

# 长信增利动态策略混合型证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

### 2015 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

长信增利动态策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2006 年 8 月 28 日中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]180 号文核准募集。本基金基金合同于 2006 年 11 月 9 日正式生效。本基金为混合型契约开放式基金。

#### 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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

2015年8月7日起本基金更名为长信增利动态策略混合型证券投资基金,关于基金更名的事宜,我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年11月9日,有关财务数据和净值表现截止至2015年9月30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	壹亿伍仟万元人民币		
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	叶焯		
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	49%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5万元	34.33%
	武汉钢铁股份有限公司	2500.5万元	16.67%
	总计	15000万元	100%

### (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
叶焯	董事长	男	中共党员,硕士研究生,现任长信基金管理有限责任公司董事长。曾任职君安证券有限公司石家庄营业部总经理、公司副总裁,国泰君安证券股份有限公司武汉分公司总经理、资产委托管理部总监,长信基金管理有限责任公司总经理,长城证券有限责

			任公司总经理，长江证券股份有限公司董事、总裁，长江证券承销保荐有限公司董事长。
杨泽柱	董事	男	中共党员，博士研究生，现任湖北省人大常务委员会委员、长江证券股份有限公司党委书记、董事长。曾任湖北省松滋县老城公社党委副书记、书记，松滋县检察院检察长，松滋县政府常务副县长、县委常委，巴东县政府县长、县委副书记，荆州地区(荆沙市)计委主任、党组副书记，荆沙市副市长，荆州市委常委、副市长、市行政学院院长，荆门市委副书记、副市长、市行政学院院长，荆门高新技术开发区党委第一书记，湖北省委台湾工作办公室、湖北省政府台湾事务办公室主任，湖北省国资委主任、党委书记，湖北省联合发展投资集团有限公司党委书记。
陈谋亮	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。现任上海海欣集团股份有限公司总裁。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。
彭辰	董事	男	中共党员，博士研究生学历，管理学博士，正高级高级会计师，研究员。现任武汉钢铁股份有限公司董事会董事、华电集团公司董事会董事。曾任武汉钢铁(集团)公司党委常委、副总经理兼总会计师，武汉钢铁股份有限公司总经理。
覃波	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。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。
胡柏枝	独立董事	男	中共党员，大专，高级会计师，注册会计师，注册税务师。曾任湖北省财政厅副厅长、党组副书记，湖北省国有资产管理局副局长、局长，中国三峡总公司财务部主任、副总会计师，三峡财务公司总经理，财政部驻湖北省专员办监察专员、党组书记、巡视员，湖北省人大财经委、预工委副主任。
黄宪	独立董事	男	中共党员，博士，博士生导师。现任武汉大学经济与管理学院金融系教授、博士生导师。曾任武汉大学教师、商学院副院长，美国新泽西西东大学访问学者，武汉大学珞珈城市信用社副董事长，中港合资武新公司财务总经理。
宋晓燕	独立董事	女	中共党员，法学博士，律师。现任上海财经大学法

			学院教授、博士生导师。曾任武汉大学管理学院国际金融系教师。
<b>注：</b> 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2015 年 11 月 17 日起，黄宪、宋晓燕不再担任独立董事，聘任吴稼祥、谢红兵担任独立董事； 3、自 2015 年 12 月 17 日起，彭辰不再担任董事，聘任邹继新担任董事。			

## 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，正高职高级会计师。现任武汉钢铁股份有限公司总会计师。曾任武钢实业公司审计处处长、武钢实业公司财务处处长、武汉钢铁（集团）公司计划财务部会计处处长、武汉钢铁股份有限公司计划财务部部长、武汉钢铁股份有限公司副总会计师兼计划财务部部长。
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。
宋小龙	副总经理	男	理学硕士，北京大学计算机软件专业研究生毕业，具有基金从业资格。2012年10月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会主任委员，兼任长信金利趋势混合型证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金和长信内需成长混合型证券投资基金的基金经理。曾任北京北大青鸟公司项目经理、富国基金管理公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理。
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）。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投资决策委员会执行委员、固定收益部总监，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和长信利富债券型证券投资基金的基金经理。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年加入长信基金管理有限责任公司，先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、总经理助理。
<b>注：</b> 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自2015年11月16日起，李小羽先生兼任长信利保债券型证券投资基金的基金经理。			

