

## 长信长金货币市场基金 更新的招募说明书摘要

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

长信长金货币市场基金（以下简称“本基金”）由长信利息满溢场内实时申赎货币市场基金（以下简称“原基金”）变更注册而来，原基金于 2013 年 11 月 7 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】1411 号文注册，根据 2017 年 8 月 17 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1517 号文，准予原基金变更注册为本基金并募集。基金合同于 2017 年 9 月 8 日正式生效。

### 重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，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，利率风险，本基金持有的信用类固定收益品种违约带来的信用风险，债券投资出现亏损的风险，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。

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。本基金的投资范围为：1、现金；2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非

金融企业债务融资工具、资产支持证券；4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件，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。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为2019年3月8日(其中基金经理相关信息更新截止日为2019年11月29日)，有关财务数据和净值截止日为2018年12月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人交通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，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，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。 |
| 谢 辉   | 非独立董事 | 男  | 中共党员，硕士。现任武汉钢铁有限公司经营财务部部长。曾任武汉钢铁(集团)公司计划财务部会计处副主任科员、主任科员、处长，武汉钢铁(集团)公司企业管理部、运营改善部绩效考核处处长，武汉钢铁(集团)公司运营改善部绩效考核高级经理，武汉钢铁股份有限公司经营财务部副总经理，武汉钢铁有限公司经营财务部副部长。   |
| 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。   |
| 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。 |
| 刘斐                       | 独立董事 | 女 | 中共党员，工商管理硕士。现任国和创新教育基金（筹）合伙人。曾任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理、创始合伙人，上海国际集团旗下私募股权投资基金管理公司，浦银安盛基金管理有限公司总经理、董事（浦银安盛创始人），上海东新国际投资管理有限公司总经理、董事（浦发银行与新鸿基合资养老金投资管理公司），浦发银行办公室负责人。                |
| 马晨光                      | 独立董事 | 女 | 致公党党员，法律硕士。现任上海市协力律师事务所律师，管理合伙人，上海市浦东新区人大代表，中国致公党上海市浦东新区副主委，上海市法学会金融法研究会理事，上海国际仲裁中心仲裁员，上海仲裁委员会仲裁员，复旦大学研究生校外导师，华东政法大学校外兼职导师，上海对外经贸大学兼职教授，上海市浦东新区法律服务业协会副会长。                          |
| <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   |
| 余汉生   | 监事会主席 | 男  | 中共党员，本科学历，正高职高级会计师。现任中国宝武钢铁集团有限公司监事、宝山钢铁股份有限公司监事、武汉钢铁有限公司监事。曾任武汉钢铁（集团）公司财务部机关费用科一科副科长、会计处主任科员，武汉钢铁（集团）公司公会财务部部长，武汉钢铁（集团）公司实业公司审计处处长、财务处处长，武汉钢铁（集团）公司计划财务部会计处处长，武汉钢铁股份公司计划财务部部长，武汉钢铁股份公司副总会计师兼计划财务部部长，武汉钢铁股份公司总会计师。 |
| 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财务负责人，兼任武汉股权托管交易中心监事长；曾任湖北证券有限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、执行副总裁、财务负责人、合规负责人、首席风险官。   |

|                          |    |   |   |
|--------------------------|----|---|---|
| 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。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监、零售服务部总监。                             |
| 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。                |
| <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   |
| 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。  |
| 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。 |

|                   |      |   |  |
|-------------------|------|---|--|
| 安昀                | 副总经理 | 男 | 经济学硕士，复旦大学数量经济学研究生毕业，具有基金从业资格。曾任职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，2008年11月加入长信基金管理有限责任公司，历任策略研究员、基金经理助理、研究发展部副总监、研究发展部总监和基金经理。2015年5月6日至2016年9月6日在敦和资产管理有限公司股票投资部担任基金经理。2016年9月8日重新加入长信基金管理有限责任公司，曾任总经理助理、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任公司副总经理、投资决策委员会执行委员和国际业务部总监、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 注：上述人员之间均不存在近亲属关系 |      |   |  |

