

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2018 年第【2】号

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 5 月 20 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】919 号文注册募集。本基金合同于 2015 年 6 月 9 日正式生效。

重要提示

长信基金管理有限责任公司（以下简称“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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金投资人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等。

本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金的投资范围为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（包括中小板、创

业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货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相关规定),投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2018年6月9日,有关财务数据和净值表现截止至2018年3月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国民生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 | 壹亿陆仟伍佰万元人民币 |
| 成立日期 | 2003年5月9日 |
| 组织形式 | 有限责任公司 |
| 法定代表人 | 成善栋 |
| 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 | 44.55% |
| | 上海海欣集团股份有限公司 | 5149.5 万元 | 31.21% |
| | 武汉钢铁股份有限公司 | 2500.5 万元 | 15.15% |
| | 上海彤胜投资管理中心（有限合伙） | 751 万元 | 4.55% |
| | 上海彤骏投资管理中心（有限合伙） | 749 万元 | 4.54% |
| | 总计 | 16500 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 |
| 成善栋 | 董事长 | 男 | 中共党员，硕士研究生，IMBA，曾任职中国人民银行上海市分行静安区办事处办公室科员，中国人民银行上海市分行、工商银行上海市分行办公室科员、科长，上海巴黎国际银行信贷部总经理，工商银行上海市分行办公室副主任、管理信息部总经理、办公室主任、党委委员、副行长，并历任上海市金融学会副秘书长，上海城市金融学会副会长、秘书长。 |
| 刘元瑞 | 非独立董事 | 男 | 中共党员，硕士研究生，现任长江证券股份有限公司总裁。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管，长江证券承销保荐有限公司总裁助理，长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。 |
| 陈谋亮 | 非独立董事 | 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。现任上海市湖北商会常务副会长，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、总裁。 |
| 何宇城 | 非独立董事 | 男 | 中共党员，硕士，MBA、EMPACC。现任武汉钢铁有限公司副总经理。曾任宝钢计划财务部助理会计师，宝钢资金管理处费用综合管理，宝钢成本管理处冷轧成本管理主办、主管，宝钢股份成本管理处综合主管，宝钢股份财务部预算室综合主管， |

| | | | |
|--------------------------|-------|---|---|
| | | | 宝钢股份财务部副部长，宝钢分公司炼钢厂副厂长，不锈钢分公司副总经理，宝钢股份钢管条钢事业部副总经理兼南通宝钢钢铁有限公司董事长、经营财务部部长。 |
| 覃波 | 非独立董事 | 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、投资决策委员会主任委员。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。 |
| 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。 |
| 徐志刚 | 独立董事 | 男 | 中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长、党委副书记，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业（集团）有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询（上海）有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。 |
| 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 |
| 吴伟 | 监事会主席 | 男 | 中共党员，研究生学历。现任武汉钢铁股份有限公司经营财务部总经理。历任武钢计划财务部驻工业港财务科副科长、科长、资金管理处主任科员、预算统计处处长，武汉钢铁股份有限公司计划财务部副部长。 |
| 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总经理助理兼零售服务部总监。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、运营总监兼基金事务部总监。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。 |
| 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）。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众 |

| | | | |
|--|------|---|--|
| | | | 债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 程燕春 | 副总经理 | 男 | 华中科技大学技术经济学士，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，曾任中国建设银行江西省分行南昌城东支行副行长，中国建设银行纪检监察部案件检查处监察员，中国建设银行基金托管部市场处、信息披露负责人，融通基金管理有限公司筹备组成员、总经理助理兼北京分公司总经理、上海分公司总经理、执行监事，金元惠理基金管理有限公司首席市场官，历任长信基金管理有限责任公司总经理销售助理、总经理助理。 |
| 注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2018 年 7 月 10 日起，李小羽先生不再担任长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理； 3、自 2018 年 7 月 11 日起，李小羽先生不再担任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 | | | |