#### 4、基金经理

本基金历任基金经理情况			
姓名	职务	任职时间	简历
叶松	基金经理	2015年3月13日至今	经济学硕士，中南财经政法大学投资学专业研究生毕业。2007年7月加入长信基金管理有限责任公司，担任行业研究员，从事行业和上市公司研究工作，2010年5

			月 26 日开始兼任长信增利动态策略股票型证券投资基金的基金经理助理。现任本基金、长信恒利优势混合型证券投资基金和长信新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
胡志宝	投资总监、基金经理	2010 年 8 月 26 日至 2015 年 3 月 13 日	曾任本基金基金经理。
许万国	基金经理	2008 年 6 月 2 日至 2011 年 4 月 23 日	曾任本基金基金经理。
陆文俊	基金经理	2006 年 7 月 6 日至 2008 年 6 月 12 日	曾任本基金基金经理。
梁晓军	基金经理	2006 年 4 月 30 日至 2006 年 9 月 22 日	曾任本基金基金经理。
<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
宋小龙	副总经理、投资决策委员会主任委员、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信内需成长混合型证券投资基金和长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理
谈洁颖	投资管理部总监、投资决策委员会执行委员、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
李小羽	副总经理、固定收益部总监、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和长信利富债券型证券投资基金的基金经理
薛天	国际业务部投资总监、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的基金经理
黄建中	专户投资部（筹）投资经理、投资决策委员会执行委员
朱君荣	专户投资部（筹）副总监、投资经理
高远	研究发展部负责人
易利红	交易管理部副总监
<b>注：</b>	
1、上述人员之间均不存在近亲属关系；	
2、自 2015 年 11 月 16 日起，李小羽先生兼任长信利保债券型证券投资基金的基金经理。	

### （三）内部组织结构及员工情况

内部组织结构及员工情况
股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会。公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，总经理、副总经理和督察长组成公司的经营管理层。

公司经营管理层下设的委员会	内部控制委员会、投资决策委员会
公司内部组织结构	金融工程部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、交易管理部、基金事务部、零售服务部、机构业务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、专户理财部、国际业务部、产品开发部、电子商务部、财务管理部
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉办事处
员工总数	142人（截至2015年11月9日）

## 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：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：赵天杰

中国民生银行于1996年1月12日在北京正式成立，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。中国民生银行成立十余年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了良好的资产质量。

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。

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。

2007 年 11 月，民生银行获得 2007 第一财经金融品牌价值榜十佳中资银行称号，同时荣获《21 世纪经济报道》等机构评选的“最佳贸易融资银行奖”。

2007 年 12 月，民生银行荣获《福布斯》颁发的第三届“亚太地区最大规模上市企业 50 强”奖项。

2008 年 7 月，民生银行荣获“2008 年中国最具生命力百强企业”第三名。在《2008 中国商业银行竞争力评价报告》中民生银行核心竞争力排名第 6 位，在公司治理和流程银行两个单项评价中位列第一。

2009 年 6 月，民生银行在“2009 年中国本土银行网站竞争力评测活动”中获 2009 年中国本土银行网站“最佳服务质量奖”。

2009 年 9 月，在大连召开的第二届中国中小企业融资论坛上，中国民生银行被评为“2009 中国中小企业金融服务十佳机构”。在“第十届中国优秀财经证券网站评选”中，民生银行荣膺“最佳安全性能奖”和“2009 年度最佳银行网站”两项大奖。

