

长信可转债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：平安银行股份有限公司

长信可转债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2012 年 1 月 4 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】6 号文核准募集。本基金的基金合同于 2012 年 3 月 30 日正式生效。

重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，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，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，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 2016 年 3 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 12 月 31 日（财务数据经审计）。本基金托管人平安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）基金管理人概况

基金管理人概况

名称 长信基金管理有限责任公司

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

办公地址 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

邮政编码 200120

批准设立机关 中国证券监督管理委员会

批准设立文号 中国证监会证监基金字[2003]63 号

注册资本 壹亿伍仟万元人民币

设立日期 2003 年 5 月 9 日

组织形式 有限责任公司

法定代表人 叶烨

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

叶烨 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。

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。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

2、监事会成员

监事会成员

姓名 职务 性别 简历

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基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理。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，长信利丰债券基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利保债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信利广混合基金的基金经理。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、长信中短债基金和长信纯债一年定开债券基金的基金经理、总经理助理。

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

4、基金经理

本基金基金经理情况

姓名 职务 任职时间 简历

李小羽 基金经理 自基金合同生效之日起 简历同上

刘波 基金经理 自基金合同生效之日起 经济学硕士，上海财经大学国防经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任太平养老股份有限公司投资管理部投资经理。2011年3月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信利息收益货币基金的基金经理。现任本基金、长信利众债券基金（LOF）、长信新利混合基金、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信利保债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信金葵纯债一年定开债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金和长信利泰混合基金的基金经理。

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、长信金利趋势混合基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理

谈洁颖 投资管理部总监、投资决策委员会执行委员、长信双利优选混合基金、长信新利混合基金、长信多利混合基金和长信睿进混合基金的基金经理

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、长信利丰债券基金、长信可转债债券基金、长信利富债券基金、长信利保债券基金、长信利广混合基金和长信金葵纯债一年定开债券基金的基金经理

薛天 国际业务部投资总监、投资决策委员会执行委员、长信标普 100 等权重指数基金（QDII）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 股票交易部副总监

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

注：自 2016 年 4 月 28 日起，谈洁颖女士不再担任长信新利混合基金的基金经理。

（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、股票交易部、债券交易部、基金事务部、零售服务部、机构业务部、机构服务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、财务管理部、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

分支机构 北京分公司、深圳分公司、武汉办事处

员工总数 151 人（截至 2016 年 3 月 30 日）

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：平安银行股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

成立日期：1987 年 12 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：1142489.4787 万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监许可[2008]1037 号

联系人：张波

联系电话：(0755) 2216 8073

平安银行股份有限公司（简称：平安银行，股票简称：平安银行，股票代码：000001）是由原深圳发展银行股份有限公司以吸收合并原平安银行股份有限公司的方式完成两行整合并更名而来，是中国内地首家向公众发行股票并公开上市的全国性股份制商业银行，总部设于深圳。中国平安保险（集团）股份有限公司及其子公司合计持有平安银行 59%的股份，为平安银行的控股股东。

截至 2015 年末，平安银行资产总额 25,071.49 亿元，较年初增长 14.67%。存款余额 17,339.21 亿元，较年初增加 13.09%。各项贷款（含贴现）12,161.38 亿元，较年初增幅 18.68%。营业收入 961.63 亿元，同比增长 31.00%；净利润 218.65 亿元，同比增长 10.42%；资本充足率 10.94%，一级资本充足率及核心一级资本充足率 9.03%，满足监管标准。

平安银行总行设资产托管事业部，下设市场拓展室、创新发展室、估值核算室、资金清算室、规划发展室、IT 系统支持室、督察合规室、外包业务中心 8 个处室，现有员工 51 人。