4、基金经理

| 本基金基金经理情况 | | | |
|-----------|---------------|----------------------------|--|
| 姓名 | 职务 | 任职时间 | 简历 |
| 李小羽 | 副总经理、 基金经理 | 自 2016 年 5 月 24 日起至今 | 简历同上 |
| 王夏儒 | 基金经理 | 自 2018 年 5 月 29 日起至今 | 上海财经大学管理学硕士，具有基金从业资格。曾任职于长江证券股份有限公司、华富基金管理有限责任公司、华创证券有限责任公司。2017 年加入长信基金管理有限责任公司，曾任职于固收专户投资部，现任职于混合债券部并担任长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 吴晖 | 基金经理 助理 | 自 2017 年 7 月 28 日起至今 | 清华大学工程学硕士毕业，具有基金从业资格。曾任职于上海浦东发展银行、东方证券股份有限公司，2017 年 5 月加入长信基金管理有限责任公司，现任职于混合债券部，担任长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈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和长信可转债债券型证券投资基金的基金经理助理。 |
| 黄韵 | 基金经理 | 自 2016 年 2 月 6 日起至 2018 | 曾任本基金的基金经理。 |

| | | | |
|--|------|------------------------------|-------------|
| | | 年 2 月 6 日 | |
| 刘波 | 基金经理 | 自基金合同生效之日起至 2016 年 12 月 22 日 | 曾任本基金的基金经理。 |
| 注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2018 年 7 月 10 日起，李小羽先生不再担任长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理； 3、自 2018 年 7 月 11 日起，李小羽先生不再担任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 | | | |

5、投资决策委员会成员

| 投资决策委员会成员 | |
|-----------|---|
| 姓名 | 职务 |
| 覃波 | 总经理、投资决策委员会主任委员 |
| 李小羽 | 副总经理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理 |
| 常松 | 总经理助理兼混合策略部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理 |
| 安昀 | 总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信内需成长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和长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 |
| 杨帆 | 国际业务部副总监、投资决策委员会执行委员、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理 |
| 高远 | 研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理 |
| 易利红 | 股票交易部总监 |
| 张文珺 | 固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理 |

| | |
|--|---|
| 陆莹 | 现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理 |
| 邓虎 | 养老 FOF 投资部总监兼基金经理 |
| 叶松 | 权益投资部总监、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金和长信多利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 |
| 左金保 | 量化投资部总监、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理 |
| 张飒岚 | 固收专户投资部总监兼投资经理 |
| 姚奕帆 | 量化专户投资部投资经理 |
| 秦娟 | 混合债券部总监 |
| 李欣 | 债券交易部副总监 |
| 陈言午 | 专户投资部投资经理 |
| 注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2018 年 7 月 10 日起，李小羽先生不再担任长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理； 3、自 2018 年 7 月 11 日起，李小羽先生不再担任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理； 4、自 2018 年 7 月 19 日起，叶松先生开始担任长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 | |

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1. 基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：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：洪崎

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000年12月19日，中国民生银行A股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003年3月18日，中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009年11月26日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2013年度，民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳资金托管银行”及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届“21世纪亚洲金融年会”上，民生银行荣获“2013·亚洲最佳投资

金融服务银行”大奖。

在“2013 第五届卓越竞争力金融机构评选”中，民生银行荣获“2013 卓越竞争力品牌建设银行”奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书（2013）》中，民生银行荣获“中国企业上市公司社会责任指数第一名”、“中国民营企业社会责任指数第一名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在 2013 年第十届中国最佳企业公民评选中，民生银行荣获“2013 年度中国最佳企业公民大奖”。

2013 年还获得年度品牌金博奖“品牌贡献奖”。

2014 年获评中国银行业协会“最佳民生金融奖”、“年度公益慈善优秀项目奖”。

2014 年荣获《亚洲企业管治》“第四届最佳投资者关系公司”大奖和“2014 亚洲企业管治典范奖”。

2014 年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”称号。

2014 年还荣获《亚洲银行家》“中国最佳中小企业贸易金融银行奖”，获得《21 世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖，获评《经济观察报》“年度卓越私人银行”等。

2015 年度，民生银行在《金融理财》举办的 2015 年度金融理财金貔貅奖评选中荣获“金牌创新力托管银行奖”。

2015 年度，民生银行荣获《EUROMONEY》2015 年度“中国最佳实物黄金投资银行”称号。

2015 年度，民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书（2015）》“中国银行业社会责任发展指数第一名”。