#### 4、基金经理

| 本基金基金经理情况         |              |                         |   |
|-------------------|--------------|-------------------------|---|
| 姓名                | 职务           | 任职时间                    | 简历  |
| 陆莹                | 现金理财部总监、基金经理 | 自2017年9月8日起至今           | 管理学学士，毕业于上海交通大学，2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信纯债半年债券型证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、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、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |
| 杜国昊               | 基金经理         | 自2019年11月29日起至今         | 上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），2014年6月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金会计、债券交易员和基金经理助理，现任长信长金货币市场基金的基金经理。  |
| 张文琍               | 基金经理         | 自2017年11月4日起至2019年9月23日 | 曾任本基金的基金经理。   |
| 注：上述人员之间均不存在近亲属关系 |              |                         |   |

#### 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 |

|                          |   |
|--------------------------|---|
| 安昀                       | 副总经理、投资决策委员会执行委员和国际业务部总监、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选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                       | 投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理   |
| 李家春                      | 公司总经理助理、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和长信利富债券型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和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理  |
| 易利红                      | 股票交易部总监   |
| 张文琍                      | 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、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信稳势纯债债券型证券投资基金的基金经理  |
| 陆莹                       | 现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、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、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理  |
| 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、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理  |
| 左金保                      | 量化投资部兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员、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、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理 |
| 涂世涛                      | 量化专户投资部副总监兼投资经理   |
| 李欣                       | 债券交易部副总监  |
| 陈言午                      | 专户投资部副总监兼投资经理   |
| 卢靖                       | 战略与产品研发部总监  |
| 宋海岸                      | 长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理  |
| 冯彬                       | 固收多策略部总监、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金和长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理   |
| 崔飞燕                      | 固收专户投资部副总监兼投资经理   |
| <b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b> |   |

## 二、基金托管人

## 一、基金托管人基本情况

### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：彭纯

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2017 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 11 位，较上年上升 2 位；根据 2017 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 171 位。

截至 2018 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 93915.37 亿元。2018 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 573.04 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

### （二）主要人员情况

彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生 2018 年 2 月起任本行董事长、执行董事。2013 年 11 月起任本行执行董事。2013 年 11 月至 2018 年 2 月任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月至 2018 年 1 月任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生 2018 年 8 月起任本行副董事长、执行董事、行长。2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2018 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 384 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管

理基金、企业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，保证托管中心业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对各项业务风险的管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》等法律法规，托管

中心制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工合理，技术系统规范管理，业务管理制度化，核心作业区实行封闭管理，有关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前指导、事中风控和事后检查措施实现全流程、全链条的风险控制管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，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、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额销售机构

|  |                          |
|--|--------------------------|
| <b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>                 |                          |
| 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   |
| <b>2、场外代销机构</b>                            |                          |
| (1) 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         |
| (2) 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        |
| (3) 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：辛国政                  |
| 电话：010-83574507                            | 传真：010-83574807          |
| 客户服务电话：4008-888-888 或 95551                | 网址：www.chinastock.com.cn |
| (4) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司                         |                          |
| 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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：祖国明                                  | 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        |
| (5) 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：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦                 |                          |
| 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  |
| (6) 珠海盈米基金销售有限公司                           |                        |
| 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：邱湘湘                |
| 电话：020-89629099                            | 传真：020-89629011        |
| 客户服务电话：020-89629066                        | 网站：www.yingmi.cn       |
| (7) 嘉实财富管理有限公司                             |                        |
| 注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元  |                        |
| 办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层                  |                        |
| 法定代表人：赵学军                                  | 联系人：王宫                 |
| 电话：021-38789658                            | 传真：021-68880023        |
| 客户服务电话：400-600-8800                        | 网站：www.jsfund.cn       |
| (8) 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：侯芳芳                |
| 电话：010-61840688                            | 传真：010-61840699        |
| 客户服务电话：400-1599-288                        | 网站：www.danjuanapp.com  |
| (9) 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 |