2009 年 11 月 21 日，在第四届“21 世纪亚洲金融年会”上，民生银行被评为“2009 年·亚洲最佳风险管理银行”。

2009 年 12 月 9 日，在由《理财周报》主办的“2009 年第二届最受尊敬银行评选暨 2009 年第三届中国最佳银行理财产品评选”中，民生银行获得了“2009 年中国最受尊敬银行”、“最佳服务私人银行”、“2009 年最佳零售银行”多个奖项。



2010年2月3日，在“卓越2009年度金融理财排行榜”评选活动中，中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评，荣获卓越2009年度金融理财排行榜“十佳电子银行”奖。

2010年10月，在经济观察报主办的“2009年度中国最佳银行评选”中，民生银行获得评委会奖——“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓越的银行而特别设立的。

2011年12月，在由中国金融认证中心（CFCA）联合近40家成员行共同举办的2011中国电子银行年会上，民生银行荣获“2011年中国网上银行最佳网银安全奖”。这是继2009年、2010年荣获“中国网上银行最佳网银安全奖”后，民生银行第三次获此殊荣，是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的高度肯定。

2012年6月20日，在国际经济高峰论坛上，民生银行贸易金融业务以其2011-2012年度的出色业绩和产品创新最终荣获“2012年中国卓越贸易金融银行”奖项。这也是民生银行继2010年荣获英国《金融时报》“中国银行业成就奖——最佳贸易金融银行奖”之后第三次获此殊荣。

2012年11月29日，民生银行在《The Asset》杂志举办的2012年度AAA国家奖项评选中获得“中国最佳银行-新秀奖”。

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。

## 2、主要人员情况

杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

## 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 60 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。

截止到 2015 年 9 月 30 日，本行共托管基金 62 只，分别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方精选混合型开放式

证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金账簿货币市场基金、长信增利动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国投瑞银瑞源保本混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、工银瑞信睿智深证 100 指数分级证券投资基金、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、中银美丽中国股票型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定增利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、中银互利分级债券型证券投资基金、工银瑞信添福债券型证券投资基金、中银中高等级债券型证券投资基金、汇添富全额宝货币市场证券投资基金、国金通用金腾通货币市场证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、摩根士丹利华鑫纯债稳定添利 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦新动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、建信鑫安会爆灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金、国金通用上证 50 指数分级证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德荣和保本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、东方赢家保本混合型证券投资基金、中欧滚钱宝发起式货币市场基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信财富快线货币市场基金、泰康薪意宝货币市场基金、摩根士丹利华鑫新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合

型证券投资基金、建信鑫裕回报灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金。托管基金资产净值为 1429.29 亿元。

## （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，每两个月对业务的运行进行一次稽核检查。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) 基金份额发售机构

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：叶烨	联系人：王瑞英

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) 中国农业银行股份有限公司	
注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号	
法定代表人：刘士余	联系人：刘一宁
传真：010-85109219	
客户服务电话：95599	网址：www.abchina.com
(2) 中国银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号	
法定代表人：田国立	联系人：宋亚平
电话：010-66593657	
客户服务电话：95566	网址：www.boc.cn
(3) 中国建设银行股份有限公司	
注册地址：北京市西城区金融大街 25 号	
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
法定代表人：王洪章	联系人：张静
电话：010-67596084	
客户服务电话：95533	网址：www.ccb.com
(4) 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：牛锡明	联系人：张作伟
电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
(5) 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：林本
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
(6) 上海浦东发展银行股份有限公司	
注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 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
(7) 兴业银行股份有限公司	
注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦	
办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦	
法定代表人：高建平	联系人：蒋怡
电话：0591-87839338	传真：0591-87841932
客户服务电话：95561	网址：www.cib.com.cn
(8) 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
(9) 中信银行股份有限公司	
注册地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座	
办公地址：北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座	
法定代表人：常振明	联系人：方爽
电话：010-65558888	
客户服务电话：95558	网址：bank.ecitic.com
(10) 重庆银行股份有限公司	
注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号	
法定代表人：马千真	联系人：孔文超
电话：023-63799379	传真：023-63792412
客户服务电话：(023)63836229	网址：www.cqcbank.com
(11) 华夏银行股份有限公司	
注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦	
法定代表人：吴建	联系人：刘军祥
电话：010-85238667	传真：010-85238680
客户服务电话：010-95577	网址：www.hxb.com.cn
(12) 汉口银行股份有限公司	
注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦	
办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号	
法定代表人：陈新民	联系人：李星
电话：027-82656224	传真：027-82656236