（二）主要人员情况

陈正涛,男,中共党员,经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师、国际注册私人银行家,具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行工作,具有本外币资金清算,银行经营管理及基金托管业务的经营管理经验。1985 年 7 月至 1993 年 2 月在武汉金融高等专科学校任教;1993 年 3 月至 1993 年 7 月在招商银行武汉分行任客户经理;1993 年 8 月至 1999 年 2 月在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理、行长助理;1999 年 3 月—2000 年 1 月在招行武汉分行青山支行任行长助理;2000 年 2 月至 2001 年 7 月在招行武汉分行公司银行部任副总经理;2001 年 8 月至 2003 年 2 月在招行武汉分行解放公园支行任行长;2003 年 3 月至 2005 年 4 月在招行武汉分行机构业务部任总经理;2005 年 5 月至 2007 年 6 月在招行武汉分行硚口支行任行长;2007 年 7 月至 2008 年 1 月在招行武汉分行同业银行部任总经理;自 2008 年 2 月加盟平安银行先后任公司业务部总经理助理、产品及交易银行部副总经理,一直负责公司银行产品开发与管理,全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作、营销和管理,尤其是对商业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011 年 12 月任平安银行资产托管部副总经理;2013 年 5 月起任平安银行资产托管事业部副总裁(主持工作);2015 年 3 月 5 日起任平安银行资产托管事业部总裁。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销中心：长信基金管理有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼

法定代表人：叶烨 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

2、场外代销机构

（1）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

（2）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

（3）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

（4）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明 联系人：张宏革

电话：021-58781234 传真：021-58408483

客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com

（5）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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

（6）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

（7）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

（8）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

（9）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

（10）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

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

（12）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

（13）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

（14）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

（15）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

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 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

(20) 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

(21) 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

（22）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

（23）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

（24）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

（25）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

（26）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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：合肥市蜀山区南二环 959 号 B1 座华安证券

法定代表人：李工 联系人：汪燕

电话：0551-5161666 传真：0551-5161600

客户服务电话：96518、400-80-96518 网址：www.hazq.com

(31) 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

(32) 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

（33）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

（34）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

（35）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

（36）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

（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

(38) 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

(39) 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

(40) 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

(41) 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

(42) 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

(43) 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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）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

（48）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

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(58) 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

(59) 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

(60) 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

(61) 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

(62) 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

(63) 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

(64) 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

(65) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼

法定代表人：刘惠 联系人：毛林

电话：021-80133597 传真：021-80133413

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

3、场内销售机构

场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站：

<http://www.sse.com.cn>

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

(二) 其他相关机构

信息类型 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 毕马威华振会计师事务所

注册地址 北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室 北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层

办公地址 北京市西城区太平桥大街 17 号 上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室 上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人 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（王国蓓、虞京京为经办注册会计师）

四、基金的名称

长信可转债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

本基金重点投资于可转换债券（含可分离交易可转债），主要运用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过积极主动的可转债投资管理，力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。

七、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）。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含可分离交易可转债）、债券回购、次级债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款等固定收益类金融工具。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股，也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券，并可持有由可转债转股获得的股票、因所持股票派发以及因投资可分离债券而产生的权证。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%，其中对可转债（含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%；对权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，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%。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

本基金主要投资于可转债品种，一方面利用可转债的债券特性，强调投资组合的安全性和稳定性，另一方面利用可转债的股票特性，分享股市上涨产生的较高收益。

（一）资产配置和类属资产配置策略

1、整体资产配置策略

本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场利率走势以及市场资金供求情况、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征，进而在固定收益类资产和权益类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

2、类属资产配置策略

本基金在整体资产配置策略的框架下，根据类属资产的收益率水平、风险来源、市场流动性、利息税务处理等因素，采取积极的投资策略，定期对投资组合类属资产进行优化配置，以寻求收益、风险、流动性之间的最佳平衡点。针对固定收益类资产，本基金将市场细分为可转债（含传统可转债、分离交易可转债等）、普通债券（含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券等）、资产支持证券三个子市场对基金资产进行动态优化配置。

（二）可转债投资策略

可转债即可转换公司债券，其投资者可以在约定期限内按照事先确定的价格将该债券转换为公司普通股。可转债同时具备普通股不具备的债性和普通债权不具备的股性。当标的股票下跌时，可转债价格受到债券价值的有力支撑；当标的股票上涨时，可转债内含的期权