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，并在基金管理人网站公示。

## (二) 其他相关机构

| 信息类型 | 登记机构                   | 律师事务所                      | 会计师事务所                 |
|------|------------------------|----------------------------|------------------------|
| 名称   | 长信基金管理有限责任公司           | 上海源泰律师事务所                  | 德勤华永会计师事务所<br>(特殊普通合伙) |
| 注册地址 | 中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号9楼 | 上海市浦东南路256号<br>华夏银行大厦1405室 | 上海市黄浦区延安东路<br>222号30楼  |

|       |                        |                            |                       |
|-------|------------------------|----------------------------|-----------------------|
| 办公地址  | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼 | 上海市浦东南路256号<br>华夏银行大厦1405室 | 上海市黄浦区延安东路<br>222号30楼 |
| 法定代表人 | 成善栋                    | 廖海（负责人）                    | 曾顺福                   |
| 联系电话  | 021-61009999           | 021-51150298               | 021-61418888          |
| 传真    | 021-61009800           | 021-51150398               | 021-61411909          |
| 联系人   | 孙红辉                    | 刘佳、姜亚萍                     | 曾浩（曾浩、吴凌志为经办注册会计师）    |

#### 四、基金的名称

长信长金货币市场基金

#### 五、基金的类型

契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金将遵循安全性和流动性优先原则，通过对宏观经济、政策环境、市场状况和资金供求的深入分析，在严格控制风险的前提下，主动构建及调整投资组合，追求适度收益。

#### 七、基金的投资范围

本基金的投资对象主要包括：

- 1、现金；
- 2、期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；
- 3、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；
- 4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

## 八、基金的投资策略

本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。

### 1、利率策略

本基金将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况，建立经济前景的情景模拟，进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的场景模拟。

在宏观分析与流动性分析的基础上，结合历史与经验数据，确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素，得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线参数变动的程度和概率，确定组合的平均剩余期限，并据此动态调整投资组合。

### 2、骑乘策略

当市场利率期限结构向上倾斜并且相对较陡时，投资并持有债券一段时间，随着时间推移，债券剩余年限减少，市场同样年限的债券收益率较低，这时将债券按市场价格出售，投资人除了获得债券利息以外，还可以获得资本利得。在多数情况下，这样的骑乘操作策略可以获得比持有到期更高的收益。

### 3、回购策略

在有效控制风险的前提下，本基金将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为基金资产增加收益。同时，密切关注央行公开市场操作、季节因素、日历效应、IPO 发行等因素导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。

### 4、信用债投资策略

(1) 信用风险控制。本基金拟投资的每支信用债券必需经过基金管理人债券信用评级系统进行内部评级，符合基金所对应的内部评级规定的方可进行投资，以事前防范和控制信用风险。

(2) 信用利差策略。信用产品相对国债、政策性金融债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源。首先，伴随经济周期的波动，在经济周期上行或下行阶段，信用利差通常会缩小或扩大，利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。同时，研究不同行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定不同行业总体信用风险和利差水平的变动情况，投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业。其次，信用产品发行人资信水平和评级调整的变化会使产品的信用利差扩大或缩小，本基金将充分发挥内部评级在定价方面的作用，选择评级有上调可能的信用债，以获取因利差下降带来的价差收益。第三，对信用利差期限结构进行研究，分析各期限信用债利差水平相对历史平均水平所处的位置，以及不同期限之间利差的相对水平，发现更具投资价值的期限进行投资；第四，研究分析相同期限但不同信用评级债券的相对利差水平，发现偏离均值较多、相对利差有收窄可能的债券。

(3) 类属选择策略。国内信用产品目前正经历着快速发展阶段，不同审批机构批准发行的信用产品在定价、产品价格特性、信用风险方面具有一定差别，本基金将考虑产品定价的合理性、产品主要投资人的需求特征、不同类属产品的持有收益和价差收益特点和实际信用风险状况，进行信用债券的类属选择。

#### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 6、其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向，一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资，本基金将在届时相应法律法规的框架内，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）。

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

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业绩基准时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，依据维护投资人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，调整或变更本基金的业绩比较基准并及时在指定媒介上公告，而无需召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

