

# 长信利鑫分级债券型证券投资基金 之利鑫 B 份额上市交易公告书

基金管理人：长信基金管理有限责任公司  
基金托管人：中国邮政储蓄银行有限责任公司  
注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司  
上市地点：深圳证券交易所  
上市时间：2011 年 9 月 23 日  
公告时间：2010 年 9 月 20 日

## 目 录

一、重要提示与说明 .....	3
二、基金概览 .....	4
三、基金的募集与上市交易 .....	6
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	9
五、基金主要当事人简介 .....	10
六、基金合同摘要 .....	15
七、基金财务状况 .....	43
八、基金投资组合 .....	45
九、重大事件揭示 .....	48
十、基金管理人承诺 .....	49
十一、基金托管人承诺 .....	50
十二、备查文件目录 .....	51

## 一、重要提示与说明

《长信利鑫分级债券型证券投资基金之利鑫 B 份额上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，长信利鑫分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人长信基金管理有限责任公司的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国邮政储蓄银行有限责任公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2011 年 6 月 3 日登载于上海证券报、中国证券报、证券日报和长信基金管理有限责任公司网站（<http://www.cxfund.com.cn>）的本基金招募说明书。

## 二、基金概览

1、基金名称：长信利鑫分级债券型证券投资基金

2、基金类别：债券型证券投资基金

3、基金运作方式：契约型

自本基金合同生效之日起5年内，利鑫A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次，利鑫B封闭运作并上市交易，利鑫A和利鑫B的基金资产合并运作。本基金合同生效后5年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。

4、基金份额分级

自本基金合同生效之日起5年内，根据运作方式和风险收益特征的不同，将本基金的基金份额分为利鑫A、利鑫B两级份额，份额配比原则上不超过2：1。利鑫A根据基金合同的规定获得约定收益，并自基金合同生效之日起每满6个月开放一次；利鑫B在5年的封闭期内封闭运作，本基金在扣除利鑫A的应计收益后的全部剩余收益归利鑫B享有，亏损以利鑫B的资产净值为限由利鑫B承担。

本基金基金合同生效后5年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金将不再进行基金份额分级。本基金转换为上市开放式基金（LOF）时，利鑫A基金份额持有人可选择将其持有的利鑫A份额赎回或是转入“长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）”。若投资者不选择的，其持有的利鑫A份额将被默认为转入“长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）”份额。

5、基金存续期限：不定期

6、本次上市交易的基金份额场内简称：利鑫B

7、交易代码：150042

8、基金份额总额：本基金总份额636,483,025.08份，其中，利鑫A为424,384,931.89份，利鑫B为212,098,093.19份（截至2011年9月16日）

9、利鑫B的基金份额参考净值：1.0010元（截至2011年9月16日）

10、利鑫B本次上市交易的基金份额总额：81,608,171.00份（截至2011年9月16日）

11、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

- 12、上市交易日期：2011年9月23日
- 13、基金管理人：长信基金管理有限责任公司
- 14、基金托管人：中国邮政储蓄银行有限责任公司

### 三、基金的募集与上市交易

(一) 利鑫B份额上市前基金募集情况:

1、基金募集申请的核准机构和核准文号: 中国证券监督管理委员会2011年4月27日证监许可【2011】603号

2、发售日期: 2011年6月8日至2011年6月17日

3、利鑫B的发售价格: 1.00元人民币

4、利鑫B的发售方式: 场外、场内认购

5、利鑫B的发售机构:

(1) 场内发售机构:

具有基金代销业务资格的深交所会员: 名单详见深交所网站(<http://www.szse.cn>)的相关栏目内容

(2) 场外发售机构:

1) 直销机构: 长信基金管理有限责任公司

2) 代销机构: 中国邮政储蓄银行有限责任公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、汉口银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、江海证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、天风证券有限责任公司、西藏同信证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、中航证券有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司。