使其可以分享股价上涨带来的收益。

基于行业分析、企业基本面分析和可转债估值模型分析，本基金在一、二级市场投资可转债，以达到控制风险，实现基金资产稳健增值的目的。

1、行业配置策略

可转债因内含期权价值使其与公司股票价格走势和波动率水平密切相关。本基金将综合考虑各种宏观因素，实现最优行业配置。

本基金以宏观经济走势、经济周期特征和阶段性市场投资主题的研究为基础，综合考量宏观调控目标、产业结构调整因素等，精选具有良好成长潜力和受益于政策扶持具有优良成长环境的公司发行的可转债进行投资布局。同时，结合经济和市场阶段性特征，动态调整不同行业的可转债进行投资。

2、个券精选策略

本基金将对所有可转债所对应的股票进行基本面分析，具体采用定量分析（如 P/E、P/B、PEG 等）和定性分析（公司治理结构、行业地位、竞争优势、创新能力等）相结合的方式精选具有良好成长潜力且估值合理的标的股票，分享标的股票上涨的收益。

首先，遵循价值投资理念，上市公司的行业景气度的提升能带动上市公司业绩增长，进而拉动上市公司股价上涨。标的股票的上涨将提升可转债的期权价值，进而推动可转债价格上涨。

其次，发行可转债的上市公司与同行业的对比以及是否具有稳定的收入和现金流。稳健的财务结构及稳定的收入和现金流是公司偿还债务的保证。本基金将重点考察公司的资产负债结构、流动比率和速动比率等数据指标对个券进行选择。

再次，分析发行可转债的上市公司在所属行业中的地位、公司的经营业绩和盈利能力。由于可转换债券的发行条件相对比较严格，目前发行可转债的上市公司不少是行业内的龙头企业，具有稳定的经营业绩和良好的盈利能力。经营业绩和盈利能力是衡量可转债投资价值的重要指标。一方面经营业绩的提升、盈利能力的增强可以带动公司股价上扬，进而拉升可转债的期权价值，使投资者获利；另一方面公司的经营业绩和盈利能力在一定程度上决定了公司的再融资难易程度。另外，公司的利润分配情况，是否有高派现、高转送的惯例及潜力也是本基金甄选个券的重要方法。

3、可转债投资时机的选择策略

当股市向好，可转债股票特性表现较为明显，可转债的市场定价重点考虑股性，其价格随股市上升而上涨超出债券成本价，本基金可选择二级市场卖出可转换债券以获取价差收益；当股市由弱转为强或发行可转债的公司基本面向好、业绩逐步好转，正股价格预计有较大提升时，本基金将可转债按转股价格转换为正股，分享公司业绩成长的红利或股价上涨带来的良好收益。当股市持续处于低迷状态，可转债的债券特征表现明显，市场定价更多考虑债性，此时可转债和正股的价格均下跌，二级市场卖出可转债以及可转债转换为股票均不合适，本基金将保留可转债以期获得到期固定本息收益。

4、转股策略

在转股期内，当本基金所持可转债市场价格显著低于转换价值时，即转股溢价率为负时，本基金将实现转股并卖出股票实现收益；当可转债流动性不足以满足投资组合的需要时，

本基金将通过转股保障基金财产安全；当正股价格上涨且满足提前赎回触发条件时，本基金将通过转股锁定已有收益，并通过进一步分析和预测正股未来走势，作出进一步投资决策。

5、条款博弈策略

可转债通常附有赎回、回售、转股修正等条款，其中赎回条款是发行人促进可转债转股的重要手段，回收和转股价向下修正条款则是对可转债投资者的保护性条款。这些条款在特定环境下对可转债价值有重要影响。本基金将根据可转债上市公司当前经营状况和未来发展策略，以及公司的财务状况和融资需求，对发行人的促进转股意愿和能力进行分析，把握投资机会。

6、低风险套利策略

按照可转债的条款设计，可转债根据事先约定的转股价格转换为股票，因此存在可转债和正股之间的套利空间。当可转债的转股溢价为负时，买入可转债并卖出股票获得价差收益；反之，买入标的股票并卖出可转债可以获得套利利差。本基金将密切关注可转债与正股之间的关系，择机进行低风险套利，增强基金投资组合收益。

（三）可分离交易可转债投资策略

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。可分离交易可转债的投资策略与传统可转债的投资策略类似。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；同时本基金通过调整纯债和认股权或标的股票之间的比例，组成不同风险收益特征的类可转债债券产品，并根据不同的市场环境适时进行动态调整。

