

## 长信创新驱动股票型证券投资基金

### 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：中国工商银行股份有限公司

长信创新驱动股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 4 月 14 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】794 号文注册募集。本基金合同于 2016 年 9 月 29 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、期货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。

本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括但不限于国债、金融债、地方政府债、央行票据、中期票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、短期融资券、超短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、债券回购、货币市场工具、资

产支持证券、衍生工具（权证、股指期货、国债期货、股票期权等）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 29 日（其中基金经理相关信息更新截止日为 2019 年 12 月 30 日），有关财务数据和净值截止日为 2018 年 12 月 31 日（财务数据已经审计）。本基金托管人中国工商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	<b>股东名称</b>	<b>出资额</b>	<b>出资比例</b>
	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，正高级高级会计师。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。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>		

#### 4、基金经理

本基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
沈佳	基金经理	自 2019 年 12 月 12 日起至 今	复旦大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于国家开发银行上海市分行，2014 年 11 月加入长信基金管理有限责任公司，历任行业研究员、基金经理助理，现任长信创新驱动股票型证券投资基金的基金经理。
祝昱丰	基金经理	自 2017 年 10 月 20 日起至 2019 年 12 月 30 日	曾任本基金的基金经理。
黄韵	基金经理	自 2017 年 3 月 15 日起至 2019 年 8 月 8 日	曾任本基金的基金经理。
叶松	基金经理	自基金合同生效之日起至 2018 年 2 月 6 日	曾任本基金的基金经理。
<b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b>			

#### 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和长信全球债券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、长信利富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

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、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金和长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## （二）主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 64 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管

管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室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）合法性原则。内控制度应当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）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规

章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，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，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数

据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，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。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，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，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，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。

#### (五) 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》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与

银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金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，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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

<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) 中国工商银行股份有限公司	
注册地址：中国北京复兴门内大街55号	
办公地址：中国北京复兴门内大街55号	
法定代表人：易会满	联系人：李鸿岩
电话：010-66105662	
客户服务电话：95588	网址：www.icbc.com.cn
(2) 交通银行股份有限公司	
注册地址：上海市银城中路188号	
办公地址：上海市银城中路188号	
法定代表人：彭纯	联系人：王菁

电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
(3) 招商银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
法定代表人：李建红	联系人：季平伟
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
(4) 上海浦东发展银行股份有限公司	
注册地址：上海市中山东一路 12 号	
办公地址：上海市中山东一路 12 号	
法定代表人：吉晓辉	联系人：唐苑
电话：021-61618888	传真：021-63604199
客户服务电话：95528	网址：www.spdb.com.cn
(5) 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：洪崎	联系人：徐野
电话：010-58560666	传真：010-58560666
客户服务电话：95568	网址：www.cmbc.com.cn
(6) 平安银行股份有限公司	
注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦	
法定代表人：孙建一	联系人：张莉
电话：0755-22166118	传真：0755-25841098
客户服务电话：95511-3	网址：bank.pingan.com
(7) 江苏银行股份有限公司	
注册地址：南京市中华路 26 号	
办公地址：南京市中华路 26 号	
法定代表人：夏平	联系人：张洪玮
电话：025-58587036	传真：025-58587820
客户服务电话：95319	网址：www.jsbchina.cn
(8) 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
(9) 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
(10) 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
(11) 光大证券股份有限公司	
注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号	
法定代表人：周健男	联系人：龚俊涛
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
(12) 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：95547	网址：www.hfzq.com.cn
(13) 国都证券股份有限公司	
注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	
办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	
法定代表人：王少华	联系人：李弢
电话：010-84183389	传真：010-84183311-3389
客户服务电话：400-818-8118	网址：www.guodu.com
(14) 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：杜晶、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
(15) 国盛证券有限责任公司	
注册地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）	
办公地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦）	
法定代表人：马跃进	联系人：俞驰
电话：0791-86283080	传真：0791-86288690
客户服务电话：4008-222-111	网址：www.gsstock.com
(16) 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
(17) 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
(18) 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 19 楼	
法定代表人：陈牧原	联系人：范坤
电话：0931-4890208	传真：0931-4890628
客户服务电话：95368、4006898888	网址：www.hlzq.com
(19) 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
(20) 平安证券股份有限公司	
注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
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：何之江	联系人：王阳