6、验资机构名称：上海众华沪银会计师事务所

7、募集资金总额及入账情况：根据中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统的确认，利鑫 A 在集中认购期间实际净认购资金为人民币 424,122,617.39 元，有效净认购资金为人民币 424,122,617.39 元，有效集中认购份额为 424,122,617.39 份；有效集中认购资金于 2011 年 6 月 10 日至 2011 年 6 月 21 日（含）间按适用年利率计算产生的利息为人民币 262,314.50 元，折成基金份额 262,314.50 份。集中认购实收基金份额共为 424,384,931.89 份，有效集中认购户数为 14,554 户。

利鑫 B 在集中认购期间实际净认购资金为人民币 212,071,673.36 元，有效净认购资金为人民币 212,071,673.36 元，有效集中认购份额为 212,071,673.36 份；有效集中认购资金于 2011 年 6 月 9 日至 2011 年 6 月 22 日（含）（场内资金），2011 年 6 月 10 日至 2011 年 6 月 21 日（含）（场外资金）间按适用年利率计算产生的利息为人民币 26,419.83 元，折成基金份额 26,419.83 份。集中认购实收基金份额共为 212,098,093.19 份，有效集中认购户数为 133 户。

利鑫 A 集中认购的净认购金额人民币 424,122,617.39 元和有效集中认购资金于 2011 年 6 月 10 日至 2011 年 6 月 21 日（含）产生的利息人民币 262,314.50 元，合计 424,384,931.89 元，利鑫 B 集中认购的净认购金额人民币 212,071,673.36 元和有效集中认购资金于 2011 年 6 月 9 日至 2011 年 6 月 22 日（含）（场内资金），2011 年 6 月 10 日至 2011 年 6 月 21 日（含）（场外资金）产生的利息为人民币 26,419.83 元，合计 212,098,093.19 元，分别于 2011 年 6 月 23 日（场内资金）、2011 年 6 月 22 日（场外资金）划入本基金在基金托管人中国邮政银行有限责任公司开立的长信利鑫分级债券型证券投资基金托管专户内。

8、本基金募集备案情况：本基金于 2011 年 6 月 23 日验资完毕，2011 年 6 月 23 日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2011 年 6 月 24 日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

9、基金合同生效日：2011 年 6 月 24 日。

10、基金合同生效日的基金份额总额：636,483,025.08 份，其中，利鑫 A 为 424,384,931.89 份，利鑫 B 为 212,098,093.19 份。

(二) 利鑫 B 份额上市交易的主要内容:

- 1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2011】290 号
- 2、上市交易日期：2011 年 9 月 23 日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
- 4、本次上市的基金份额场内简称：利鑫 B
- 5、本次上市的基金份额交易代码：150042
- 6、本次上市交易的利鑫 B 份额：81,608,171.00 份（截至 2011 年 9 月 16 日）
- 7、基金资产净值的披露：基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个开放日交易结束后将经过基金托管人复核的利鑫 B 的基金份额参考净值传送给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人公布的基金净值负责。
- 8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至 2011 年 9 月 16 日的场内基金持有情况：

利鑫 B 场内基金份额持有人户数：22 户

平均每户持有的场内利鑫 B 基金份额：3,709,462.32 份

场内机构投资者持有的利鑫 B 基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有 80,108,971.00 份，占 98.16%

场内个人投资者持有的利鑫 B 基金份额及场内基金占总份额比例：个人持有 1,499,200.00 份，占 1.84%

场内利鑫 B 份额前十名持有人情况：（截至 2011 年 9 月 16 日）

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例 (%)
1	平安证券有限责任公司	20,002,777.00	24.51
2	长江证券—交行—长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	20,002,499.00	24.51
3	东吴证券股份有限公司	15,000,624.00	18.38
4	山东省国际信托有限公司—民生 2008-1 号	10,101,963.00	12.38
5	上海汽车集团财务有限责任公司	10,000,900.00	12.25
6	财通证券—工行—金色钱塘—核心动力集合资产管理计划	5,000,208.00	6.13
7	刘国英	500,097.00	0.61
8	姜一凡	500,048.00	0.61
9	陈光路	300,033.00	0.37
10	何恒	50,009.00	0.06