（四）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。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。

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。

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。

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。

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。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。

（五）资产支持证券的投资策略

资产支持证券是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构性安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。资产支持证券的定价受市场利率、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，对资产支持证券的交易结构风险、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，投资于资产支持证券。

（六）股票投资策略

1、新股申购策略

本基金根据上市公司的基本面分析，评判企业的投资价值，从而决定一级市场新股申购策略。

2、股票二级市场投资策略

本基金可适当参与股票二级市场投资，增强基金资产收益。

本基金将严谨、规范化的选股方法和积极主动的投资风格相结合，在分析宏观经济和行业景气变化以及上市公司成长潜力的基础上，通过优选具有良好成长性、估值定价合理的股票进行投资，以谋求超额收益。

（七）权证的投资策略

本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面内容：1、以价值分析为基础，在采用数量化模型即市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准；2、根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择买入和卖出时机，实现稳健超额收益；3、利用权证衍生工具的特征，通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的。

九、基金的业绩比较基准

（一）本基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深300指数收益率*10%

（二）选择业绩比较基准的理由

中信标普可转债指数由中信标普指数公司推出，是国内较早编制的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。

中证综合债指数是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期

以下的国债、金融债和企业债，于 2008 年 11 月 12 日正式发布，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

由于本基金为债券型基金，主要投资于可转债债券等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，该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。

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指数，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。

2015 年 8 月 7 日起本基金业绩比较基准由“中信标普可转债指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%”变更为“中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率*10%”，关于业绩比较基准变更的事宜，我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

十、基金的风险收益特征

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。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2016 年 4 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 12 月 31 日（摘自本基金 2015 年年度报告）。

（一）期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
----	----	----	--------------

1	权益投资	132,876,789.90	14.38
---	------	----------------	-------

	其中：股票	132,876,789.90	14.38
--	-------	----------------	-------

2	固定收益投资	692,116,514.10	74.91
---	--------	----------------	-------

	其中：债券	692,116,514.10	74.91
--	-------	----------------	-------

	资产支持证券	—	—
--	--------	---	---

3 贵金属投资 — —

4 金融衍生品投资 — —

5 买入返售金融资产 — —

其中：买断式回购的买入返售金融资产 — —

6 银行存款和结算备付金合计 86,523,834.51 9.37

7 其他资产 12,360,751.55 1.34

8 合计 923,877,890.06 100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

（二）期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码 行业类别 公允价值 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 — —

