

长信利息收益开放式证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2016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：中国农业银行股份有限公司

长信利息收益开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)于2003年12月25日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]149号文批准公开发行。本基金的基金合同于2004年3月19日正式生效。

重要提示

本基金于2003年12月25日经中国证券监督管理委员会证监基金字[2003]149号文批准公开发行。本基金的基金合同于2004年3月19日正式生效。

长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”)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审核同意,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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。本基金管理人并不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资者投资于本基金时应认真阅读本招募说明书。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年9月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国农业银

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) 基金管理人基本情况

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		
设立日期	2003 年 5 月 9 日		
组织形式	有限责任公司		
法定代表人	叶烨		
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	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
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。
邹继新	董事	男	中共党员，高级工程师，大学学历，硕士学位。现任武汉钢铁（集团）公司党委常委、副总经理、武汉钢铁股份有限公司总经理。曾任武汉钢铁股份有

			限公司三炼钢厂副厂长兼总工程师，武汉钢铁股份有限公司总经理助理兼武汉钢铁股份有限公司炼钢总厂厂长，武汉钢铁股份有限公司副总经理兼制造部部长，武汉钢铁(集团)公司副总经理，武汉钢铁(集团)公司副总经理兼武汉钢铁股份有限公司总经理。
田丹	董事	男	中共党员，硕士，EMBA。现任长江证券股份有限公司监事长。曾任湖北省军区参谋、秘书，中国人民银行湖北省分行金融调研处科长，湖北证券公司证券交易部经理、总经理助理、副总经理，三峡证券公司副总经理，湖北证券有限责任公司董事、副总裁，长江证券有限责任公司董事、副总裁、财务负责人，长江证券有限责任公司董事、总裁，长信基金管理有限责任公司董事长。
覃波	董事 (代为履行 董事长职务)	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。
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。
吴稼祥	独立董事	男	经济学学士，研究员。现任中国生物多样性保护与绿色发展基金会副理事长、中国体制改革研究会公共政策研究部研究员。曾任职中共中央宣传部和中共中央书记处办公室、华能贵诚信托投资公司独立董事。
谢红兵	独立董事	男	中共党员，学士。曾任营教导员、军直属政治处主任，交通银行上海分行杨浦支行副行长、营业处处长兼房地产信贷部经理、静安支行行长、杨浦支行行长，交通银行基金托管部副总经理、总经理，交银施罗德基金管理有限公司董事长，中国交银保险(香港)副董事长。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

2、监事会成员

监事会成员			
姓名	职务	性别	简历
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。
注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2016 年 10 月 21 日起，公司聘任孙红辉先生担任公司运营总监、聘任李毅女士担任总经理助理。			

3、经理层成员

经理层成员			
姓名	职务	性别	简历
覃波	总经理 (代为履行 董事长职 务)	男	简历同上。
周永刚	督察长	男	经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。
邵彦明	副总经理	男	硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公

			司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。
李小羽	副总经理	男	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。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，长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放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发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的基金经理、总经理助理、固定收益部总监。
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
张文珺	本基金的基金经理	2013年8月8日至今	高级工商管理硕士，上海财经大学 EMBA 毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004年10月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金的基金交易员、基金经理助理、本基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司固定收益部总监，长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金和长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
刘波	基金经理	2012年9月1日至2015年3月25日	曾任本基金的基金经理。
万莉	基金经理	2011年6月4日至2013年7月20日	曾任本基金的基金经理。
张文珺	基金经理	2005年11月26日至2011年6月4日	简历同上
徐力中	基金经理	2004年3月19日至2005年2月23日	曾任本基金的基金经理。
李颖	基金经理	2005年2月23日至	曾任本基金的基金经理。

		2005年11月26日	
王成	基金经理	2005年11月26日至 2006年9月22日	曾任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	职务
覃波	总经理（代为履行董事长职务）、投资决策委员会主任委员
李小羽	副总经理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信金葵纯债一年年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金和长信利发债券型证券投资基金的基金经理
程燕春	总经理助理兼专户投资部总监、投资决策委员会执行委员
常松	总经理助理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信金利趋势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、长信多利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
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、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理
高远	研究发展部副总监
易利红	股票交易部副总监
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）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理
陆莹	债券交易部副总监
注： 1、上述人员之间均不存在近亲属关系； 2、自 2016 年 10 月 21 日起，公司聘任易利红女士担任股票交易部总监、聘任陆莹女士为债券交易部总监、聘任高远先生为研究发展部总监。	

（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	量化投资部、投资管理部、研究发展部、固定收益部、股票交易部、债券交易部、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、机构服务部、专户投资部
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉办事处
员工总数	173 人（截至 2016 年 9 月 19 日）