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：长信基金管理有限责任公司
- 2、法定代表人：田丹
- 3、总经理：蒋学杰
- 4、注册资本：1.5亿元人民币
- 5、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
- 6、设立批准文号：中国证监会证监基金字【2003】63号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：310101000315489
- 8、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）。
- 9、存续期间：持续经营
- 10、股东及其出资比例：

	股东名称	出资额	出资比例
股权结构	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%

### 11、内部组织结构及职能

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。我公司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。根据我公司发展战略和组织管理原则，结合基金管理的业务特点，在经营管理层下设内部控制委员会、投资决策委员会等非常设委员会，以及投资管理部、研究发展部、交易管理部、固定收益部、金融工程部、产品开发部、专户理财部、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、国际业务部等 13 个部门，并设立了北京分公司、深圳分公司和武汉办事处。

#### 投资管理部

负责 A 股非固定收益类基金资产的投资运作和管理业务。

#### 研究发展部

负责投资组合的基础研究，主要负责收集、分析各类政治、经济与行业信息，研究宏观经济、资本市场、行业及上市公司的情况，为投资组合的投资决策提供建议和依据。

#### **交易管理部**

负责制定交易管理的基本制度，核查指令的合规性，准确及时地执行交易指令，进行市场分析、询价，维护有关交易数据，协调与交易相关的业务关系等。

#### **固定收益部**

负责分析和研究经济、货币政策和财政政策等有关信息，向投资决策委员会提供固定收益证券的投资策略和资产配置建议，负责公司固定收益类基金的投资运作和管理业务。

#### **金融工程部**

负责各类投资组合的风险与业绩评估、数量分析研究、量化投资研究等工作。

#### **产品开发部**

负责公司公募基金和特定客户资产管理业务的产品设计开发工作和产品申报工作。

#### **专户理财部**

负责投资咨询业务的运作及特定客户资产管理业务投资组合的投资运作和管理业务。

#### **基金事务部**

负责各类投资组合资产的清算、会计核算、注册登记、直销客户业务办理等业务。

#### **市场开发部**

负责公司各类投资组合产品的首次发行和持续营销、营销策略的制定和推广，为各类客户提供日常及增值服务，协助公司制订发展战略和开拓新业务。主要包括渠道开发维护、机构客户开发维护、客户服务、营销策划和支持、新产品发行等职能。

#### **信息技术部**

负责提供信息系统支持，保障公司日常经营正常运转。

#### **监察稽核部**

在公司内部行使监察稽核职能，负责公司的法律事务、信息披露、各项业务的常规监察稽核和专项监察稽核等工作，在业务上接受督察长和内部控制委员会的指导和监督。

### **综合行政部**

全面负责公司的行政后勤、人力资源的开发与管理、财务管理及自有资产管理等工作。

### **国际业务部**

负责公司国际业务的开发和拓展工作。

### **北京分公司**

负责公司与中国证监会、托管银行等相关部门的沟通与联系，负责北方地区的各项业务的拓展工作。

### **深圳分公司**

主要负责公司在华南地区的各项业务的拓展工作，同时负责公司与深圳证监局、总部设在华南的银行等相关部门的沟通与联系。

### **武汉办事处**

负责公司在华中地区的各项联络性事务，不从事经营性活动。

### **12、人员情况：**

截至 2011 年 9 月，公司现有正式员工 109 人，博士学历 2 人，占 2%；硕士学历 58 人，占 53%；本科学历 41 人，占 37%；专科学历 6 人，占 6%；其它 2 人，占 2%。

### **13、信息披露负责人及咨询电话：**

周永刚，(021) 61009999

### **14、基金管理业务情况简介：**

目前公司已具有发起设立公募基金、特定客户资产管理业务和合格境内机构投资者（QDII）业务资格。

截止 2011 年 9 月 16 日，目前公司旗下共有 12 只开放式基金，其中 1 只为货币型基金，3 只为债券型基金，1 只为混合型基金，6 只为股票型基金，1 只为 QDII 基金。专户理财业务方面，我公司现管理 1 只“一对一”资产管理计划和 3 只“一对多”资产管理计划。