客户服务电话：（027）96558, 4006096558		网址：www.hkbchina.com
（13）杭州银行股份有限公司		
注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦		
办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦		
法定代表人：吴太普	联系人：严峻	
电话：0571-85108195	传真：0571-85106576	
客户服务电话：96523, 400-8888-508	网址：www.hzbank.com.cn	
（14）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	
（15）厦门银行股份有限公司		
注册地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦		
办公地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦		
法定代表人：吴世群	联系人：林黎云	
电话：0592-5365735	传真：0592-5061952	
客户服务电话：400-858-8888	网址：www.xmbankonline.com	
（16）安信证券股份有限公司		
注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
法定代表人：牛冠兴	联系人：陈剑虹	
电话：0755-82558305	传真：0755-28558355	
客户服务电话：4008-001-001	网址：www.essence.com.cn	
（17）长城证券股份有限公司		
注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层		
办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层		
法定代表人：黄耀华	联系人：高峰	
电话：0755-83516289	传真：0755-83515567	
客户服务电话：400-6666-888	网址：www.cgws.com	
（18）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：杨泽柱	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	

(19) 大通证券股份有限公司	
注册地址：辽宁省大连市中山区人民路 24 号	
办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层	
法定代表人：张智河	联系人：谢立军
电话：0411-39673202	传真：0411-39673219
客户服务电话：4008-169-169	网址：www.daton.com.cn
(20) 德邦证券有限责任公司	
注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼	
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼	
法定代表人：姚文平	联系人：王志琦
电话：021-68761616	传真：021-68767032
客户服务电话：400-8888-128	网址：www.tebon.com.cn
(21) 第一创业证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层	
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：钟兴
电话：0755-25832852	传真：0755-25831754
客户服务电话：400-888-1888	网址：www.firstcapital.com.cn
(22) 东方证券股份有限公司	
注册地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 层	
办公地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 层	
法定代表人：潘鑫军	联系人：沈燕
电话：021-63325888	传真：021-63326173
客户服务电话：95503	网址：www.dfzq.com.cn
(23) 东莞证券有限责任公司	
注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号	
办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼	
法定代表人：张运勇	联系人：乔芳
电话：0769-22112062	传真：0769-22119423
客户服务电话：0769-961130	网址：www.dgzq.com.cn
(24) 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

(25) 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：4008888788、10108998、95525	网址：www.ebscn.com
(26) 广州证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼	
法定代表人：邱三发	联系人：林洁茹
电话：020-88836999	传真：020-88836654
客户服务电话：020-961303	网址：www.gzs.com.cn
(27) 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
(28) 广发证券股份有限公司	
注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼	
法定代表人：孙树明	联系人：黄岚
电话：020-87555888 转各营业网点	传真：020-87557985
客户服务电话：95575 或致电各地营业部	网址：www.gf.com.cn
(29) 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：常喆	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
(30) 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：成都市东城根上街 95 号	
法定代表人：冉云	联系人：刘一宏
电话：028-86690126	传真：028-86690126
客户服务电话：4006600109	网址：www.gjzq.com.cn
(31) 国联证券股份有限公司	

