

# 长信利丰债券型证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

2009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 2009 年 6 月 29 日，有关财务数据和净值表现自 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 3 月 31 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    | 上海市浦东新区银城中路 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   | 田丹   |
| 电话      | 021-61009999   |
| 传真      | 021-61009800   |
| 联系人     | 尹克文  |
| 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（涉及许可经营的凭许可证经营）  |
| 股权结构    | 长江证券股份有限公司出资 7350 万元，占注册资本的 49%；上海海欣集团股份有限公司出资 5149.5 万元，占注册资本的 34.33%；武汉钢铁股份有限公司出资 2500.5 万元，占注册资本的 16.67%。 |

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人的董事会人员情况

| 董事会成员 |     |    |  |
|-------|-----|----|--|
| 姓名    | 职务  | 性别 | 简历   |
| 田丹    | 董事长 | 男  | 中共党员，硕士。曾任湖北省军区参谋、秘书，中国人民银行湖北省分行金融调研处科长，湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理，三峡证券公司副总经理，湖北证券有限责任公司董事、副总裁，长江证券有限责任公司董事、副总裁、财务负责人，长江证券有限责任公司董事、总裁。现任长信基金管理有限责任公司董事 |

|     |      |   |   |
|-----|------|---|---|
|     |      |   | 长。  |
| 胡运钊 | 董事   | 男 | 中共党员，研究生学历，高级经济师。曾任湖北省经委工业处处长、黄石市人民政府副市长、市委常委、常务副市长、湖北省人民政府副秘书长（正厅）、办公厅主任、办公厅党组副书记。现任长江证券股份有限公司党委书记、董事长。  |
| 王岑  | 董事   | 男 | 中共党员，硕士，高级工程师。曾任武汉钢铁（集团）公司热轧厂技术员、科长、车间副主任、厂长助理、副厂长、厂长，武汉钢铁（集团）公司总经理助理兼武汉钢铁有限责任公司副总经理，武汉钢铁（集团）公司副总经理兼钢铁公司党委书记、副总经理，现任武汉钢铁股份有限公司董事、总经理。   |
| 李国洪 | 董事   | 男 | 硕士，曾在武汉市人民政府工作。曾任长江证券有限责任公司投资银行总部副总经理、资产保全事业部总经理、办公室总经理。现任长江证券股份有限公司副总裁、合规总监。   |
| 徐文彬 | 董事   | 男 | 中共党员。曾任中国人民解放军 273 团政委，上海市松江区建设委员会党委书记，上海市松江区小昆山镇党委书记，上海市松江区洞泾镇党委书记。现任上海海欣集团股份有限公司党委书记、总裁。  |
| 陈谋亮 | 董事   | 男 | 中共党员，硕士，高级经济师。曾任湖北经济学院讲师，扬子石化公司法律顾问，上海交大南洋股份有限公司部门经理兼证券事务代表，上海海欣集团股份有限公司董事会秘书兼战略投资管理部常务副总监、总裁助理。现任上海海欣集团股份有限公司副总裁兼董事会秘书。  |
| 蒋学杰 | 董事   | 男 | 经济学硕士，澳大利亚墨尔本大学商学院 MBA。曾任中南财经大学财政金融学院财政系教师、武汉科技信托投资公司武昌证券营业部总经理，并兼公司总助，副总等职、Loftus Capital Partners Limited, Australia 旗下基金亚洲市场投资组合及私人股权投资的亚洲区域负责人、KVB Kunlun Pty Ltd, Australia 金融衍生产品持牌交易投资顾问、长信基金管理有限责任公司副总经理。现任长信基金管理有限责任公司总经理。 |
| 朱恒  | 独立董事 | 男 | 中共党员，本科，高级经济师。曾任中国人民银行、中国农业银行上海市奉贤支行副行长，中国农业银行上海市分行副行长，上海浦东发展银行副行长，万国证券公司、申银万国证券公司董事长，上海浦东发展银行党委副书记、副行长，上海轻工控股（集团）公司监事会主席。  |
| 余秉立 | 独立董事 | 男 | 中共党员，本科，注册会计师。曾任武汉市财政局副科长、武汉市政府财贸办公室副科长、武汉  |