公司最近一年内没有因违法违规行为收到行政处罚或者刑事处罚，没有因违法违规行为正在被监管机构调查，或者处于整改期间，不存在对基金运作已经造成或可能造成不良影响的重大变更事项，或者诉讼、仲裁等其他重大事项，不存在公司治理不健全、经营管理混乱、内部控制和 risk 管理制度无法得到有效执行、财务状况恶化等重大经营风险。

#### 15、本基金基金经理：

张文琍，高级工商管理硕士，上海财经大学 EMBA 毕业，具有基金从业资格和全国银行间同业拆借中心债券交易员资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理；2004 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任公司债券交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理职务，现任固定收益部副总监、长信中短债证券投资基金和本基金的基金经理。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国邮政储蓄银行有限责任公司

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 A 座

法定代表人：刘安东

成立时间：2007 年 3 月 6 日

注册资本：410 亿元人民币

存续期间：持续经营

托管部门负责人：徐进

信息披露负责人：徐进

电话：010-68858112

### 2、托管部门主要人员情况

徐进，托管业务部总经理，13 年金融从业经历，曾就职于中国邮政储蓄银行汇兑业务部、代理业务部，具有丰富的金融业务管理经验。

### 3、托管业务主要经营情况

2009年7月23日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第16家托管银行。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至2011年8月31日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共5只，包括中欧中小盘股票型证券投资基金（LOF）（166006）、长信中短债证券投资基金（519985）、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利分级债券型证券投资基金（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）。托管的特定客户资产管理计划共10只，其中5只已到期，包括南方-灵活配置之出口复苏1号资产管理计划、景顺长城基金-邮储银行-稳健配置型特定多个客户资产管理计划、银华灵活精选资产管理计划、长盛灵活配置资产管理计划、富国基金-邮储银行-绝对回报策略混合型资产管理计划、光大保德信-邮储银行-灵活配置1号客户资产管理计划、大成-邮储银行-灵活配置1号特定多个客户资产管理计划、银华灵活配置资产管理计划、长盛-邮储-灵活配置2号资产管理计划、南方灵活配置2号资产管理计划等。至今中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达326.15亿元。

### （三）上市推荐人

无

### （四）基金验资机构

名称：上海众华沪银会计师事务所

法定代表人：孙勇

注册地址：上海市嘉定工业区沪宜路叶城路口

联系电话：（021）63525500

经办注册会计师：程月敏、袁宙

## 六、基金合同摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1、基金管理人简况

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

法定代表人：田丹

成立时间：2003 年 5 月 9 日

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

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

### 2、基金管理人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集基金；

(2) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

(3) 依照本基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

(6) 在符合有关法律法规和本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认

购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

(7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(8) 自行担任注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(9) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(10) 依法召集基金份额持有人大会；

(11) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(12) 依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

(14) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(2) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(3) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

(4) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金财产分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第

三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

(9) 办理基金备案手续；

(10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

(12) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回及注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(13) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(14) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(16) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(17) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(18) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(19) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(20) 建立并保存基金份额持有人名册；

(21) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(22) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(24) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

(26) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(27) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(28) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(29) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(30) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他义务。

### 3、基金托管人简况

名称：中国邮政储蓄银行有限责任公司

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 A 座

法定代表人：刘安东

成立时间：2007 年 3 月 6 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2006】484 号

注册资本：410 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673 号

### 4、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

(7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(6) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(7) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

(9) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

- (10) 按照规定监督基金管理人的投资运作;
- (11) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- (12) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (13) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
- (14) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
- (15) 根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册;
- (16) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;
- (17) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- (18) 参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (19) 因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
- (20) 按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务,基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;
- (21) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会和中国银监会,并通知基金管理人;
- (22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;
- (23) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他义务。