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号	
办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702	
法定代表人：雷建辉	联系人：沈刚
电话：0510-82831662	传真：0510-82830162
客户服务电话：95570	网址：www.gls.com.cn
(32) 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：曾小普	联系人：陈明
电话：0791-6281061	传真：0791-6281061
客户服务电话：4008-222-111	网址：www.gsstock.com
(33) 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：021-38676666	传真：021-38670666
客户服务热线：4008888666	网址：www.gtja.com
(34) 国信证券股份有限公司	
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	
法定代表人：何如	联系人：周杨
电话：0755-82130833	传真：0755-82133952
客户服务电话：95536	网址：www.guosen.com
(35) 海通证券股份有限公司	
注册地址：上海市淮海中路 98 号	
办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦	
法定代表人：王开国	联系人：李笑鸣
电话：021-23219000	传真：021-23219100
客户服务电话：400-8888-001 或 95553	网址：www.htsec.com
(36) 华安证券股份有限公司	
注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 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
(37) 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
(38) 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
(39) 华泰联合证券有限责任公司	
注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层	
办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层	
法定代表人：马昭明	联系人：庞晓芸
电话：0755-82492000	传真：0755-82492962
客户服务电话：95513	网址：www.lhzq.com
(40) 华泰证券股份有限公司	
注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦	
法定代表人：吴万善	联系人：郭琳
电话：025-83290979	传真：025-84579763
客户服务电话：95597	网址：www.htsc.com.cn
(41) 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
(42) 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
(43) 平安证券有限责任公司	
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：石静武
电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511—8	网址：www.pingan.com
（44）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
（45）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
（46）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
（47）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
（48）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
（49）西藏同信证券股份有限公司	
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
(50) 湘财证券有限责任公司	
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼	
法定代表人：林俊波	联系人：钟康莺
电话：021-68634518	传真：021-68865680
客户服务电话：400-888-1551	网址：www.xcsc.com
(51) 日信证券有限责任公司	
注册地址：呼和浩特市新城区锡林南路 18 号	
办公地址：北京西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层	
法定代表人：孔佑杰	联系人：陈文彬
电话：010-83991743	传真：010-66412537
客户服务电话：010-83991888	网址：www.rxzq.com.cn
(52) 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：浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层	
法定代表人：兰荣	联系人：夏中苏
电话：021-38565785	
客户服务电话：400-8888-123	网址：www.xyzq.com.cn
(53) 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
(54) 中国民族证券有限责任公司	
注册地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	
办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层	
法定代表人：赵大建	联系人：姜建平
电话：010-59355543	传真：010-66553791
客户服务电话：40088-95618	网址：www.e5618.com
(55) 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 号国际企业大厦 C 座	
办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座	
法定代表人：陈有安	联系人：宋明

电话：010-66568888	传真：010-66568990
客户服务电话：4008-888-888	网址：www.chinastock.com.cn
(56) 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
(57) 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
(58) 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
(59) 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：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层	
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：4001022011	网址：www.zszq.com.cn
(60) 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：4008008899	网址：www.cindasc.com
(61) 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：余维佳	联系人：张煜
电话：023-63786633	传真：023-63786212



客服热线：4008096096		网址：www.swsc.com.cn
(62) 杭州数米基金销售有限公司		
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	
(63) 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：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16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	
(64) 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	
(65) 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	
(66) 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.licaike.com	
(67) 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	

(68) 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
(69) 上海汇付金融服务有限公司	
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
(70) 大泰金石投资管理有限公司	
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.dtfortune.com
<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，并及时公告。

## (二) 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	毕马威华振会计师事务所
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	北京东长安街1号东方广场东2座8层
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	上海南京西路1266号恒隆广场50楼
法定代表人	金颖	廖海（负责人）	姚建华
联系电话	010-59378856	021-51150298	021-22122888
传真	010-59378907	021-51150398	021-62881889
联系人	崔巍	廖海、刘佳	王国蓓（石海云、陈启明）

			为经办注册会计师)
--	--	--	-----------

#### 四、基金的名称

长信增利动态策略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

本基金对上市公司股票按照价值型与成长型进行风格划分,通过对证券市场未来走势的综合研判灵活配置两类风格的股票,从而在风险适度分散并保持组合流动性的基础上超越比较基准,获得长期增值回报。