## 十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3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12月31日（摘自本基金2018年四季报），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  | 固定收益投资            | 2,737,919,638.77 | 57.66        |
|    | 其中：债券             | 2,737,919,638.77 | 57.66        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 1,178,854,008.28 | 24.83        |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 804,474,180.29   | 16.94        |
| 4  | 其他资产              | 26,804,557.49    | 0.56         |
| 5  | 合计                | 4,748,052,384.83 | 100.00       |

## (二) 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目           | 金额（元）          | 占基金资产净值的比例（%） |
|----|--------------|----------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 |                | 2.64          |
|    | 其中：买断式回购融资   |                | -             |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 134,965,557.55 | 2.93          |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -             |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## (三) 基金投资组合平均剩余期限

### 1、投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 85 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 89 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 62 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

### 2、报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 28.71              | 2.93               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00               | -                  |
| 2  | 30 天(含)-60 天           | 12.10              | 0.00               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00               | -                  |
| 3  | 60 天(含)-90 天           | 21.84              | 0.00               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00               | -                  |
| 4  | 90 天(含)-120 天          | 9.25               | 0.00               |

|   |                         |        |      |
|---|-------------------------|--------|------|
|   | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00   | -    |
| 5 | 120 天(含)-397 天(含)       | 30.53  | 0.00 |
|   | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.00   | -    |
|   | 合计                      | 102.43 | 2.93 |

#### (四) 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注: 报告期内投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

#### (五) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | -                | -            |
| 2  | 央行票据                 | -                | -            |
| 3  | 金融债券                 | 550,699,639.00   | 11.95        |
|    | 其中: 政策性金融债           | 550,699,639.00   | 11.95        |
| 4  | 企业债券                 | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 100,002,966.24   | 2.17         |
| 6  | 中期票据                 | -                | -            |
| 7  | 同业存单                 | 2,087,217,033.53 | 45.28        |
| 8  | 其他                   | -                | -            |
| 9  | 合计                   | 2,737,919,638.77 | 59.40        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                | -            |

#### (六) 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量(张)   | 摊余成本(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 111821304 | 18 渤海银行 CD304 | 3,000,000 | 298,011,305.49 | 6.47         |
| 2  | 160208    | 16 国开 08      | 1,500,000 | 149,954,829.21 | 3.25         |
| 3  | 180201    | 18 国开 01      | 1,300,000 | 130,026,090.77 | 2.82         |
| 4  | 180407    | 18 农发 07      | 1,000,000 | 100,337,277.90 | 2.18         |
| 5  | 180209    | 18 国开 09      | 1,000,000 | 100,248,864.96 | 2.17         |
| 6  | 071800049 | 18 渤海证券 CP011 | 1,000,000 | 100,002,966.24 | 2.17         |
| 7  | 111883269 | 18 徽商银行 CD113 | 1,000,000 | 99,516,394.21  | 2.16         |
| 8  | 111820227 | 18 广发银行 CD227 | 1,000,000 | 99,494,759.72  | 2.16         |
| 9  | 111803141 | 18 农业银行 CD141 | 1,000,000 | 99,473,650.53  | 2.16         |
| 10 | 111884102 | 18 徽商银行 CD119 | 1,000,000 | 99,450,126.48  | 2.16         |

**(七) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离**

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0579%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0254% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0318%  |

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

注：报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

注：报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

**(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十名资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**(九) 投资组合报告附注**

**1、本基金采用摊余成本法计价。**

**2、报告期内本基金投资的前十名证券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。**

**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 | -             |
| 3  | 应收利息    | 26,804,557.49 |
| 4  | 应收申购款   | -             |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 26,804,557.49 |