|                          |      |   |   |
|--------------------------|------|---|---|
|                          |      |   | 市财政局副科长至副局长、武汉市审计局局长、党组书记、湖北省财政金融贸易办公室副主任、副书记、审计署驻武汉特派办特派员、书记、审计署驻武汉特派办正局级审计员。                      |
| 黄宪                       | 独立董事 | 男 | 中共党员，博士，博士生导师，曾任武汉大学教师、商学院副院长，美国新泽西西东大学访问学者，武汉大学珞珈城市信用社副董事长，中港合资武新公司财务总经理。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师。 |
| 宋晓燕                      | 独立董事 | 女 | 中共党员，法学博士，律师。曾任武汉大学管理学院国际金融系教师。现任上海财经大学法学院教授。   |
| <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  |
| 郭自祥                      | 监事会主席 | 男  | 硕士，曾任武钢二钢厂宣传部部长、武钢工会副书记、副主席，武汉钢铁（集团）公司办公室主任。现任武汉钢铁集团公司企业管理部部长。  |
| 柳杨                       | 监事    | 男  | 硕士，审计师，证券从业经历 10 年。曾任长江证券有限责任公司财务总部会计员、核算部经理、总经理助理。现任长江证券股份有限公司财务负责人、财务总部总经理。   |
| 王罗洁                      | 监事    | 女  | 大学本科，高级会计师，曾任核工业部国营 792 矿统计员、计划科长，上海海欣股份有限公司财务副经理、经理、财务副总监等职。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。  |
| 覃波                       | 监事    | 男  | 中共党员，大学本科。曾任长江证券有限责任公司债券基金事业部市场部主管、长信基金管理有限责任公司市场开发部区域经理、营销策划部副总监、总经理助理兼市场开发部总监。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼专户理财部总监。                                      |
| 刘耘                       | 监事    | 女  | 中共党员，硕士。曾任湖北经贸实业公司暨大通（中国）国际运输有限责任公司湖北分公司会计主管、深圳蓝天基金管理公司暨武汉蓝天房地产发展有限公司财务部经理、武汉国有资产经营公司资产财务部副经理、长信基金管理有限责任公司基金事务部总监、市场开发部副总监。现任长信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。 |
| <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   |
| 蒋学杰               | 总经理 | 男  | 简历同上。  |
| 周永刚               | 督察长 | 男  | 金融学硕士，EMBA。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。现任长信基金管理有限责任公司督察长。 |
| 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 | 2008年12月29日至今 | 管理学硕士，获加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任长城证券公司证券分析师，加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd 投资经理和投资顾问。2002年10月加入本公司，先后任长信利息收益基金基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监。2008年12月29日开始担任本基金的基金经理。 |

### 5、投资决策委员会成员

| 投资决策委员会成员         |                           |
|-------------------|---------------------------|
| 姓名                | 职务                        |
| 蒋学杰               | 总经理                       |
| 叶琦                | 总经理助理、金融工程部总监、国际业务部总监     |
| 曾芒                | 投资管理部总监、长信增利动态策略股票基金的基金经理 |
| 李小羽               | 固定收益部总监、长信利丰债券基金的基金经理     |
| 骆泽斌               | 研究发展部总监                   |
| 注：上述人员之间均不存在近亲属关系 |                           |

### （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、特定客户资产投资决策委员会、产品发展委员会等四个委员会  |
| 公司内部组织结构  | 金融工程部、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、市场开发部、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                          |
| 分支机构  | 北京分公司、武汉办事处  |
| 员工总数<br>(本报告期)  | 94 人   |
| 员工学历构成  | 博士学历 5 人，占 5%；硕士学历 46 人，占 49%；本科学历 35 人，占 37%；专科学历 6 人，占 7%；其它 2 人，占 2%。具有海外留学或工作经历的 14 人，占 14%。 |