B 采矿业 — —

C 制造业 76,816,257.35 10.68

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 — —

E 建筑业 3,325.04 —

F 批发和零售业 5,581,000.00 0.78

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 45,171,355.08 6.28

J 金融业 1,168,843.84 0.16

K 房地产业 1,044,256.14 0.15

L 租赁和商务服务业 32,729.64 —

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 208,687.20 0.03

S 综合 2,850,335.61 0.40

合计 132,876,789.90 18.47

2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

（三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1	300124	汇川技术	247,320	11,673,504.00	1.62
2	600410	华胜天成	386,500	10,246,115.00	1.42
3	300016	北陆药业	272,011	9,659,110.61	1.34
4	300146	汤臣倍健	162,600	6,260,100.00	0.87
5	002439	启明星辰	181,521	5,808,672.00	0.81
6	300253	卫宁软件	118,400	4,958,592.00	0.69
7	600588	用友网络	149,440	4,753,686.40	0.66
8	600822	上海物贸	300,000	4,503,000.00	0.63
9	002184	海得控制	96,948	4,169,733.48	0.58
10	300028	金亚科技	168,871	4,133,962.08	0.57
11	002339	积成电子	161,772	3,947,236.80	0.55
12	300005	探路者	165,800	3,796,820.00	0.53
13	300195	长荣股份	156,700	3,743,563.00	0.52
14	300171	东富龙	119,928	3,595,441.44	0.50
15	600699	均胜电子	115,000	3,593,750.00	0.50
16	000848	承德露露	211,600	3,491,400.00	0.49
17	002609	捷顺科技	142,860	2,980,059.60	0.41
18	600895	张江高科	98,867	2,850,335.61	0.40
19	300275	梅安森	75,370	2,743,468.00	0.38
20	000555	神州信息	56,800	2,391,280.00	0.33
21	000988	华工科技	109,172	2,312,262.96	0.32
22	300359	全通教育	25,382	2,185,897.84	0.30
23	002189	利达光电	59,000	2,134,620.00	0.30
24	000997	新大陆	77,000	1,949,640.00	0.27
25	600887	伊利股份	110,700	1,818,801.00	0.25
26	002405	四维图新	42,283	1,640,580.40	0.23
27	300007	汉威电子	44,099	1,508,185.80	0.21
28	002073	软控股份	84,000	1,419,600.00	0.20
29	002074	国轩高科	35,700	1,324,470.00	0.18
30	601688	华泰证券	59,272	1,168,843.84	0.16
31	600118	中国卫星	26,161	1,112,888.94	0.15
32	600998	九州通	55,000	1,078,000.00	0.15
33	300166	东方国信	30,500	976,915.00	0.14
34	600728	佳都科技	25,600	954,368.00	0.13
35	002385	大北农	65,800	803,418.00	0.11
36	002268	卫士通	13,125	737,756.25	0.10
37	600893	中航动力	16,200	729,486.00	0.10

38	000768	中航飞机	29,210	723,531.70	0.10
39	002488	金固股份	24,500	710,500.00	0.10
40	002664	信质电机	22,200	705,294.00	0.10
41	600745	中茵股份	16,800	688,464.00	0.10
42	002407	多氟多	8,900	678,714.00	0.09
43	300168	万达信息	20,000	662,600.00	0.09
44	002273	水晶光电	16,300	661,780.00	0.09
45	300369	绿盟科技	13,006	632,611.84	0.09
46	002230	科大讯飞	14,999	555,712.95	0.08
47	300353	东土科技	20,600	502,640.00	0.07
48	600085	同仁堂	9,800	437,178.00	0.06
49	300170	汉得信息	21,100	418,835.00	0.06
50	002410	广联达	19,600	356,328.00	0.05
51	600305	恒顺醋业	13,800	354,246.00	0.05
52	002146	荣盛发展	33,038	314,852.14	0.04
53	601126	四方股份	20,000	265,600.00	0.04
54	300246	宝莱特	5,320	219,716.00	0.03
55	300291	华录百纳	5,862	208,687.20	0.03
56	300378	鼎捷软件	3,500	203,770.00	0.03
57	300216	千山药机	2,700	119,016.00	0.02
58	300238	冠昊生物	2,000	113,340.00	0.02
59	600767	运盛医疗	2,000	40,940.00	0.01
60	002008	大族激光	1,436	37,178.04	0.01
61	002707	众信旅游	622	32,729.64	0.00
62	300400	劲拓股份	400	19,412.00	0.00
63	603555	贵人鸟	485	17,183.55	0.00
64	300020	银江股份	590	14,466.80	0.00
65	300024	机器人	200	13,700.00	0.00
66	600172	黄河旋风	253	6,403.43	0.00
67	002081	金螳螂	178	3,325.04	0.00
68	603456	九洲药业	32	2,275.52	0.00
69	300322	硕贝德	10	195.00	0.00
64	300020	银江股份	590	14,466.80	0.00
65	300024	机器人	200	13,700.00	0.00
66	600172	黄河旋风	253	6,403.43	0.00
67	002081	金螳螂	178	3,325.04	0.00
68	603456	九洲药业	32	2,275.52	0.00
69	300322	硕贝德	10	195.00	0.00

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1、累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期初基金资产净值比例(%)