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广

大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2013 年至 2015 年连续获得中国债券市场“优秀托管机构奖”，2015 年被中国银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 6 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 342 只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

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：叶焯	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
2、场外代销机构	
(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：周慕冰	联系人：唐文勇
传真：010-85109219	
客户服务电话：95599	网址：www.abchina.com
(2) 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
(3) 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：张宏革
电话：021-58781234	传真：021-58408483
客户服务电话：95559	网址：www.bankcomm.com
(4) 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：邓炯鹏
电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
(5) 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

(6) 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
(7) 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
(8) 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
(9) 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
(10) 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
(11) 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
(12) 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
(13) 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
(14) 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
(15) 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
(16) 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
(17) 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
(18) 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
(19) 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
(20) 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
(21) 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
(22) 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：薛峰	联系人：刘晨
电话：021-22169999	传真：021-22169134
客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
(23) 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
(24) 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
（25）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：020-87558888 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
（26）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
（27）国金证券股份有限公司	
注册地址：成都市东城根上街 95 号	
办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
法定代表人：冉云	联系人：刘婧漪、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
客户服务电话：95310	网址：www.gjzq.com.cn
（28）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.glsc.com.cn
（29）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
（30）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
(31) 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
(32) 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
(33) 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
(34) 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
(35) 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
(36) 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
(37) 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.jhzc.com.cn
(38) 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
(39) 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：周一涵
电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
客户服务电话：95511-8	网址：www.stock.pingan.com
(40) 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
(41) 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
(42) 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

(43) 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
(44) 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
(45) 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
(46) 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
(47) 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
(48) 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

(49) 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
(50) 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
(51) 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
(52) 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
(53) 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
(54) 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
(55) 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
(56) 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
(57) 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
(58) 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
(59) 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
(60) 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
(61) 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
(62) 和讯信息科技有限公司	
注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
法定代表人：王莉	联系人：吴卫东
电话：021-68419822	传真：021-20835779
客户服务电话：400-920-0022	网址：www.licaik.com
(63) 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
(64) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司	
注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809	
办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809	
法定代表人：沈伟桦	联系人：程刚
电话：010-52855713	传真：010-85894285
客户服务电话：4006099400	网址：www.yixinfund.com
(65) 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
(66) 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
(67) 上海陆金所资产管理有限公司	
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
(68) 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
(69) 上海联泰资产管理有限公司	
注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室	
办公地址： 上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼	
法定代表人： 燕斌	联系人： 陈东
电话： 021-52822063	传真： 021-52975270
客户服务电话： 400-046-6788	网址： www.66zichan.com
(70) 海银基金销售有限公司	
注册地址： 上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元	
办公地址： 上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼	
法定代表人： 刘惠	联系人： 毛林
电话： 021-80133597	传真： 021-80133413
客户服务电话： 4008081016	网址： www.fundhaiyin.com
(71) 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.lingxianfund.com
(72) 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： 沈继伟	联系人： 徐鹏
电话： 86-021-50583533	传真： 86-021-50583633
客户服务电话： 400-067-6266	网站： http://a.leadfund.com.cn/
(73) 珠海盈米财富管理有限公司	
注册地址： 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3451	
办公地址： 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203	
法定代表人： 肖雯	联系人： 钟琛
电话： 020-89629012	传真： 020-89629011
客户服务电话： 020-89629066	网站： www.yingmi.cn

(74) 北京汇成基金销售有限公司	
注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108	
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108	
法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
电话：18001102931	传真：010-62680827
客户服务电话：400-619-9059	网站：www.fundzone.cn
3、场内销售机构	
场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站： http://www.sse.com.cn	

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基金，并及时公告。

(二) 与本基金有关的注册登记机构、律师事务所、会计师事务所信息：

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（王国蓓、虞京京为经办注册会计师）

四、基金的名称

长信利息收益开放式证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在尽可能保证基金财产安全和高流动性的基础上，追求超过银行存款

的收益水平。

七、基金的投资方向

本基金投资对象主要包括：现金、一年以内（含一年）银行定期存款、大额存单、剩余期限小于 397 天（含 397 天）的短期债券、期限在一年以内（含一年）的债券回购、中央银行票据、银行承兑汇票、经银行背书的商业承兑汇票或中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。

本基金目前的投资对象主要包括银行存款、短期债券、中央银行票据、回购协议等，待获得监管部门的同意或许可后，本基金也将投资于大额存单、银行承兑汇票、经银行背书的商业承兑汇票或其他金融工具。