2015 年度，民生银行在《经济观察报》主办的 2014-2015 年度中国卓越金融奖评选中荣获“年度卓越创新战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。

2016 年度，民生银行荣获 2016 胡润中国新金融 50 强和 2016 中国最具创新模式新金融企业奖。

2、主要人员情况

张庆先生，中国民生银行资产托管部总经理，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，曾先后从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作，具有 25 年金融从业经历，不仅有丰富的一线实战经验，还有扎实的总部管理经验。历任海南国际租赁有限公司经理，富岛基金投资经理，中国民生银行西安分行副行长，中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 64 人，平均年龄 36 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2018 年 3 月 31 日，中国民生银行已托管 183 只证券投资基金。中国民生银行于 2007 年推出“托付民生·安享财富”托管业务品牌，塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象，赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评，深化了与客户的战略合作。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1、内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

2、内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行股份有限公司审计部、资产托管部内设风险监督中心及资产托管部各业务中心共同组成。总行审计部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的风险监督中心，负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划，组织、指导、协调、监督各业务中心风险控制工作的实施。各业务中心在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)全面性原则：风险控制必须覆盖资产托管部的所有中心和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则：资产托管部设立独立的风险监督中心，该中心保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则：各中心在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

4、内部风险控制制度和措施

(1)制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估：风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6)应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1)坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2)实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3)建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4)以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5)制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6)将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强

的自动风险控制功能。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、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、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

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：成善栋 | 联系人：陈竹君 |
| 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 |
| (2) 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：尤习贵 | 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 |
| (3) 第一创业证券股份有限公司 | |
| 注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 | |
| 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：吴军 |
| 电话：0755-23838751 | 传真：0755-25831754 |
| 客户服务电话：95358 | 网址：www.firstcapital.com.cn |
| (4) 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 |
| (5) 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：95525 | 网址：www.ebscn.com |
| (6) 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 |
| (7) 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：四川省成都市东城根上街 95 号 | |
| 法定代表人：冉云 | 联系人：刘婧漪、贾鹏 |
| 电话：028-86690057、028-86690058 | 传真：028-86690126 |
| 客户服务电话：95310 | 网址：www.gjzq.com.cn |
| (8) 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：95521 | 传真：021-38670666 |
| 客户服务热线：4008888666 | 网址：www.gtja.com |
| | |
| (9) 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 |
| | |
| (10) 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 |
| | |
| (11) 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 |
| | |
| (12) 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 |
| | |
| (13) 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 |
| | |
| (14) 平安证券股份有限公司 | |
| 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：周一涵 |
| 电话：0755-22626391 | 传真：0755-82400862 |

| | | | |
|-------------------------------------|--|-------------------------|--|
| 客户服务电话：95511—8 | | 网址：www.stock.pingan.com | |
| | | | |
| (15) 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 | |
| | | | |
| (16) 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 | |
| | | | |
| (17) 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 | |
| | | | |
| (18) 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 | |
| | | | |
| (19) 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 | |
| | | | |
| (20) 西藏东方财富证券股份有限公司 | | | |
| 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 | |

| | |
|--|--------------------------|
| (21) 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：上海市浦东新区长柳路 36 号 | |
| 法定代表人：杨华辉 | 联系人：乔琳雪 |
| 电话：021-38565547 | |
| 客户服务电话：95562 | 网址：www.xyzq.com.cn |
| (22) 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 |
| (23) 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 2-6 层 | |
| 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：陈共炎 | 联系人：邓颜 |
| 电话：010-66568292 | 传真：010-66568990 |
| 客户服务电话：4008-888-888 | 网址：www.chinastock.com.cn |
| (24) 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 |
| (25) 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 |
| (26) 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 |