1	601788	光大证券	116,778,549.06	11.67
2	300124	汇川技术	84,069,943.77	8.40
3	601688	华泰证券	83,716,219.39	8.37
4	600999	招商证券	76,840,758.20	7.68
5	300253	卫宁健康	68,085,236.50	6.80
6	600410	华胜天成	64,840,341.79	6.48
7	601901	方正证券	55,928,084.79	5.59
8	601555	东吴证券	51,003,772.15	5.10
9	300146	汤臣倍健	50,469,351.79	5.04
10	002407	多氟多	49,820,489.22	4.98
11	002073	软控股份	48,068,171.46	4.80
12	300369	绿盟科技	46,127,914.60	4.61
13	002268	卫 士 通	44,199,275.91	4.42
14	002339	积成电子	42,484,831.54	4.25
15	601377	兴业证券	39,526,445.80	3.95
16	300246	宝莱特	39,103,492.05	3.91
17	300016	北陆药业	39,019,882.21	3.90
18	601628	中国人寿	38,990,163.30	3.90
19	002385	大北农	37,131,441.44	3.71
20	601601	中国太保	35,545,698.40	3.55
21	300378	鼎捷软件	34,631,158.47	3.46
22	002189	利达光电	34,147,041.47	3.41
23	002496	辉丰股份	34,027,522.07	3.40
24	300077	国民技术	33,697,046.03	3.37
25	601336	新华保险	31,497,753.56	3.15
26	600998	九州通	31,264,623.11	3.12
27	600699	均胜电子	29,669,274.38	2.96
28	002236	大华股份	29,442,074.65	2.94
29	600271	航天信息	29,400,964.86	2.94
30	300007	汉威电子	28,920,438.67	2.89
31	603019	中科曙光	28,364,387.00	2.83
32	603555	贵人鸟	27,819,611.86	2.78
33	002184	海得控制	27,638,454.20	2.76

34	000768	中航飞机	25,175,149.16	2.52
35	000555	神州信息	25,018,917.27	2.50
36	002108	沧州明珠	24,743,251.52	2.47
37	600571	信雅达	24,736,033.30	2.47
38	002439	启明星辰	24,103,502.00	2.41
39	002405	四维图新	23,167,742.33	2.31
40	300207	欣旺达	22,604,613.78	2.26
41	300033	同花顺	21,948,193.76	2.19
42	300020	银江股份	21,284,302.58	2.13
43	300005	探路者	20,085,464.65	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

2、累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号 股票代码 股票名称 本期累计买入金额 占期初基金资产净值比例(%)

1	601788	光大证券	117,091,668.61	11.70
2	601688	华泰证券	84,835,918.66	8.48
3	600999	招商证券	75,577,624.01	7.55
4	300253	卫宁健康	75,006,704.91	7.49
5	300124	汇川技术	73,659,366.41	7.36
6	002407	多氟多	61,676,063.65	6.16
7	300246	宝莱特	59,357,611.34	5.93
8	002073	软控股份	58,248,703.21	5.82
9	600410	华胜天成	57,257,317.83	5.72
10	601901	方正证券	56,546,934.64	5.65
11	601555	东吴证券	51,548,807.52	5.15
12	300369	绿盟科技	49,603,295.41	4.96
13	002268	卫 士 通	46,382,943.41	4.63
14	002385	大北农	43,846,581.31	4.38
15	300146	汤臣倍健	41,407,448.37	4.14
16	002405	四维图新	40,412,253.36	4.04
17	601377	兴业证券	39,750,757.73	3.97
18	600998	九州通	39,143,262.93	3.91
19	002108	沧州明珠	38,866,226.38	3.88
20	601628	中国人寿	38,164,857.54	3.81
21	300007	汉威电子	37,587,030.35	3.76
22	002496	辉丰股份	37,307,166.34	3.73

23	300378	鼎捷软件	36,413,050.84	3.64
24	601601	中国太保	36,134,793.93	3.61
25	002189	利达光电	35,556,526.83	3.55
26	002339	积成电子	34,808,561.59	3.48
27	300016	北陆药业	32,305,746.86	3.23
28	600271	航天信息	31,116,461.12	3.11
29	601336	新华保险	30,956,056.91	3.09
30	603555	贵人鸟	30,818,501.65	3.08
31	600699	均胜电子	28,992,953.68	2.90
32	002236	大华股份	28,988,518.54	2.90
33	300207	欣旺达	27,235,676.38	2.72
34	000768	中航飞机	26,791,628.97	2.68
35	002081	金螳螂	26,359,319.58	2.63
36	600718	东软集团	25,448,346.29	2.54
37	300020	银江股份	23,766,336.20	2.37
38	000555	神州信息	22,305,274.44	2.23
39	300033	同花顺	21,991,506.20	2.20
40	603019	中科曙光	21,926,044.87	2.19
41	300077	国民技术	21,443,547.66	2.14
42	002184	海得控制	21,161,106.78	2.11
43	002094	青岛金王	20,540,291.42	2.05