电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511—8	网址：www.stock.pingan.com
(21) 中泰证券股份有限公司	
注册地址：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：秦雨晴
电话：021-20315197	传真：021-20315125
客户服务电话：95538	网址：www.zts.com.cn
(22) 上海证券有限责任公司	
注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼	
办公地址：上海市西藏中路 336 号	
法定代表人：李俊杰	联系人：许曼华
电话：021-53686888	传真：021-53686100-7008、 021-53686200-7008
客户服务电话：4008918918	网址：www.shzq.com
(23) 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
(24) 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：中国湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 48 层	
法定代表人：余磊	联系人：程晓英
电话：18064091773	传真：027-87618863
客服电话：95391 或 400-800-5000	网址：www.tfzq.com
(25) 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：谭磊
电话：010-66045182	传真：010-66045518
客户服务电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
(26) 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
(27) 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
(28) 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
(29) 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
(30) 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
(31) 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 1 号楼 2001	
办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层	
法定代表人：姜晓林	联系人：焦刚
电话：0531-89606166	传真：0532-85022605
客户服务电话：95548	网址：http://sd.citics.com/
(32) 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
(33) 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
(34) 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：廖庆轩	联系人：周青
电话：023-63786633	传真：023-67616310
客服热线：95355、4008096096	网址：www.swsc.com.cn
(35) 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
(36) 上海长量基金销售有限公司	
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
(37) 诺亚正行基金销售有限公司	
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室	
办公地址：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼	
法定代表人：汪静波	联系人：李娟
电话：021-38602377	传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com
(38) 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：徐超逸
电话：021-20613988	传真：021-68596916
客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com
(39) 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 1002 室	
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：陈慧慧
电话：010-85657353	传真：010-65884788
客户服务电话：400-920-0022	网址：www.licaike.hexun.com
(40) 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
(41) 上海汇付基金销售有限公司	
注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元	
办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋	
法定代表人：金佶	联系人：甄宝林
电话：021-34013996-3011	传真：
客户服务电话：021-34013999	网址：www.hotjijin.com
(42) 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
(43) 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：袁顾明	联系人：朱真卿
电话：021-22267943	传真：021-22268089
客户服务电话：400-928-2266	网址：www.dtfunds.com
(44) 上海联泰基金销售有限公司	
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
(45) 海银基金销售有限公司	
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室	
办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼	
法定代表人：惠晓川	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
(46) 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
(47) 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/
(48) 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
(49) 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E世界财富中心A座11层1108号	
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层	
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.hcjijin.com
(50) 财通证券股份有限公司	
注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716	
办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716	

法定代表人：陆建强	联系人：陶志华
电话：0571-87789160	传真：0571-87818329
客户服务电话：95336, 40086-96336	网站：www.ctsec.com
(51) 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
(52) 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
(53) 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
(54) 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
(55) 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
(56) 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
(57) 开源证券股份有限公司	
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层	
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层	
法定代表人：李刚	联系人：袁伟涛
电话：029-88447611	传真：029-88447611
客户服务电话：95325 或 400-860-8866	网站：www.kysec.cn
<b>3、场内销售机构</b>	
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： <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a>	

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	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

长信创新驱动股票型证券投资基金

## 五、基金的类型

契约型开放式

## 六、基金的投资目标

深入研究中国经济在转变增长方式过程中的运行特征，寻找推动经济持续健康稳定发展的创新驱动动力，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。