## 二、基金托管人

### 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：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立日期：2009 年 1 月 15 日

注册资本：2600 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68424199

联系人：李芳菲

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 93 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、剪务能力强，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 2009 年 6 月 29 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 67 只，包括华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、天华证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放

式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新世纪优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

|                                 |                        |
|---------------------------------|------------------------|
| <b>1、直销机构：长信基金管理有限责任公司</b>      |                        |
| 注册地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 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：田丹                        | 联系人：孙赵辉                |
| 电话：021-61009916                 | 传真：021-61009917        |
| 客户服务专线：400-700-5566             | 公司网站：www.cxfund.com.cn |



|                              |                     |
|------------------------------|---------------------|
| <b>2、场外代销机构：</b>             |                     |
| (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：项俊波                    | 联系人：蒋浩              |
| 电话：010-85109219              | 传真：010-85109219     |
| 客户服务电话：95599                 | 网址：www.abchina.com  |
| (2) 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：肖钢                     |                     |
| 客户服务电话：95566                 | 网址：www.boc.cn       |
| (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                    |                     |
| 客户服务电话：95588                 | 网址：www.icbc.com.cn  |
| (4) 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一号长安兴融中心东楼四层 |                     |
| 法定代表人：郭树清                    |                     |
| 客户服务电话：95533                 | 网址：www.ccb.com      |
| (5) 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：胡怀邦                    | 联系人：曹榕              |
| 电话：021-58781234              | 传真：021-58408842     |
| 客户服务电话：95559                 | 网址：www.bankcomm.com |
| (6) 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：秦晓                     | 联系人：万丽              |
| 电话：0755-83198888             | 传真：0755-83195109    |
| 客户服务电话：95555                 | 网址：www.cmbchina.com |
| (7) 中国邮政储蓄银行有限责任公司           |                     |

|                                  |                          |
|----------------------------------|--------------------------|
| 注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号          |                          |
| 办公地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号          |                          |
| 法定代表人：陶礼明                        |                          |
| 客户服务电话：95580                     | 网址：www.psbc.com          |
|                                  |                          |
| (8) 中国民生银行股份有限公司                 |                          |
| 注册地址：北京市东城区正义路 4 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：董云巍、吴海鹏              |
| 电话：010-58351666                  | 传真：010-83914283          |
| 客户服务电话：95568                     | 网址：www.cmbc.com.cn       |
|                                  |                          |
| (9) 中信银行股份有限公司                   |                          |
| 注册地址：北京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：孔丹                         | 联系人：黎珊                   |
| 电话：010-65557018                  |                          |
| 客户服务电话：95558                     | 公司网址：bank.ecitic.com     |
|                                  |                          |
| (10) 申银万国证券股份有限公司                |                          |
| 注册地址：上海市常熟路 171 号                |                          |
| 办公地址：上海市常熟路 171 号                |                          |
| 法定代表人：丁国荣                        | 联系人：邓寒冰                  |
| 电话：021-54033888                  | 传真：021-54035333          |
| 客户服务电话：021-962505                | 网址：www.sywg.com.cn       |
|                                  |                          |
| (11) 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：胡运钊                        | 联系人：李良                   |
| 电话：021-63219781                  | 传真：021-51062920          |
| 客户服务电话：400-8888-999/027-85808318 | 网址：www.95579.com         |
|                                  |                          |
| (12) 中国银河证券有限责任公司                |                          |
| 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：胡长生                        | 联系人：李洋                   |
| 电话：010-66568888                  | 传真：010-66568532          |
| 客户服务电话：4008-888-888              | 网址：www.chinastock.com.cn |
|                                  |                          |
| (13) 湘财证券有限责任公司                  |                          |
| 注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼     |                          |

|                                       |                    |
|---------------------------------------|--------------------|
| 办公地址：上海银城中路 188 号交银金融大厦               |                    |
| 法定代表人：陈学荣                             | 联系人：杜颖灏            |
| 电话：021-68634518                       | 传真：021-68865938    |
| 客户服务电话：400-888-1551                   | 网址：www.xcsc.com    |
|                                       |                    |
| (14) 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 95553             | 网址：www.htsec.com   |
|                                       |                    |
| (15) 中信建投证券有限责任公司                     |                    |
| 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼              |                    |
| 办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号                 |                    |
| 法定代表人：张佑君                             | 联系人：权唐             |
| 电话：010-65186758                       | 传真：010-65182261    |
| 客户服务电话：400-8888-108                   | 网址：www.csc108.com  |
|                                       |                    |
| (16) 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：王志伟                             | 联系人：肖中梅            |
| 电话：020-87555888 转各营业网点                | 传真：020-87557985    |
| 客户服务电话：020-961133                     | 网址：www.gf.com.cn   |
|                                       |                    |
| (17) 兴业证券股份有限公司                       |                    |
| 注册地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦               |                    |
| 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：谢高得            |
| 电话：021-68419974                       | 传真：021-68419867    |
| 客户服务电话：400-8888-123                   | 网址：www.xyzq.com.cn |
|                                       |                    |
| (18) 东方证券股份有限公司                       |                    |
| 注册地址：上海市中山南路 318 号 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：王益明                             | 联系人：吴宇             |
| 电话：021-63325888                       | 传真：021-63327888    |
| 客户服务电话：95503                          | 网址：www.dfzq.com.cn |
|                                       |                    |
| (19) 长城证券有限责任公司                       |                    |
| 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：匡婷               |
| 电话：0755-83516089                     | 传真：0755-83998537     |
| 客户服务电话：400-6666-888                  | 网址：www.cc168.com.cn  |
|                                      |                      |
| (20) 宏源证券股份有限公司                      |                      |
| 注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦            |                      |
| 办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座      |                      |
| 法定代表人：汤世生                            | 联系人：李巍               |
| 电话：010-62267799                      | 传真：010-62296854      |
| 客户服务电话：0991-96562 010-62294600       | 网址：www.ehongyuan.com |
|                                      |                      |
| (21) 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 3 楼            |                      |
| 法定代表人：唐双宁                            | 联系人：刘晨、李芳芳           |
| 电话：021-22769081、021-22169089         | 传真：021-22169134      |
| 客户服务电话：4008-888-788、10108998         | 网址：www.ebscn.com     |
|                                      |                      |
| (22) 中信金通证券有限责任公司                    |                      |
| 注册地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务庭院楼 A 座      |                      |
| 办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务庭院楼 A 座      |                      |
| 法定代表人：刘军                             | 联系人：徐蕾               |
| 电话：0571-86811952                     | 传真：0571-85783771     |
| 客户服务电话：96598                         | 网址：www.bigsun.com.cn |
|                                      |                      |
| (23) 西藏证券经纪有限责任公司                    |                      |
| 注册地址：拉萨市罗布林卡路 6 号                    |                      |
| 办公地址：上海市辉河路 118 号                    |                      |
| 法定代表人：贾绍君                            | 联系人：刘宇               |
| 电话：021-65526481                      | 传真：021-65526481      |
| 客户服务电话：400-8811-177                  | 网址：www.xzsec.com     |
|                                      |                      |
| (24) 东莞证券有限责任公司                      |                      |
| 注册地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼            |                      |
| 办公地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼            |                      |
| 法定代表人：游锦辉                            | 联系人：罗绍辉              |
| 电话：0769-22119351                     | 传真：0769-22119423     |
| 客户服务电话：961130                        | 网址：www.dgzq.com.cn   |
|                                      |                      |
| (25) 招商证券股份有限公司                      |                      |
| 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层           |                      |