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

3、买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额 2,563,221,243.30

卖出股票收入（成交）总额 2,630,932,374.68

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

（五）期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号 债券品种 公允价值 占基金资产净值比例（%）

1 国家债券 — —

2 央行票据 — —

3 金融债券 — —

其中：政策性金融债 — —

4	企业债券	52,618.40	0.01
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	233,129,001.30	32.40
7	其他	458,934,894.40	63.78
8	合计	692,116,514.10	96.19

（六）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

金额单位：人民币元

序号 债券代码 债券名称 数量（张） 公允价值 占基金资产净值比例（%）

1	126018	08 江铜债	4,643,680	458,934,894.40	63.78
2	113008	电气转债	1,693,390	233,129,001.30	32.40
3	132001	14 宝钢 EB	340	52,618.40	0.01

（七）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

（八）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。

（九）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。

（十）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。

（十一）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。

（十二）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，上海物贸（600822）的发行主体于 2015 年 12 月 23 日收到上海证券交易所下发的《关于对上海物资贸易股份有限公司和有关责任人予以纪律处分的决定》（纪律处分决定书（2015）54 号）。纪律处分原因为公司 2008 年至 2012 年的年度报告，均未能反映相关年度该公司经营的真实情况，影响了投资者对该公司财务状况、经营成果等进行正确判断，属于信息披露文件中记载的事实与真实情况不符情形，该公司信息披露存在虚假记载，违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《股票上市规则》”）第 1.4 条、第 2.1 条、第 2.5 条、第 2.7 条、第 11.12.5 条和《企业会计准则》第十二条、第十七条、第十八条、第十九条等有关规定。有关责任人的行为违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.1.5 条、第 3.2.2 条的规定以

及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。该公司于 2015 年 6 月 12 日收到中国证监会上海监管局下发的《行政处罚决定书》（沪[2015]5 号），处罚原因为 2012 年年度报告存在虚假记载，且在发现全资子公司上海燃料发生重大亏损时，也未按照《上市公司信息披露管理办法》第三十三条第一款的规定及时履行信息披露义务，违反《证券法》第六十三条以及第六十七条，构成了《证券法》第一百九十三条第一款规定的违法行为。

报告期内本基金投资的前十名证券中，金亚科技（300028）的发行主体于 2015 年 6 月 4 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（成稽调查通字 151003 号）。因该公司涉嫌证券违法违规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会决定对公司进行立案调查。

对如上股票投资决策程序的说明：研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。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八名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资前十名股票中，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、期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号 名称 金额

1 存出保证金 1,484,902.88

2 应收证券清算款 9,548,537.18

3 应收股利 —

4 应收利息 1,327,311.49

5 应收申购款 —

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 12,360,751.55

4、期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号 债券代码 债券名称 公允价值 占基金资产净值比例(%)

1 113008 电气转债 233,129,001.30 32.40

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 300028 金亚科技 4,133,962.08 0.57 停牌

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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

2015 年 12 月 31 日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

(长信可转债债券 A) 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

2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 9.21% 0.90% 5.88% 0.97% 3.33% -0.07%

2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 3.79% 1.27% -11.35% 2.48% 15.14% -1.21%

2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 26.36% 2.36% -14.64% 2.40% 41.00% -0.04%

2013 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 150.38% 1.72% 22.90% 1.51% 127.48% 0.21%

自基金合同生效日起至至今（2012 年 3 月 30 日-2015 年 12 月 31 日） 163.70% 1.53% 27.25%
1.35% 136.45% 0.18%

阶段

(长信可转债债券 C) 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

2015 年 10 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 9.07% 0.90% 5.88% 0.97% 3.19% -0.07%

2015 年 7 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 2.95% 1.28% -11.35% 2.48% 14.30% -1.20%

2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 24.20% 2.36% -14.64% 2.40% 38.84% -0.04%

2013 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 140.96% 1.72% 22.90% 1.51% 118.06% 0.21%