## 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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括但不限于国债、金融债、地方政府债、央行票据、中期票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、短期融资券、超短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、衍生工具（权证、股指期货、国债期货、股票期权等）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比例为 80%–95%，其中投资于创新驱动主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。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、国债期货及股票期权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。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进

行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。

## 2、股票投资策略

### (1) 创新驱动主题界定

在全球经济放缓、各国制造业竞争力发生较大变化的情形下，创新已经成为中国转变经济增长方式的重要驱动力，也将会是未来中国经济发展的重要着力点。当前 A 股“创新驱动”主题相关领域面临以下三个维度的主要机遇：

1) 从发达国家的发展经历来看，政府的引导对于新兴产业的发展有着基础性的作用。政府的作用一般分为两个层次，基础前沿技术的投入和新兴产业的政策引导。因此，政府大力推动的行业包括新能源、新能源车、生物技术、信息技术、新材料、电子技术、高端装备等行业前景十分广阔。

2) 在政府引导的同时，技术的成熟以及适当的制度引导使得民间爆发出的无限创业热情。传统行业中新技术的应用带来的效率提升，互联网+造就的各种新模式的诞生使得经济发展更具活力。这些传统行业融合新技术新模式的领域也是我们非常看好的，包括在互联网金融、在线医疗、在线教育、智能制造、车联网、以及各行业的 O2O 等。

3) 良好的制度保障是创新过程能够成功的基础，这里面涉及研发、产业转化、产权交易、退出、分配等各种环节。具体包括科研院所改革、高新区建设、产权交易市场建设完善、金融支持创新等等。这些领域也会纳入我们的主题范畴。

本基金希望把握由此带来的投资契机，通过打造一个定位明确、特点鲜明的以制造业创新、互联网+等为代表的“创新驱动”主题基金，使投资者最大程度享受主题投资带来的机会。

### (2) 精选个股策略

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，精选创新驱动主题相关证券。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

本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。

### (1) 久期配置策略

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对 GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究,分析宏观经济运行的可能情景,并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向,对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断,结合债券市场资金供求结构及变化趋势,确定固定收益类资产的久期配置。

### (2) 类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金通过情景分析和历史预测相结合的方法,“自上而下”在债券一级市场和二级市场,银行间市场和交易所市场,银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置,进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

### (3) 个券选择策略

对于国债、央行票据等非信用类债券，本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种；对于信用类债券，本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。

#### （4）可转债投资策略

可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。

#### （5）中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

### 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。本基金将通过对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。

### (4) 国债期货的投资策略

本基金通过对基本面和资金面的分析,对国债市场走势做出判断,以作为确定国债期货的头寸方向和额度的依据。当中长期经济高速增长,通货膨胀压力浮现,央行政策趋于紧缩时,本基金建立国债期货空单进行套期保值,以规避利率风险,减少利率上升带来的亏损;反之,在经济增长趋于回落,通货膨胀率下降,甚至通货紧缩出现时,本基金通过建立国债期货多单,以获取更高的收益。

### (5) 股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股指期权定价模型,选择估值合理的期权合约。

基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以

防范期权投资的风险。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*80%+中证综合债券指数收益率\*20%

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者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

本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

## 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 12 月 31 日（摘自本基金 2018 年年度报告），本报告中所列财务数据经审计。

### （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	25,192,890.93	81.85
	其中：股票	25,192,890.93	81.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,808,904.00	5.88

	其中：债券	1,808,904.00	5.88
	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	2,863,084.89	9.30
8	其他资产	914,204.67	2.97
9	合计	30,779,084.49	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	504,700.00	1.67
C	制造业	12,188,320.93	40.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,150,900.00	3.80
F	批发和零售业	4,927,040.00	16.28
G	交通运输、仓储和邮政业	954,300.00	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,520,400.00	5.02
J	金融业	2,241,330.00	7.40
K	房地产业	867,500.00	2.87
L	租赁和商务服务业	314,400.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	524,000.00	1.73
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	25,192,890.93	83.22