|                                      |                      |
|--------------------------------------|----------------------|
| 办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 38-45 层        |                      |
| 法定代表人：宫少林                            | 联系人：黄新波              |
| 电话：0755-82969223                     | 传真：0755-82943121     |
| 客户服务电话：95565 400-8888-111            | 网址：www.newone.com.cn |
|                                      |                      |
| (26) 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：方加春                            | 联系人：罗芳               |
| 电话：021-68761616                      | 传真：021-68767981      |
| 客户服务电话：400-8888-128                  | 网址：www.tebon.com.cn  |
|                                      |                      |
| (27) 国泰君安证券有限责任公司                    |                      |
| 注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号                |                      |
| 办公地址：上海市银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼        |                      |
| 法定代表人：祝幼一                            | 联系人：芮敏祺              |
| 电话：021-38676666                      | 传真：021-62583439      |
| 客户服务电话：400-8888-666 021-962588（上海地区） | 网址：www.gtja.com      |
|                                      |                      |
| (28) 齐鲁证券有限责任公司                      |                      |
| 注册地址：山东省济南市经十路 128 号                 |                      |
| 办公地址：山东省济南市经十路 128 号                 |                      |
| 法定代表人：李玮                             | 联系人：傅咏梅              |
| 电话：0531-81283731                     | 传真：0531-81283735     |
| 客户服务电话：95538                         | 网址：www.qlzq.com.cn   |
|                                      |                      |
| (29) 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：上海市南京西路 1468 号 2 楼              |                      |
| 法定代表人：郁忠民                            | 联系人：王伟力              |
| 电话：021-53519888                      | 传真：021-53519888      |
| 客户服务电话：962518                        | 网址：www.962518.com    |
|                                      |                      |
| (30) 江海证券经纪有限责任公司                    |                      |
| 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：徐世旺              |
| 电话：0451-82336863                     | 传真：0451-82269290     |
| 客户服务电话：400-666-2288                  | 网址：www.jhzq.com.cn   |
|                                      |                      |
| (31) 中国民族证券有限责任公司                    |                      |
| 注册地址：北京市丰台区丰北路 81 号                  |                      |

|                                  |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 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：管宇           |
| 电话：010-59355974                  | 传真：010-66553791  |
| 客户服务电话：400-889-5618              | 网址：www.e5618.com |

### 3、场内代销机构

场内代销机构是指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员（以下简称“有资格的上交所会员”），名单详见上海证券交易所网站：

[http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg\\_szjtt.jsp](http://www.sse.com.cn/sseportal/ps/zhs/hyzq/zxzg_szjtt.jsp)

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                  | 毕马威华振会计师事务所              |
| 注册地址  | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层 | 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  | 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层 | 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 | 陈耀先                     | 廖海（负责人）                    | 萧伟强                      |
| 联系电话  | 010-58598839            | 021-51150298               | 021-22122888             |
| 传真    | 010-58598907            | 021-51150398               | 021-62881889             |
| 联系人   | 朱立元                     | 廖海、吴军娥                     | 彭成初<br>（黄小熠、王国蓓为经办注册会计师） |