自基金合同生效日起至至今（2012 年 3 月 30 日-2015 年 12 月 31 日） 152.91% 1.53% 27.25%
1.35% 125.66% 0.18%

自合同生效之日（2012 年 3 月 30 日）至 2015 年 12 月 31 日期间，本基金份额累计净值增长率与同期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 2012 年 3 月 30 日，图示日期为 2012 年 3 月 30 日至 2015 年 12 月 31 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中的约定。

3、2015 年 8 月 7 日起本基金业绩比较基准由“中信标普可转债指数收益率× 70%+中信标普全债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%”变更为“中信标普可转债指数收益率

×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深 300 指数收益率×10%”。

十三、费用概况

（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：本基金从 C 类基金资产中计提的销售服务费；
- 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、基金财产拨划支付的银行费用；
- 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。

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規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，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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，支付日期顺延至最近可支付日支付。

3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。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。

销售服务费按照 C 类基金资产净值的 0.35% 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销售服务费

E 为 C 类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，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，基金管理人收到后按照相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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 and 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费率、基金托管费率和销售服务费率。降低基金费率、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。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上刊登公告。

（六）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。

（七）与基金销售有关的费用

1、本基金将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额两种。本基金的 A 类基金份额在申购时收取申购费，赎回时收取赎回费；C 类基金份额不收取申购费和赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的 A 类基金份额的申购费最高不超过申购金额的 5%，A 类基金份额的赎回费最高不超过基金份额赎回金额的 5%。

2、本基金的申购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位；申购费用应在基金投资者申购基金 A 类份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

3、本基金的赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

4、申购费率

本基金 A 类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用；C 类基金份额不收取申购费。

两类基金的申购费率如下：

基金份额类别 单笔申购金额（M，含申购费） 申购费率

A 类基金份额 M<100 万元 0.8%

100 万元≤M<300 万元 0.5%

300 万元≤M<500 万元 0.3%

M≥500 万元 每笔 1000 元

C 类基金份额 0

5、赎回费率

本基金 A 类基金份额的赎回费率随持有时间的增加而递减；C 类基金份额不收取赎回费。

两类基金的赎回费率如下：

基金份额类别 持有期限（N） 赎回费率

A 类基金份额 N<2 年 0.5%

N≥2 年 0

C 类基金份额 0

6、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的费率或收费方式。基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 日在至少一种指定媒体和基金管理人的公司网站上公告。

7、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。

8、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，针对基金交易的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投资者适当调整基金申购费率、基金赎回费率和基金转换费率。

9、基金转换

本公司已开通了本基金与长信利息收益货币基金（A 级代码：519999；B 级代码：519998）、长信银利精选混合基金[前端收费]、长信金利趋势混合基金[前端收费]、长信增利动态策略混合基金[前端收费]、长信双利优选混合基金[前端收费]、长信利丰债券基金、长信恒利优势混合基金、长信纯债壹号基金、长信量化先锋混合基金、长信内需成长混合基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票、长信新利混合基金、长信量化多策略股票基金、长信利富债券基金、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、长信利泰混合基金之间的相互转换业务，具体可办理转换业务的渠道详见本公司相关公告。

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，本公司开放式基金转换业务相关规则如下：

（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)

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, 对本基金管理人本基金原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, 对基金管理人主要人员情况、员工情况、公司内部组织结构进行了更新;
- 2、在“五、相关服务机构”部分的内容, 更新部分渠道法定代表人、联系人、电话、注册地址、办公地址等信息, 更新新增的场外代销机构的信息;
- 3、在“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分, 新增了可转换的基金;
- 4、在“十、基金的投资组合报告”部分的相应内容, 更新了最近一期投资组合报告的内容和基金的投资业绩;
- 5、在“十一、基金的业绩”部分相应内容, 更新了最近一期投资组合报告的内容和基金的投资业绩, 并经托管银行复核;
- 6、在“十三、基金资产的估值”部分, 更新了估值方法;
- 7、在“二十二、基金份额持有人服务”中的部分内容, 更新了对持有人服务的内容;
- 8、在“二十三、其它应披露的事项”部分的相应内容, 更新了本基金的相关公告事项。

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年五月十三日