## 5、基金份额持有人

本基金基金合同生效之日起 5 年内,利鑫 A、利鑫 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额按照基金合同约定在各自份额级别内具有同等的合法权益;本基金基金合同生效后 5 年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- (9) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用;
- (3) 在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- (6) 遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则;
- (7) 返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;
- (8) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。

- (1) 本基金基金合同生效之日起 5 年内,基金份额持有人大会的审议事项

应分别由利鑫 A、利鑫 B 的基金份额持有人独立进行表决。利鑫 A、利鑫 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

(2) 本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金（LOF）。基金份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。

## 2、召开事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- 1) 终止基金合同；
  - 2) 转换基金运作方式，但本基金在基金合同生效后 5 年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外；
  - 3) 变更基金类别；
  - 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
  - 5) 变更基金份额持有人大会议事程序；
  - 6) 更换基金管理人、基金托管人；
  - 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
  - 8) 本基金与其他基金的合并；
  - 9) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
  - 10) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- 本基金基金合同生效之日起 5 年内，依据基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、会议表决权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有利鑫 A、利鑫 B 各自的基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人”或其类似表述。
- 11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
  - 12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:

- 1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用;
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低本基金的赎回费率;
- 3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- 4) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- 6) 根据法律法规或中国证监会的相关规定, 本基金推出新业务或服务;
- 7) 经中国证监会的允许, 基金管理人、基金注册登记机构或代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则;
- 8) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本基金合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 基金托管人仍认为有必要召开的, 应当自行召集并确定会议时间、地点、方式和权益登记日。

(4) 代表基金份额 10%以上(以上含本数, 以基金管理人收到书面提议当日的基金份额计算, 下同)的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 60 日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开

的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

#### 4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体和基金管理人网站上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；
- 3) 会议形式；
- 4) 议事程序；
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- 6) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 7) 表决方式；
- 8) 会务常设联系人姓名、电话；
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交的截止时间和收取方式。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金

管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### 5、基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。在法律法规或监管机构允许的情况下，在符合会议通知载明形式的前提下，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式表决。

4) 基金份额持有人大会具体召开的方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人的事宜，必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

##### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同），（本基金基金合同生效之日起 5 年内，指“有效的利鑫 A 和利鑫 B 各自的基金份额分别合计不少于该级基金份额的 50%（含 50%）”）；

②亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

##### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后,在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;

②召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的,不影响表决效力;

③本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% (含 50%), (本基金基金合同生效之日起 5 年内,指“基金份额持有人所持有的利鑫 A 和利鑫 B 各自的基金份额分别合计不小于在权益登记日该级基金总份额的 50% (含 50%)”);

④直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代表,同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符;

如果开会条件达不到上述的条件,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后),且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

3) 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案),大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律

法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## （2）议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）（本基金基金合同生效之日起 5 年内，指“出席大会的利鑫 A 和利鑫 B 各自的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）”）选举产生一名基金份额持有人，作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人

姓名（或单位名称）等事项。

## 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。但在本基金基金合同生效之日起 5 年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由利鑫 A、利鑫 B 的基金份额持有人独立进行表决，且利鑫 A、利鑫 B 的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应的基金份额级别内享有平等表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）（本基金基金合同生效之日起 5 年内，指“参加大会的利鑫 A 和利鑫 B 各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）”）通过方为有效，除下列 2) 所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

### 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二（含三分之二）（本基金基金合同生效之日起 5 年内，指“参加大会的利鑫 A 和利鑫 B 各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）”）通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式（本基金在基金合同生效后 5 年期届满时转换为上市开放式基金（LOF）除外）、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

(4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力及表决结果。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4) 计票过程应由公证机关予以公证。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

## 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中

中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在指定媒体和基金管理人网站上公告。

(4) 如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

### (三) 基金收益分配原则、执行方式

#### 1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

#### 2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### 3、收益分配原则

##### (1) 本基金基金合同生效之日起 5 年内的收益分配原则

本基金基金合同生效之日起 5 年内，不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

##### (2) 本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的收益分配原则

1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

3) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资。

场外转入或申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式，如投资者在某一销售机构交易账户不选择收益分配方式，则按默认的收益分配方式处理；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现