### 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。

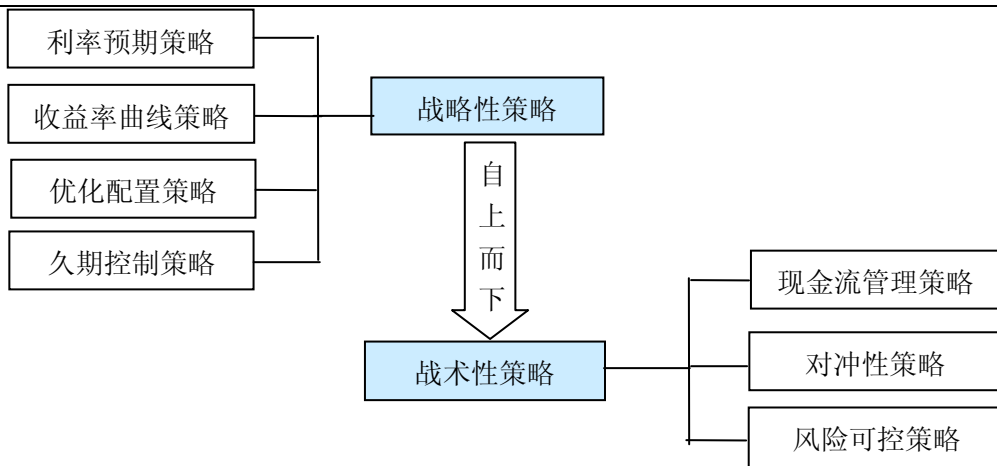
如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于公司债券、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 and 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。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 2009 年 7 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2009年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计

### （一）本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              | 32,981,865.00  | 6.76         |
|    | 其中：股票             | 32,981,865.00  | 6.76         |
| 2  | 固定收益投资            | 388,553,432.52 | 79.69        |
|    | 其中：债券             | 388,553,432.52 | 79.69        |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 3  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 4  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
| 5  | 银行存款和结算备付金合计      | 57,792,913.24  | 11.85        |
| 6  | 其他资产              | 8,281,827.42   | 1.70         |
| 7  | 合计                | 487,610,038.18 | 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   | 采掘业            | —             | —            |
| C   | 制造业            | —             | —            |
| C0  | 食品、饮料          | —             | —            |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | —             | —            |
| C2  | 木材、家具          | —             | —            |
| C3  | 造纸、印刷          | —             | —            |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | —             | —            |
| C5  | 电子             | —             | —            |
| C6  | 金属、非金属         | —             | —            |
| C7  | 机械、设备、仪表       | —             | —            |
| C8  | 医药、生物制品        | —             | —            |
| C99 | 其他制造业          | —             | —            |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | —             | —            |
| E   | 建筑业            | —             | —            |
| F   | 交通运输、仓储业       | —             | —            |
| G   | 信息技术业          | —             | —            |
| H   | 批发和零售贸易        | —             | —            |
| I   | 金融、保险业         | 31,259,165.00 | 6.48         |
| J   | 房地产业           | 1,722,700.00  | 0.36         |
| K   | 社会服务业          | —             | —            |

|   |         |               |      |
|---|---------|---------------|------|
| L | 传播与文化产业 | —             | —    |
| M | 综合类     | —             | —    |
|   | 合计      | 32,981,865.00 | 6.84 |

(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  | 600030 | 中信证券 | 700,000 | 17,829,000.00 | 3.70         |
| 2  | 000562 | 宏源证券 | 783,100 | 13,430,165.00 | 2.79         |
| 3  | 600606 | 金丰投资 | 230,000 | 1,722,700.00  | 0.36         |

(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      | 126,283,000.00 | 26.19        |
| 3  | 金融债券      | —              | —            |
|    | 其中:政策性金融债 | —              | —            |
| 4  | 企业债券      | 201,570,432.52 | 41.81        |
| 5  | 企业短期融资券   | 60,700,000.00  | 12.59        |
| 6  | 可转债       | —              | —            |
| 7  | 其他        | —              | —            |
| 8  | 合计        | 388,553,432.52 | 80.59        |

(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)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 0801104 | 08央票104  | 400,000 | 38,956,000.00 | 8.08         |
| 2  | 0801098 | 08央行票据98 | 400,000 | 38,912,000.00 | 8.07         |
| 3  | 122994  | 08云投债    | 335,790 | 34,065,895.50 | 7.07         |
| 4  | 0801095 | 08央行票据95 | 300,000 | 29,169,000.00 | 6.05         |
| 5  | 122011  | 08金发债    | 249,090 | 26,328,813.00 | 5.46         |