**4、投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：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。

**(一) 2018 年四季度及各历史期间基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

长信长金货币 A

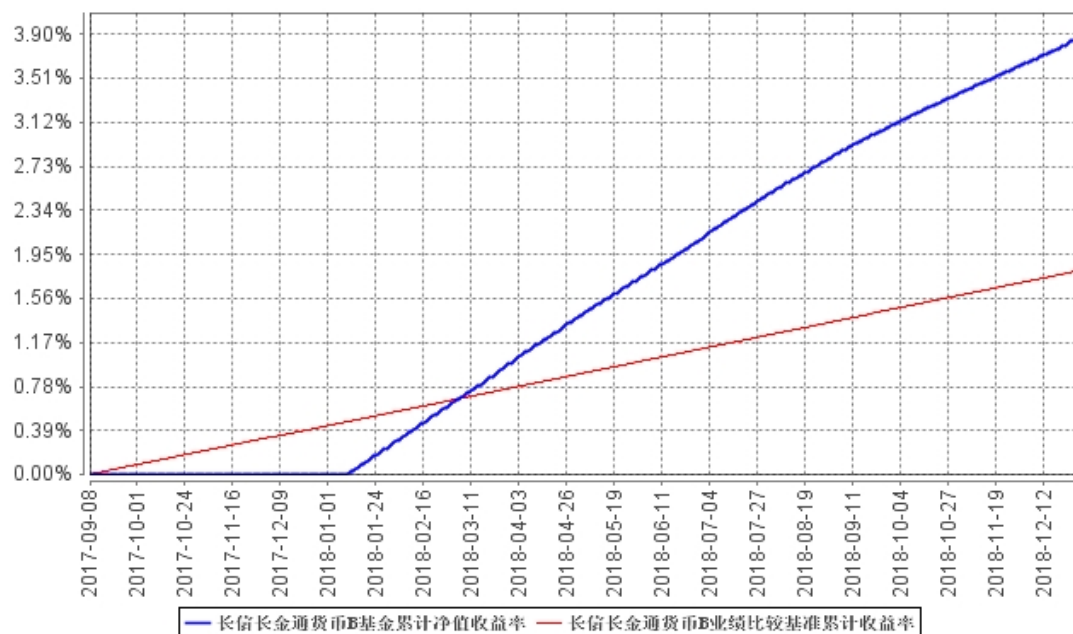
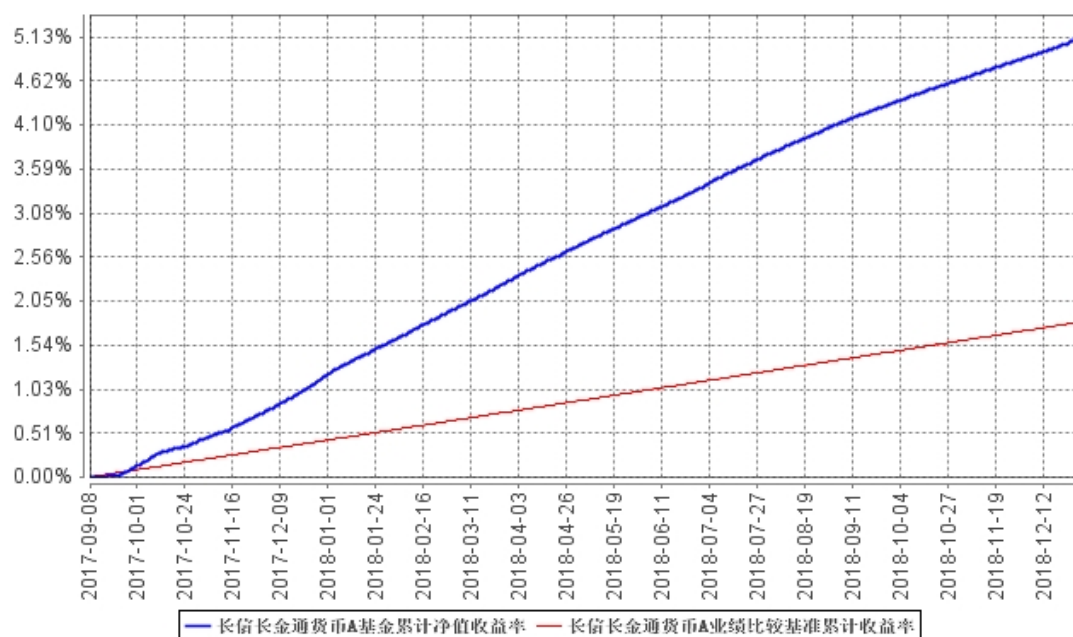
| 阶段                                      | 净值收益率<br>① | 净值收益率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④     |
|---|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 2017 年 9 月<br>8 日至 2017<br>年 12 月 31 日  | 1.1865%    | 0.0046%       | 0.4322%        | 0.0000%               | 0.7543% | 0.0046% |
| 2018 年 1 月<br>1 日至 2018<br>年 6 月 30 日   | 2.1648%    | 0.0011%       | 0.6810%        | 0.0000%               | 1.4838% | 0.0011% |
| 2018 年 7 月<br>1 日至 2018<br>年 9 月 30 日   | 0.9482%    | 0.0014%       | 0.3456%        | 0.0000%               | 0.6026% | 0.0014% |
| 2018 年 10 月<br>1 日至 2018<br>年 12 月 31 日 | 0.7433%    | 0.0009%       | 0.3456%        | 0.0000%               | 0.3977% | 0.0009% |