| | |
|--|----------------------|
| (27) 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：深圳市福田区莲花街道益田路 6013 号江苏大厦 B 座 15 楼 | |
| 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：95329 | 网址：www.zszq.com.cn |
| (28) 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 |
| (29) 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：吴坚 | 联系人：张煜 |
| 电话：023-63786633 | 传真：023-63786212 |
| 客服热线：4008096096 | 网址：www.swsc.com.cn |
| (30) 蚂蚁（杭州）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 |
| (31) 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：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 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 |
| (32) 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 |
| (33) 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 |
| | |
| (34) 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.licaik.com |
| | |
| (35) 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 |
| | |
| (36) 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 |
| | |
| (37) 上海汇付基金销售有限公司 | |
| 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 |
| | |
| (38) 上海陆金所基金销售有限公司 | |
| 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 |
| | |
| (39) 大泰金石基金销售有限公司 | |
| 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：袁頌明 | 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.dtfunds.com |
| | |
| (40) 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：陈东 |
| 电话：021-52822063 | 传真：021-52975270 |
| 客户服务电话：400-046-6788 | 网址：www.66zichan.com |
| | |
| (41) 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 |
| | |
| (42) 上海凯石财富基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室 | |
| 办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼 | |
| 法定代表人：陈继武 | 联系人：葛佳蕊 |
| 电话：021-80365020 | 传真：021-63332523 |
| 客户服务电话：4006433389 | 网址：www.vstonewealth.com |
| | |
| (43) 上海利得基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 | |
| 办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼 | |
| 法定代表人：李兴春 | 联系人：徐鹏 |
| 电话：86-021-50583533 | 传真：86-021-50583633 |
| 客户服务电话：400-921-7755 | 网站： http://a.leadfund.com.cn/ |
| | |
| (44) 珠海盈米财富管理有限公司 | |
| 注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 | |
| 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 | |
| 法定代表人：肖雯 | 联系人：钟琛 |
| 电话：020-89629012 | 传真：020-89629011 |
| 客户服务电话：020-89629066 | 网站：www.yingmi.cn |
| | |
| (45) 北京汇成基金销售有限公司 | |
| 注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 | |
| 办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 | |

| | |
|---|------------------------|
| 法定代表人：王伟刚 | 联系人：丁向坤 |
| 电话：010-56282140 | 传真：010-62680827 |
| 客户服务电话：400-619-9059 | 网站：www.hcjjin.com |
| (46) 上海华夏财富投资管理有限公司 | |
| 注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室 | |
| 办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层 | |
| 法定代表人：李一梅 | 联系人：仲秋玥 |
| 电话：010-88066632 | 传真：010-88066552 |
| 客户服务电话：4008175666 | 网站：www.amcfortune.com |
| (47) 和谐保险销售有限公司 | |
| 注册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302 | |
| 办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 6 号安邦金融中心 | |
| 法定代表人：蒋洪 | 联系人：张楠 |
| 电话：010-85256214 | |
| 客户服务电话：4008195569 | 网站：www.hx-sales.com |
| (48) 一路财富（北京）信息科技股份有限公司 | |
| 注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208 | |
| 办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208 | |
| 法定代表人：吴雪秀 | 联系人：徐越 |
| 电话：010-88312877-8032 | 传真：010-88312099 |
| 客户服务电话：400-001-1566 | 网站：www.yilucaifu.com |
| (49) 北京蛋卷基金销售有限公司 | |
| 注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 | |
| 办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507 | |
| 法定代表人：钟斐斐 | 联系人：戚晓强 |
| 电话：010-61840688 | 传真：010-61840699 |
| 客户服务电话：4000-618-518 | 网站：www.danjuanapp.com |
| (50) 上海基煜基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区） | |
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室 | |
| 法定代表人：王翔 | 联系人：张巍婧 |
| 电话：021-65370077-255 | 传真：021-55085991 |
| 客户服务电话：400-820-5369 | 网站：www.jiyufund.com.cn |
| 3、场内销售机构 | |
| 场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站： http://www.sse.com.cn | |

注：1、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。

2、长信利盈 C 类份额暂不在代销机构及场内销售机构进行销售，具体上线时间待基金管理人届时公告。

（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 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 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 | 上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼 |
| 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 | 上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼 |
| 法定代表人 | 周明 | 廖海（负责人） | 曾顺福 |
| 联系电话 | 010-59378856 | 021-51150298 | 021-61418888 |
| 传真 | 010-59378907 | 021-51150398 | 021-61411909 |
| 联系人 | 崔巍 | 廖海、刘佳 | 曾浩（曾浩、吴凌志为经办注册会计师） |

四、基金的名称

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括

国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货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相关规定)。