#### 七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行并上市的股票(含新股配售与增发)、权证、债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票包括所有在交易所上市的 A 股;债券包括国债、金融债、企业债、可转债等;货币市场工具包括各种回购、央行票据、短期融资券、同业存款以及剩余期限在 1 年以内的短期债券等。

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

#### 八、基金的投资策略

本基金采用目前国外比较流行的风格轮换策略,以经过品质筛选的沪深 A 股为基本股票池,根据股票风格管理系统对个股进行风格分类,在量化分析的基础上对价值型和成长型两类风格股票进行主动投资,以获得超过比较基准的持续回报。

投资策略方面,本基金采用自上而下和自下而上相结合的策略结构。基金投资策略体系自上而下分为 3 个层面:战略配置、风格配置和个股选择。本基金为混合型基金,在整个投资体系中,本基金将重点放在风格配置和个股选择层面,

这两个层面对基金收益的贡献程度约占 80%，战略配置对基金收益的贡献程度约占 20%。在风格配置和个股选择层面，本基金将以风格轮换策略为主，辅以多层次个股选择，形成基金最后的投资组合。在投资过程中，本基金的股票风格管理系统和风险控制绩效量化管理平台将提供量化分析方面的决策支持。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分为上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为：

$$\text{沪深 300 指数收益率} \times 70\% + \text{上证国债指数收益率} \times 30\%$$

如果将来出现更合适的业绩比较基准，本基金将根据实际情况适当调整业绩比较基准，并在报送监管机构后予以公布。

## 十、基金的风险收益特征

2015 年 8 月 7 日起本基金更名为长信增利动态策略混合型证券投资基金，本基金的风险收益特征由“本基金为股票型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种”改为“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基金合同规定，于 2015 年 11 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止至 2015 年 9 月 30 日，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	1,023,404,907.67	76.38
	其中：股票	1,023,404,907.67	76.38
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	314,672,903.49	23.49
8	其他资产	1,784,732.32	0.13
9	合计	1,339,862,543.48	100.00

## （二）报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	812,725,905.39	61.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,349,711.46	2.61
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	122,237,616.00	9.30
G	交通运输、仓储和邮政业	14,619,660.00	1.11
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	32,377,246.32	2.46
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	7,094,768.50	0.54
S	综合	—	—
	合计	1,023,404,907.67	77.90

**(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	002640	跨境通	4,814,400	122,237,616.00	9.30
2	002773	康弘药业	918,588	53,535,308.64	4.08
3	603001	奥康国际	1,899,989	48,259,720.60	3.67
4	300274	阳光电源	2,007,222	47,089,428.12	3.58
5	603456	九洲药业	969,856	46,116,652.80	3.51
6	002665	首航节能	1,876,433	45,784,965.20	3.49
7	300203	聚光科技	1,600,003	38,480,072.15	2.93
8	300196	长海股份	1,709,952	36,815,266.56	2.80
9	002450	康得新	1,201,156	36,383,015.24	2.77
10	300224	正海磁材	1,448,325	36,352,957.50	2.77

**(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**(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**

本基金本报告期末未持有债券。

**(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投资贵金属。

**(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**

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**

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的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、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	1,463,760.24
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	58,319.75

5	应收申购款	262,652.33
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,784,732.32

#### 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。

基金2015年第3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：

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
2007年	152.23%	1.92%	98.52%	1.61%	53.71%	0.31%
2008年	-52.72%	2.36%	-50.46%	2.13%	-2.26%	0.23%
2009年	42.98%	1.59%	62.82%	1.43%	-19.84%	0.16%
2010年	-6.84%	1.26%	-7.46%	1.11%	0.62%	0.15%
2011年	-28.73%	1.29%	-16.91%	0.91%	-11.82%	0.38%
2012年	2.18%	1.24%	6.72%	0.90%	-4.54%	0.34%
2013年	18.26%	1.42%	-4.17%	0.98%	22.43%	0.44%
2014年	19.00%	1.32%	36.11%	0.85%	-17.11%	0.47%