金分红；

场内转入、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

4) 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

5) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

6) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 5、收益分配方案的确定、公告与实施

(1) 本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

(2) 本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

(3) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6、收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

(四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

## 1、基金费用的种类

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

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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，法律法規和基金合同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

本基金年管理费率为年费率 0.70%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### (2) 基金托管人的托管费

本基金年托管费率为年费率 0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

### （3）基金销售服务费

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

本基金年销售服务费率为年费率 0.35%。

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

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

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

（4）上述 1 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。

### （五）基金财产的投资方向和投资限制

#### 1、投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证及因投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类品种。

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

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

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 3、投资限制

基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的 20%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；

(3) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(5) 本基金不能在二级市场主动投资权证，但可以通过一级市场申购可分离债等方式持有权证。本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%；法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；

(6) 本基金进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，，中国证监会规定的特殊品种除外；

(9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(12) 本基金持有的所有流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净值的 10%；本基金持有的同一流通受限证券，其公允价值不得超过本基金资产净

值的 5%，经基金管理人和托管人协商，并履行相关程序后，可对以上比例进行调整；

(13) 本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

(14) 法律法规或监管部门规定的其他限制。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

以后如有法律法规或监管机构允许的其他基金投资品种，投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

## (六) 基金资产净值的计算方法和公告方式

### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 2、估值方法

#### (1) 股票估值方法

##### 1) 上市股票的估值

上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

##### 2) 未上市股票的估值

①首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的估值价格进行估值；

④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) — 2) 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认

为按本项第 1) —2) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

4) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

## (2) 债券估值方法

1) 在证券交易所市场挂牌交易且实行净价交易的债券按估值日收盘价估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易且未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量。

5) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

7) 在任何情况下,基金管理人如采用本项第 1) —6) 小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第 1) —6) 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

8) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(3) 权证估值方法

1) 基金持有的权证, 从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易市价, 确定公允价格。

2) 首次发行未上市的权证, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。

3) 因持有股票而享有的配股权, 以及停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1) — 3) 项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(4) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

根据《基金法》, 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此, 就与本基金有关的会计问题, 如基金管理人和基金托管人在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意見, 基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

3、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

基金合同生效后, 在利鑫 A 的首次开放日前或者利鑫 B 上市交易前, 基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值以及利鑫 A 和利鑫 B 的基金份额参考净值。

在利鑫 A 的首次开放日后或者利鑫 B 上市交易后, 基金管理人应当在每个交易日的次日, 通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介, 披露基金份额净值、利鑫 A 和利鑫 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金

份额净值以及利鑫 A 和利鑫 B 的基金份额参考净值并于前款规定的市场交易日的次日将基金资产净值、基金份额净值、利鑫 A 和利鑫 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值登载在指定媒体上。

本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露本基金的基金份额净值和基金份额累计净值；基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

### （七）基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### 1、基金合同的变更

（1）按照法律法规或本基金合同的规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效。

（2）但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

1) 调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费和其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式) 调低本基金的赎回费率或收费方式；

3) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

4) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

5) 基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

6) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

7) 经中国证监会的允许，基金管理人、基金注册登记机构或销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

8) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

#### 2、本基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后本基金合同终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人、基金托管人承接的；
- (3) 基金合同约定或相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

#### (1) 基金财产清算小组

1) 自基金合同终止情形发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和基金托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3) 基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### (2) 基金财产清算程序

- 1) 基金合同终止情形发生时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- 2) 根据法律法规及基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算报告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

(4) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 交纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

①本基金在基金合同生效之日起 5 年内清算时的基金清算财产分配

本基金基金合同生效之日起 5 年内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，将优先满足利鑫 A 的本金及应计收益分配，如有剩余部分，则由利鑫 B 的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