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

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%;债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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占基金资产的 5%-100%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等),并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型,动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。

2、股票投资策略

(1) 行业配置策略

在行业配置层面,本基金将运用“自上而下”的行业配置方法,通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究,采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。

(2) 个股投资策略

本基金将结合定性与定量分析,主要采取自下而上的选股策略。基金依据约

定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。

① 品质评估分析

品质评估分析是本基金管理人基于企业的全面评估，对企业价值进行的有效分析和判断。上市公司品质评估分析包括财务品质评估和经营品质评估。

② 风险因素分析

风险因素分析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，包括竞争引致的主营业务衰退风险、管理风险、关联交易、投资项目风险、股权变动、收购兼并等。另一个是利用统计模型对风险因素进行敏感性分析。

③ 估值分析

个股的估值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、P/E 模型、EV/EBIT 模型、Franchise P/E 模型等估值模型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、债券投资策略

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的绝对收益。

(1) 久期策略

久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

(2) 收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。

(3) 骑乘策略

本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以

达到增强组合的持有期收益的目的。

（4）息差策略

本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

（5）个券选择策略

本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

（6）信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

（7）中小企业私募债投资策略

中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。

4、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。

（1）权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险，有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过权证标的股票基本面的研究，并结合期权定价模型，评估权证的合理投资价值，在有效控制风险的前提下进行权证投资；

本基金将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，包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略，杠杆交易策略等，利用权证进行对冲和套利等。

(2) 资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录和损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析,形成对资产证券的风险和收益进行综合评估,同时依据资产支持证券的定价模型,确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上,本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率,对资产支持证券进行跟踪和测评,从而形成有效的风险评估和控制。

(3) 股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准: 银行一年期定期存款利率(税后)+3%

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时,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,属于中等风险、中等收益的基金品种,其预期风险和

预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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 2018 年 3 月 31 日（摘自本基金 2018 年 1 季报），本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 198,592,406.58 | 18.53 |
| | 其中：股票 | 198,592,406.58 | 18.53 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 785,427,595.64 | 73.28 |
| | 其中：债券 | 785,427,595.64 | 73.28 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 54,462,259.52 | 5.08 |
| 8 | 其他资产 | 33,301,605.50 | 3.11 |
| 9 | 合计 | 1,071,783,867.24 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

（二）报告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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 31,203,652.09 | 3.06 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 26,402.87 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 19,029,659.62 | 1.86 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 34,203.96 | 0.00 |
| J | 金融业 | 84,020,232.04 | 8.23 |
| K | 房地产业 | 64,278,256.00 | 6.29 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 198,592,406.58 | 19.45 |

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

(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 | 000002 | 万科A | 700,000 | 23,303,000.00 | 2.28 |
| 2 | 601336 | 新华保险 | 499,917 | 23,006,180.34 | 2.25 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 1,100,000 | 20,438,000.00 | 2.00 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 1,499,913 | 16,349,051.70 | 1.60 |
| 5 | 601939 | 建设银行 | 2,000,000 | 15,500,000.00 | 1.52 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 1,100,000 | 14,817,000.00 | 1.45 |
| 7 | 000537 | 广宇发展 | 1,000,000 | 13,080,000.00 | 1.28 |
| 8 | 001979 | 招商蛇口 | 599,920 | 13,078,256.00 | 1.28 |
| 9 | 600031 | 三一重工 | 1,500,000 | 11,790,000.00 | 1.15 |
| 10 | 600567 | 山鹰纸业 | 2,500,000 | 11,350,000.00 | 1.11 |

(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 | 9,766,241.80 | 0.96 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 88,971,000.00 | 8.71 |
| | 其中：政策性金融债 | 88,971,000.00 | 8.71 |
| 4 | 企业债券 | 259,486,296.25 | 25.41 |
| 5 | 企业短期融资券 | 44,992,000.00 | 4.41 |
| 6 | 中期票据 | 79,752,000.00 | 7.81 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 4,990,057.59 | 0.49 |
| 8 | 同业存单 | 297,470,000.00 | 29.13 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 785,427,595.64 | 76.91 |