## 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603808	歌力思	138,018	2,241,412.32	7.40
2	002024	苏宁易购	224,400	2,210,340.00	7.30
3	601689	拓普集团	120,000	1,773,600.00	5.86
4	601877	正泰电器	70,100	1,699,224.00	5.61
5	601933	永辉超市	200,000	1,574,000.00	5.20
6	300383	光环新网	120,000	1,520,400.00	5.02
7	000651	格力电器	38,000	1,356,220.00	4.48
8	600519	贵州茅台	2,133	1,258,491.33	4.16
9	600491	龙元建设	170,000	1,150,900.00	3.80
10	601021	春秋航空	30,000	954,300.00	3.15
11	300078	思创医惠	94,000	934,360.00	3.09
12	001979	招商蛇口	50,000	867,500.00	2.87
13	600660	福耀玻璃	36,000	820,080.00	2.71
14	600104	上汽集团	25,000	666,750.00	2.20
15	601939	建设银行	100,000	637,000.00	2.10
16	603708	家家悦	30,000	602,700.00	1.99
17	600837	海通证券	65,000	572,000.00	1.89
18	002640	跨境通	50,000	540,000.00	1.78
19	600030	中信证券	33,000	528,330.00	1.75
20	300012	华测检测	80,000	524,000.00	1.73
21	603589	口子窖	14,904	522,683.28	1.73
22	601857	中国石油	70,000	504,700.00	1.67
23	600036	招商银行	20,000	504,000.00	1.66
24	600276	恒瑞医药	6,000	316,500.00	1.05
25	002027	分众传媒	60,000	314,400.00	1.04
26	002372	伟星新材	20,000	310,200.00	1.02
27	300373	扬杰科技	20,000	288,800.00	0.95

### (四) 报告期内股票投资组合的重大变动

**1、累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603808	歌力思	5,943,373.00	17.53
2	002024	苏宁易购	5,748,306.00	16.95
3	603877	太平鸟	5,366,592.85	15.83
4	601689	拓普集团	5,284,111.00	15.58
5	600029	南方航空	4,833,000.00	14.25
6	601939	建设银行	3,798,488.00	11.20
7	002640	跨境通	3,612,471.30	10.65
8	002310	东方园林	3,596,169.00	10.61
9	601877	正泰电器	3,464,966.70	10.22
10	000651	格力电器	3,345,150.00	9.87
11	300383	光环新网	3,182,338.52	9.39
12	001979	招商蛇口	3,012,170.87	8.88
13	600887	伊利股份	2,665,412.00	7.86
14	600519	贵州茅台	2,484,868.00	7.33
15	601288	农业银行	2,456,208.00	7.24
16	603228	景旺电子	2,241,946.00	6.61
17	600048	保利地产	2,097,182.00	6.19
18	002706	良信电器	2,001,036.00	5.90
19	603365	水星家纺	1,927,375.46	5.68
20	600491	龙元建设	1,912,833.00	5.64
21	600660	福耀玻璃	1,778,329.00	5.24
22	300685	艾德生物	1,742,643.00	5.14
23	600276	恒瑞医药	1,488,269.00	4.39
24	601933	永辉超市	1,443,100.00	4.26
25	603708	家家悦	1,392,263.00	4.11
26	300373	扬杰科技	1,278,911.00	3.77
27	600115	东方航空	1,239,805.00	3.66
28	600030	中信证券	1,143,311.00	3.37
29	600104	上汽集团	1,141,177.00	3.37
30	600036	招商银行	1,033,335.00	3.05
31	601021	春秋航空	1,007,515.00	2.97

32	600837	海通证券	984,536.00	2.90
33	300078	思创医惠	843,888.93	2.49
34	601857	中国石油	758,481.00	2.24
35	600867	通化东宝	731,212.80	2.16
36	300170	汉得信息	728,285.00	2.15
37	002831	裕同科技	720,260.00	2.12
38	600584	长电科技	715,380.00	2.11