②本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金基金合同生效后 5 年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用)交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

(5) 基金财产清算的公告

基金财产清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立在指定媒体上公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算小组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

(6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

(八) 争议解决方式

对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费由败诉方承担。

除争议所涉内容之外,本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

争议处理期间,基金合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### (九) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册,供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 七、基金财务状况

深圳证券交易所所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

长信利鑫分级债券型证券投资基金 2011 年 9 月 16 日资产负债表如下：

单位：人民币元

项目	行次	2011 年 9 月 16 日
<b>资产：</b>		
银行存款	1	501,283,311.75
结算备付金	2	260,956.92
存出保证金	3	—
交易性金融资产	4	168,405,335.50
其中：股票投资	5	—
债券投资	6	168,405,335.50
资产支持证券投资	7	—
衍生金融资产	8	—
买入返售金融资产	9	—
应收证券清算款	10	—
应收利息	11	9,160,636.96
应收股利	12	—
应收申购款	13	—
其他资产	14	—
资产总计	15	679,110,241.13
<b>负债：</b>		
短期借款	16	—
交易性金融负债	17	—
衍生金融负债	18	—
卖出回购金融资产款	19	37,599,747.50
应付证券清算款	20	—
应付赎回款	21	—
应付管理人报酬	22	196,580.39
应付托管费	23	56,165.80
应付销售服务费	24	98,290.20
应付交易费用	25	4,481.82
应交税费	26	—
应付利息	27	3,432.16

应付利润	28	—
其他负债	29	128,421.58
负债合计	30	38,087,119.45
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	31	636,483,025.08
未分配利润	32	4,540,096.60
所有者权益合计	33	641,023,121.68
负债和所有者权益总计	34	679,110,241.13

## 八、基金投资组合

截至 2011 年 9 月 16 日,长信利鑫分级债券型证券投资基金的投资组合如下:

### (一) 期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中:股票	—	—
2	固定收益投资	168,405,335.50	24.80%
	其中:债券	168,405,335.50	24.80%
	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	501,544,268.67	73.85%
6	其他资产	9,160,636.96	1.35%
7	合计	679,110,241.13	100.00%

### (二) 期末按行业分类的股票投资组合

本基金期末未持有股票投资资产。

### (三) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金期末未持有股票投资资产。

### (四) 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	28,919,335.50	4.51%
5	企业短期融资券	139,486,000.00	21.76%
6	中期票据	—	—

7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	168,405,335.50	26.27%

## (五) 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	041159003	11北电CP001	300,000	29,976,000.00	4.68%
2	1181394	11湘投CP01	200,000	19,980,000.00	3.12%
3	1181368	11珠啤CP02	200,000	19,924,000.00	3.11%
4	1181107	11酒钢CP01	200,000	19,920,000.00	3.11%
5	122836	11盘锦债	199,550	18,919,335.50	2.95%

## (六) 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

本基金期末未持有资产支持证券。

## (七) 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

本基金期末未持有权证。

## (八) 投资组合报告批注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、截至2011年9月16日，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 3、其他资产构成

单位：人民币元

其他资产明细	金额
交易保证金	—
应收证券清算款	—
应收股利	—
应收利息	9,160,636.96
应收申购款	—

其他应收款	-
待摊费用	-
其他	-
合计	9,160.636.96

4、期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截止到 2011 年 9 月 16 日，本基金没有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

截止到 2011 年 9 月 16 日，本基金没有持有股票投资。

6、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、备查文件目录

本基金备查文件包括以下文件：

- （一）中国证监会核准基金募集的文件；
- （二）《长信利鑫分级债券型证券投资基金基金合同》；
- （三）《长信利鑫分级债券型证券投资基金托管协议》；
- （四）《长信利鑫分级债券型证券投资基金招募说明书》；
- （五）法律意见书；
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照；
- （八）中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所

查阅方式：基金投资者可在办公时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（<http://www.cxfund.com.cn>）查阅。

长信基金管理有限责任公司

2011年9月20日