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 170410 | 17农发10 | 600,000 | 60,024,000.00 | 5.88 |
| 2 | 111807056 | 18招商银行CD056 | 500,000 | 49,805,000.00 | 4.88 |
| 2 | 111809073 | 18浦发银行CD073 | 500,000 | 49,805,000.00 | 4.88 |
| 3 | 111803048 | 18农业银行CD048 | 500,000 | 49,470,000.00 | 4.84 |
| 3 | 111810123 | 18兴业银行CD123 | 500,000 | 49,470,000.00 | 4.84 |
| 4 | 111809074 | 18浦发银行CD074 | 500,000 | 49,465,000.00 | 4.84 |
| 5 | 111821100 | 18渤海银行CD100 | 500,000 | 49,455,000.00 | 4.84 |

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明

细

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券中，中信证券（600030）的发行主体于 2017 年 5 月 24 日发布《中信证券股份有限公司关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，主要内容如下：公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57 号），2011 年 2 月 23 日，司度（上海）贸易有限公司在中信证券开立普通证券账户，一直未从事证券交易，中信证券在司度（上海）贸易有限公司从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下，为其提供融资融券服务，于 2012 年 3 月 12 日开立了信用证券账户。2012 年 3 月 19 日，中信证券与司度（上海）贸易有限公司签订《融资融券业务合同》，致使司度（上海）贸易有限公司得以开展融券交易。上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》（证监会公告[2011]31 号），第十一条“对未按照要求提供有关情况、在本公司及与本公司具有控制关系的其他证券公司从事证券交易的时间连续计算不足半年，证券公司不得向其融资、融券”的规定”，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项“未按照规定与客户签订业务合同”所述行为。

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。该事件发生后，本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定的备选股票库的情形。

3、其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 690,824.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | 24,194,605.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,355,377.40 |
| 5 | 应收申购款 | 60,798.65 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 33,301,605.50 |

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 128015 | 久其转债 | 2,723,086.98 | 0.27 |

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、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。

基金 2018 年第 1 季度及历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

(一) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、长信利盈混合A份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

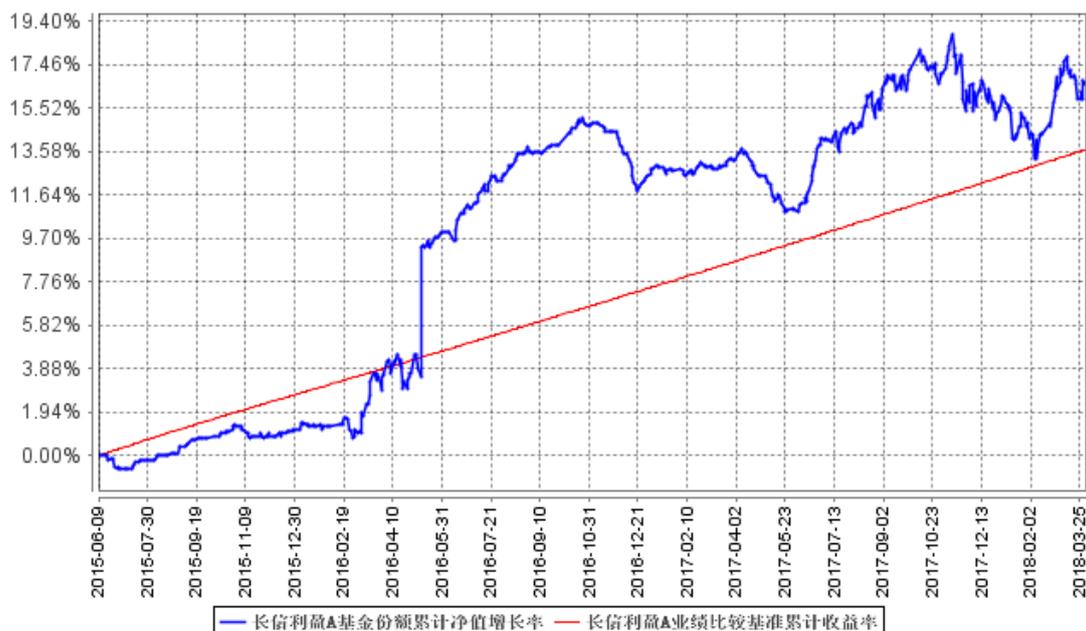
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2015年6月9日-2015年12月31日 | 1.20% | 0.07% | 2.69% | 0.01% | -1.49% | 0.06% |
| 2016年1月1日-2016年12月31日 | 11.17% | 0.41% | 4.61% | 0.01% | 6.56% | 0.40% |
| 2017年1月1日-2017年12月31日 | 2.58% | 0.26% | 4.60% | 0.01% | -2.02% | 0.25% |
| 2018年1月1日-2018年3月31日 | 1.13% | 0.37% | 1.12% | 0.01% | 0.01% | 0.36% |