(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名的前五

## 名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## (八)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、其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | —            |
| 2  | 应收证券清算款 | 723,479.64   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 6,700,147.78 |
| 5  | 应收申购款   | 858,200.00   |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 8,281,827.42 |

4、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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩部分

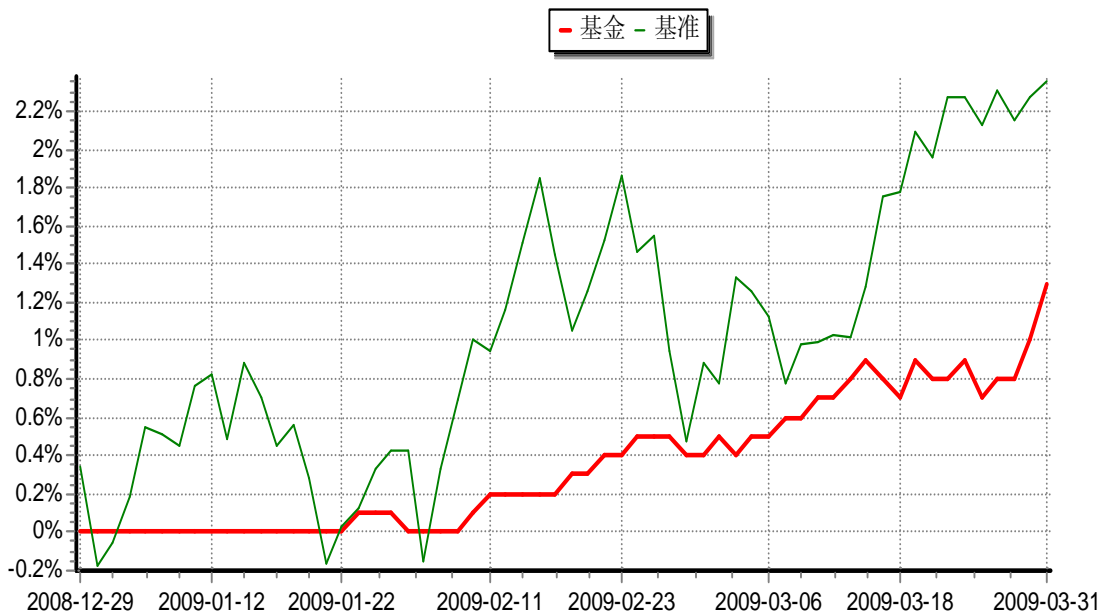
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表

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 2009 年一季度本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                   | 净值增长率① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------------|--------|---------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 2009年1月1日至2009年3月31日 | 1.30%  | 0.08%         | 2.42%              | 0.29%                     | -1.12% | -0.21% |

**(二) 自合同生效之日(2008年12月29日)至2009年3月31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2009年3月31日。

2、基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定: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%。

### 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）基金财产拨划支付银行费用；
- （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。

用。

2、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，法律法規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：

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

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。

5、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，对本基金管理人于 2008 年 12 月 3 日刊登的本基金招募说明书（《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：

更新了“重要提示”的“基金合同生效日期、更新招募说明书内容截止日期和财务数据截止日期”。

更新了“三、基金管理人”的“基本情况、主要人员情况和内部组织结构及员工情况”。

根据托管行提供的资料，更新了“四、基金托管人”的“基金托管人的基

本情况”和“基金托管业务经营情况”。

更新了“五、相关服务机构”部分的相应内容。

更新了“六、基金的募集”部分的相应内容。

更新了“七、基金合同的生效”部分的相应内容。

增加了“十、基金的投资组合报告”部分的相应内容。

增加了“十一、基金的业绩”部分相应内容，并经托管银行复核。

更新了“二十二、基金份额持有人的服务”部分相应内容。

增加了“二十三、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

2009年8月13日