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

## 2、累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603808	歌力思	6,385,928.96	18.83
2	002024	苏宁易购	5,562,065.00	16.40
3	603877	太平鸟	5,334,722.20	15.73
4	600029	南方航空	4,850,522.00	14.31
5	002310	东方园林	4,504,073.00	13.28
6	002640	跨境通	4,262,825.08	12.57
7	600887	伊利股份	3,323,562.00	9.80
8	603228	景旺电子	2,959,950.40	8.73
9	601689	拓普集团	2,943,854.00	8.68
10	601939	建设银行	2,819,716.00	8.32
11	600845	宝信软件	2,634,040.07	7.77
12	600519	贵州茅台	2,443,169.00	7.21
13	601288	农业银行	2,409,175.00	7.11
14	300383	光环新网	2,286,434.00	6.74
15	000651	格力电器	2,209,722.00	6.52
16	001979	招商蛇口	2,017,521.40	5.95
17	002706	良信电器	1,965,862.36	5.80
18	300685	艾德生物	1,963,912.00	5.79
19	603365	水星家纺	1,937,910.28	5.72
20	002831	裕同科技	1,857,917.00	5.48
21	601877	正泰电器	1,690,222.00	4.98
22	600048	保利地产	1,664,816.00	4.91
23	300373	扬杰科技	1,504,636.76	4.44
24	603708	家家悦	1,495,933.70	4.41

25	002304	洋河股份	1,457,850.00	4.30
26	603900	莱绅通灵	1,373,003.80	4.05
27	002027	分众传媒	1,245,410.00	3.67
28	600115	东方航空	1,217,372.00	3.59
29	300271	华宇软件	1,214,664.00	3.58
30	600398	海澜之家	1,146,805.00	3.38
31	002343	慈文传媒	1,144,297.00	3.37
32	600276	恒瑞医药	1,060,307.00	3.13
33	002091	江苏国泰	1,048,640.10	3.09
34	603027	千禾味业	1,032,692.00	3.05
35	002241	歌尔股份	1,009,000.00	2.98
36	600016	民生银行	997,200.00	2.94
37	600660	福耀玻璃	768,759.00	2.27
38	002796	世嘉科技	724,363.00	2.14
39	600261	阳光照明	711,100.00	2.10
40	300170	汉得信息	680,229.00	2.01

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

### 3、买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	94,933,531.27
卖出股票收入（成交）总额	93,663,553.01

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

#### （五）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,808,904.00	5.98
	其中：政策性金融债	1,808,904.00	5.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,808,904.00	5.98

**(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	018002	国开1302	18,080	1,808,904.00	5.98

**(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**(八) 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。

**(九) 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。

**(十) 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。

**(十一) 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。

## (十二) 投资组合报告附注

### 1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

### 2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	6,466.63
2	应收证券清算款	800,179.90
3	应收股利	-
4	应收利息	105,628.96
5	应收申购款	1,929.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	914,204.67

### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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。