2、长信利盈混合C份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

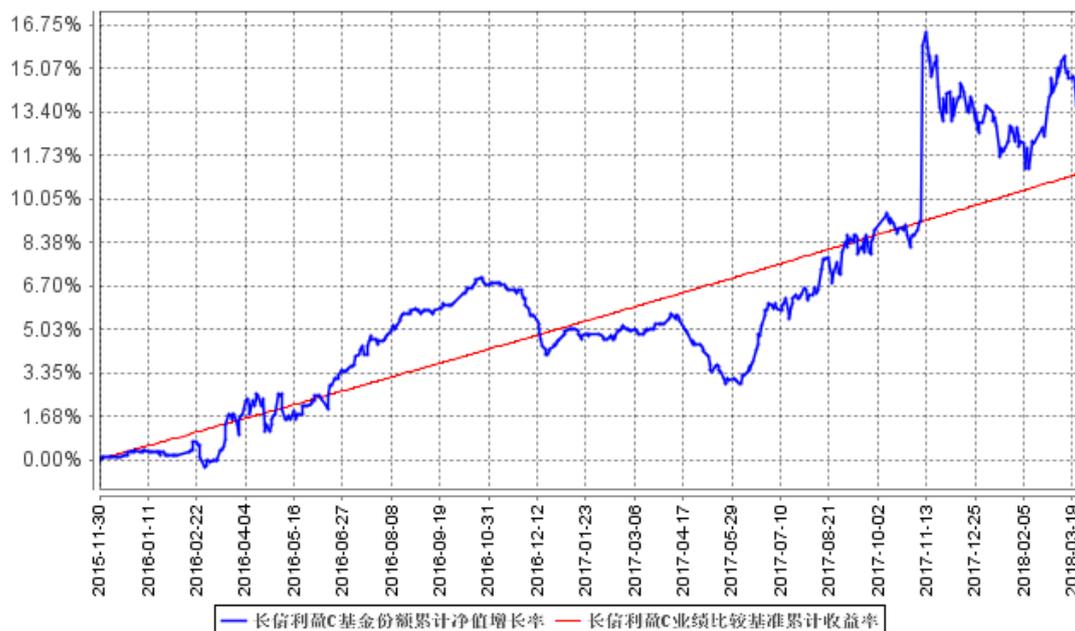
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2015年11月30日-2015年12月31日 | 0.40% | 0.04% | 0.40% | 0.01% | 0.00% | 0.03% |
| 2016年1月1日-2016年12月31日 | 4.24% | 0.18% | 4.61% | 0.01% | -0.37% | 0.17% |
| 2017年1月1日-2017年12月31日 | 7.95% | 0.45% | 4.60% | 0.01% | 3.35% | 0.44% |
| 2018年1月1日-2018年3月31日 | 1.23% | 0.38% | 1.12% | 0.01% | 0.11% | 0.37% |

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、长信利盈混合A自基金合同生效以来累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



2、长信利盈混合C自份额增加日以来累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、长信利盈混合 A 图示日期为 2015 年 6 月 9 日至 2018 年 3 月 31 日，长信利盈混合 C 图示日期为 2015 年 11 月 30 日（份额增加日）至 2018 年 3 月 31 日。

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

十三、费用概览

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) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金的证券、期货等交易费用；
- (8) 基金的银行汇划费用；
- (9) 证券账户开户费用、账户维护费用；
- (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。

2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 2 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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 2 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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

(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 0.25%。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。销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

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销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中划出，由登记机构代收，登记机构收到后按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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“1、基金费用的种类中第（4）—（10）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，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。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）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；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）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。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（二）与基金销售有关的费用