长信长金货币 B

| 阶段                                      | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④     |
|---|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 该类份额产<br>生份额至<br>2018 年 6 月<br>30 日     | 2.0918%      | 0.0029%             | 0.6810%        | 0.0000%               | 1.4108% | 0.0029% |
| 2018 年 7 月<br>1 日至 2018<br>年 9 月 30 日   | 0.9838%      | 0.0014%             | 0.3456%        | 0.0000%               | 0.6382% | 0.0014% |
| 2018 年 10 月<br>1 日至 2018<br>年 12 月 31 日 | 0.7791%      | 0.0009%             | 0.3456%        | 0.0000%               | 0.4335% | 0.0009% |

注：本基金收益分配按日结转份额。

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



注：1、图示日期为2017年9月8日至2018年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；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、费用概况

### （一）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、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，但法律法规、中国证监会另有规定的除外；
- 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、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、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。

### （二）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 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在月初 5 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，支付日期相应顺延。

#### 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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在月初 5 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，支付日期相应顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.15%，本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{该类基金份额年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式在月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支付到指定账户。基金销售服务费由登记机构代收，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，支付日期相应顺延。

上述“（一）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，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

### （三）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。

### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执

行。

#### （五）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议。调高基金销售服务费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

#### （六）申赎费率

1、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用，但为确保基金平稳运行，避免诱发系统性风险，本基金可对以下情形征收强制赎回费用：

（1）在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负时；

（2）本基金前 10 名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额 50%的，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 10%且偏离度为负时。

出现上述任一情形时，本基金应当对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的 1%以上的赎回申请征收 1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金资产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

2、基金管理人可以在不违反法律法规及基金合同约定的范围内调整收费方式，并最迟应于新的收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 3、转换费用

本公司已开通了长信长金货币基金与长信稳势纯债债券基金、长信量化价值精选混合基金、长信量化先锋混合基金 C 类份额（C 类代码：004221）、长信稳健纯债债券基金、长信稳益纯债债券基金、长信量化价值驱动混合基金、长信

纯债壹号债券基金 C 类份额（C 类代码：004220）、长信乐信混合基金（直销渠道）、长信利丰债券基金 E 类份额（E 类代码：004651）、长信消费精选股票基金（直销渠道）、长信量化多策略股票基金 C 类份额（C 类代码：004858）、长信国防军工量化混合基金、长信双利优选混合基金 E 类份额（E 类代码：006396）、长信内需成长混合基金 E 类份额（E 类代码：006397）之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

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

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

2、转换份额的计算公式：

（1）货币基金转至非货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益

补差费=转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

（货币基金份额净值为1.00元，没有赎回费）

（2）非货币基金转至货币基金

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

转入确认金额=转出确认金额-赎回费

转入确认份额=转入确认金额÷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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集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》（以下简称“《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，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“二、释义”“十八、基金的信息披露”等部分，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，更新了相应的内容。

长信基金管理有限责任公司

二〇一九年十二月三十一日