009年1月1日至  
 2009年12月31日 3.74% 0.30% 6.53% 0.23% -2.79% 0.07%

(二)自合同生效之日(2008年12月29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、本基金合同生效日为2008年12月29日,图示日期为2008年12月29日至2015年9月30

日。

2、按基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。建仓期结

束时,本基金的各项投资组合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、与基金运作有关费用包括:

- (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;
- (4)基金合同生效后的信息披露费用;
- (5)基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费;
- (6)基金份额持有人大会费用;
- (7)基金的证券交易费用;
- (8)基金财产划拨支付银行费用;
- (9)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。

2、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:

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ , 本基金年管理费率为0.7%

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，支付日期顺延。

#### （2）基金托管人的基金托管费

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：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.2%

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，支付日期顺延。

#### （3）销售服务费

本基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。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，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$

H 为基金份额每日应计提的销售服务费

E 为基金份额前一日基金资产净值

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首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册

登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

4、上述（一）中 4 到 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

支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### 5、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。

6、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。降低基金管理费率和基金托管费率，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和基金管理人网站上刊登公告。

#### （二）与基金销售有关的费用

#### 1、申购费用

本基金不收取申购费用。

#### 2、赎回费用

本基金的赎回费用在基金投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率为 0.1%。

#### 3、基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整

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 日在至少一种指定媒体和基金管

理人的公司网站上公告。

#### 4、基金的转换费用

本公司已开通了长信利丰债券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）、长信纯债壹号债券基金、

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、长信多利混合

基金、长信睿进混合基金、长信利保债券基金之间的双向转换，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)

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的基金投资者定期

或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必

要手续后对基金投资者适当调整基金赎回费率和基金转换费率。

6、本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

#### 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》、《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（《长信利丰债券型

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，更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料；
- 3、在“五、相关服务机构”部分，更新了代销机构的信息；
- 4、在“八、基金份额的申购与赎回”部分，新增了可转换的基金信息及在熔断期间申购、赎回

业务时间安排的情况；

- 5、在“十、基金的投资组合报告”部分，更新了相应内容；
- 6、在“十一、基金的业绩”部分，更新了相应内容，并经托管人复核；
- 7、在“二十二、其它应披露的事项”部分，更新了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