2015年1月1日至2015年6月30日	66.50	2.52%	19.66%	1.59%	46.84%	0.93%
2015年7月1日至2015年9月30日	-17.14%	4.05%	-19.91%	2.34%	2.77%	1.71%

自合同生效之日（2006年11月9日）至2015年9月30日期间，本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比：



注：1、图示日期为2006年11月9日至2015年9月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起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中的约定。

### 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) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- (4) 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券交易费用；
- (7) 银行汇划费用；

(8) 按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产中扣除。

## 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理费

本基金的管理费按该基金资产净值的 1.5% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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，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、公休假等，支付日期顺延。

### (2) 基金托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(3) 上述“1、与基金运作有关费用列示”中(3)－(8)项费用由基金托管人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，从基金财产中支付。

## 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。其他不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规

定执行。

#### 4、基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，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

###### 1、申购费

(1) 投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

(2) 投资者选择交纳前端申购费用时，采用外扣法计算。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	1.50%
$100 \text{ 万} \leq M < 500$ 万	1.00%
$M \geq 500$ 万	1000 元

上述费率为 2008 年 6 月 2 日开始的调整后的费率，详见 2008 年 5 月 20 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于调整旗下股票基金交易手续费费率的公告》。

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。

(3) 投资者选择交纳后端申购费用时，按申购金额采用比例费率，费率随持有时间的增加而递减，具体费率如下：

持有时间 (N, 年)	后端申购费率
$N < 1$ 年	1.8%
$1 \text{ 年} \leq N < 3$ 年	1.2%
$3 \text{ 年} \leq N < 5$ 年	0.6%
$N \geq 5$ 年	0

因红利自动再投资而产生的后端收费的基金份额，不再收取后端申购费用。

###### 2、赎回费用

本基金的赎回费用再投资人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，具体费率如下：

持有时间 (N, 年)	赎回费率
N < 1 年	0.5%
1 年 ≤ N < 2 年	0.3%
N ≥ 2 年	0

### 3、转换费用与计算方式

本公司已开通了长信增利动态混合基金（前端代码：519993）与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级别代码：519999；B 级代码：519998）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信利丰债券基金、长信双利优选混合基金、长信恒利优势混合基金、长信纯债壹号债券基金、长信量化先锋混合基金、长信内需混合基金、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、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信多利混合基金和长信睿进混合基金之间的双向转换业务。长信增利动态混合基金（后端代码：519992）可转换转入长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级别代码：519999；B 级代码：519998），具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

1、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

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、本基金自 2007 年 9 月 1 日起暂停后端收费模式的申购和转换入业务。基金管理人认为需要重新开放后端模式的申购和转换入业务时, 将在开始实施前 3 个工作日在至少一种证监会指定的媒体上公告。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求, 并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动, 对本基金原招募说明书(《长信增利动态策略股票型证券投资基金招募说明书》)进行了更新, 主要更新的内容如下:

- 1、在“重要提示”部分, 就基金更名的情况进行了说明;
- 2、在“三、基金管理人”部分, 对公司的法定代表人、注册地址、基金管理人主要人员情况、员工情况、公司内部组织结构进行了更新;
- 3、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;
- 4、更新了“五、相关服务机构”部分的相应内容, 更新了代销机构的基本资料等信息;
- 5、在“八、基金份额的申购与赎回”部分, 增加了可转换的基金;
- 6、在“九、基金的投资”部分, 添加了风险收益特征修改的情况;
- 7、增加了“十、基金投资组合报告”部分的相应内容;

- 8、增加了“十一、基金的业绩”部分相应内容，并经托管银行复核；
- 9、更新了“二十二、基金份额持有人服务”部分的内容；
- 10、增加了“二十三、其它应披露的事项”部分的相应内容，披露了本次更新以来涉及本基金的相关公告事项。

长信基金管理有限责任公司  
二〇一五年十二月二十三日