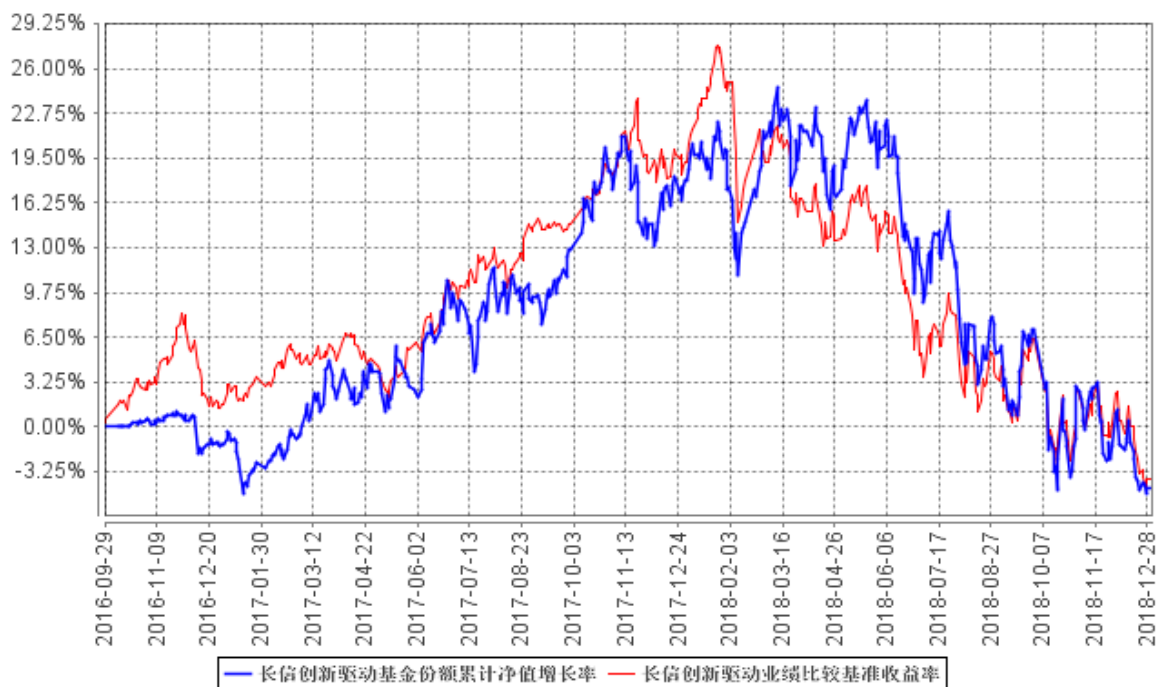
## 十二、基金的业绩

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。

### (一) 基金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：

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
2016年9月29日-2016年12月31日	-1.20%	0.38%	1.70%	0.57%	-2.90%	-0.19%
2017年	19.33%	0.85%	17.23%	0.51%	2.10%	0.34%
2018年	-18.91%	1.32%	-19.28%	1.07%	0.37%	0.25%

(二) 自合同生效之日（2016年9月29日）至2018年12月31日期间，本基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比：



注：1、图示日期为2016年9月29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。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、《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；
- 4、《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；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、证券/期货账户开户费用、银行账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### (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 1.5%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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款指令，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 0.25%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

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

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款指令，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。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—9 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。

### （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，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。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。基金管理人必须最迟于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

### （六）申赎费率

- 1、申购费用

### (1) 场外申购费用

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。具体费率如下：

申购金额 (M, 含申购费)	前端申购费率
$M < 100$ 万	1.5%
$100 \text{ 万} \leq M < 500$ 万	1.0%
$M \geq 500$ 万	每笔 1000 元

注：M 为申购金额

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

### (2) 场内申购费用

投资者在场内申购本基金时缴纳申购费用。本基金的场内申购费率与上述规定的场外申购费率一致。

## 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，场内、场外赎回具体费率如下：

持有时间 (Y)	赎回费率
$Y < 7$ 天	1.5%
$7 \text{ 天} \leq Y < 30$ 天	0.75%
$30 \text{ 天} \leq Y < 1$ 年	0.5%
$1 \text{ 年} \leq Y < 2$ 年	0.25%
$Y \geq 2$ 年	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、基金转换费用

本公司已开通了长信创新驱动股票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）（非直销渠道）、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）、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、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、长信双利混合基金 A 类份额（A 类代码：519991）、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 A 类份额（A 类代码：519979）、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）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金、长信利保债券基金、长信利泰混合基金、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（非直销渠道）、长信低碳环保量化股票基金、长信消费精选股票基金（非直销渠道）和长信价值优选混合基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

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

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

（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

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

（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》、《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“三、基金管理人”部分，更新了基金经理相关信息。

长信基金管理有限责任公司

二〇二〇年一月三日