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，赎回时根据持有期限收取赎回费；C 类基金份额不收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

1、申购费用

投资者在申购本基金时交纳申购费用，申购费用按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金 A 类和 C 类基金份额的申购费率如下（场内外申购费率相同）：

| 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 < 500 万元 | 0.5% |
| | M ≥ 500 万元 | 每笔 1000 元 |
| C类基金份额 | 0 | |

注：M 为申购金额

2、赎回费用

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，本基金 A 类和 C 类基金份额的赎回费率如下(场内外赎回费率相同)：

| 费用种类 | 持有时间(Y) | 赎回费率 |
|--------|---------------|-------|
| A类基金份额 | Y < 7天 | 1.5% |
| | 7天 ≤ Y < 30天 | 0.75% |
| | 30天 ≤ Y < 6个月 | 0.50% |
| | 6个月 ≤ Y | 0 |
| C类基金份额 | Y < 7天 | 1.5% |
| | 7天 ≤ Y < 30天 | 0.5% |
| | Y ≥ 30天 | 0 |

注：Y 为持有期限

对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

3、转换费用与计算方式

本公司开通了长信利盈混合基金与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信双利优选混合基金、长信利丰债券基金 C 类份额（C 类代码：519989）、长信恒利优势混合基金、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、长信量化先锋混合基金 A 类份额（A 类代码：519983）、长信内需成长混合基金、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票

基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金 A 类份额（A 类代码：519965），长信利广混合基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金、长信利泰混合基金、长信利保债券基金、长信先锐债券基金、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利信混合基金、长信上证港股通指数型发起式基金、长信先优债券基金、长信中证 500 指数基金、长信乐信混合基金、长信低碳环保量化股票基金和长信消费精选股票基金之间的相互转换业务。具体业务信息详见本公司相关公告。

本公司于 2017 年 6 月 30 日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信上证港股通指数型发起式证券投资基金暂停转换转出和转换转入业务的公告》，自 2017 年 7 月 4 日起，暂停长信上证港股通指数型发起式基金的转换转入和转换转出业务。

根据中国证监会[2009]32 号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定，本公司从 2010 年 4 月 23 日起调整开放式基金转换业务规则。具体规则如下：

1、投资者进行基金转换时，转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取。当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时，费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额；当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，不收取费用补差。

2、转换份额的计算公式：

（1）非货币基金之间转换

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

（若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零）

（2）货币基金转至非货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益

$$\text{补差费} = \text{转出份额} \times \text{转出基金份额净值} \times \text{补差费率} \div (1 + \text{补差费率})$$
$$\text{转入确认金额} = \text{转出确认金额} - \text{补差费}$$
$$\text{转入确认份额} = \text{转入确认金额} \div \text{转入基金份额净值}$$

(货币基金份额净值为 1.00 元, 没有赎回费)

(3) 非货币基金转至货币基金

$$\text{转出确认金额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金份额净值}$$
$$\text{赎回费} = \text{转出确认金额} \times \text{赎回费率}$$
$$\text{转入确认金额} = \text{转出确认金额} - \text{赎回费}$$
$$\text{转入确认份额} = \text{转入确认金额} \div \text{货币基金份额净值}$$

(货币基金份额净值为 1.00 元, 补差费为零)

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》、《公开募集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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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,更新了公司基金管理人主要人员情况;
- 2、在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料;
- 3、在“五、相关服务机构”部分,更新了代销机构情况;
- 4、在“八、基金份额的申购与赎回”部分,更新了可转换的基金信息;
- 5、在“十、基金投资组合报告”部分,根据最新的定期报告,更新了相应的内容;
- 6、在“十一、基金的业绩”部分,根据最新的定期报告,更新了相应的内容,并经托管人复核;
- 7、在“二、释义”“八、基金份额的申购与赎回”“九、基金的投资”“十三、基金资产估值”“十七、基金的信息披露”“十八、风险揭示”“二十、基金合同的内容摘要”“二十一、基金托管协议的内容摘要”等部分,更新了《公

开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的相关内容；

8、在“二十三、其它应披露的事项”部分，更新了相应内容。

长信基金管理有限责任公司

二〇一八年七月二十三日