八、基金的投资策略

（一）决策依据

- 1、国家有关法律法规和《基金合同》的有关规定；
- 2、宏观经济形势及前景、有关政策趋向对证券市场的影响等；
- 3、国家财政政策、货币政策以及利率走势、通货膨胀预期等；
- 4、类别资产的预期收益率及风险水平。

（二）投资程序

本基金采取投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

1、研究发展部、固定收益部提交有关宏观经济分析、投资策略、债券分析等各类报告和投资建议，为投资运作提供决策支持；

2、投资决策委员会对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等因素进行综合分析，制定本基金投资组合的资产配置比例等重大决策；

3、基金经理在遵守投资决策委员会制定的投资原则的前提下，拟定投资方案；

4、投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策；

5、基金经理根据投资决策在授权范围内构造具体的投资组合及操作方案，

交由交易管理部执行；

6、金融工程部定期对基金投资组合进行绩效和风险评估，并提出风险控制意见；

7、基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。

(三) 投资组合管理的方法和标准

1、利率预期策略

通过对宏观经济、货币政策、短期资金供给等因素的分析，形成对利率走势的判断，并确定投资组合的平均剩余期限。

2、资产配置策略

根据对市场利率走势的判断，结合各品种之间流动性、收益性及风险情况，确定组合的资产配置，在保证组合高流动性、低风险的前提下尽量提升组合的收益。

3、无风险套利策略

由于市场分割，银行间市场与交易所市场的短期利率在一定时间可能存在定价偏离，同时在一定时间内市场中也可能出现跨品种、跨期限套利机会。本基金将在充分论证套利的可行性基础上谨慎参与。

4、现金流预算管理策略

通过对未来现金流的预测，在投资组合的构建中，采取合理的期限和权重配置对现金流进行预算管理，以满足基金运作的要求。同时在一部分资金管理上，将采用滚动投资策略，以提高基金财产的流动性。

九、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为：银行活期存款利率（税后）

十、基金的风险收益特征

基金为货币市场基金，其预期收益和风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于证券投资基金产品中低风险的投资品种。

十一、基金的投资组合报告

本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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月复核了本报告中的财务指标、收益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 2016 年 6 月 30 日(摘自 2016 年半年度报告)，本报告中所列财务数据未经会计师事务所审计。

1、报告期末基金资产组合

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	3,056,881,608.71	28.66
	其中: 债券	3,056,881,608.71	28.66
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,872,771,632.70	36.30
	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	3,556,359,495.66	33.34
4	其他各项资产	181,573,014.40	1.70
5	合计	10,667,585,751.47	100.00

2、报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	12.34	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,009,399,095.30	10.46
	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的比例为报告期内每个交易日融资余额占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

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%。

3、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	23
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

(2) 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	84.65	10.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	2.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	108.67	10.46

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5、期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,250,369,465.17	12.96
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	79,948,837.78	0.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,726,563,305.76	17.89
8	其他	-	-
9	合计	3,056,881,608.71	31.68
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

6、期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	150419	15 农发 19	4,100,000	410,154,825.01	4.25
2	150416	15 农发 16	4,100,000	410,045,439.42	4.25
3	150222	15 国开 22	2,300,000	230,029,487.94	2.38
4	130228	13 国开 28	2,000,000	200,139,712.80	2.07
5	111610016	111610016	2,000,000	199,842,025.42	2.07
6	111611224	111611224	2,000,000	199,793,767.63	2.07
7	111619022	111619022	1,800,000	179,256,702.30	1.86
8	111692349	111692349	1,500,000	149,869,327.68	1.55
9	111610171	111610171	1,000,000	99,960,524.18	1.04
10	111591072	111591072	1,000,000	99,959,823.33	1.04

7、“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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1517%
报告期内偏离度的最低值	0.0043%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0520%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

8、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

9、投资组合报告附注

(1) 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

(2) 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期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) 其他资产的构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	300,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	47,031,596.69
4	应收申购款	134,231,784.23
5	其他应收款	-
6	待摊费用	9,633.48
7	其他	-
8	合计	181,573,014.40

(4) 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。

基金净值表现（截至2016年6月30日）

（一）长信利息收益货币A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

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.1815%	0.0012%	0.0292%	0.0000%	0.1523%	0.0012%
过去三个月	0.5870%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.4985%	0.0013%
过去六个月	1.2415%	0.0013%	0.1769%	0.0000%	1.0646%	0.0013%
过去一年	2.6812%	0.0023%	0.3558%	0.0000%	2.3254%	0.0023%
过去三年	10.9826%	0.0046%	1.0656%	0.0000%	9.9170%	0.0046%
自基金合同生效起	45.3348%	0.0071%	14.9570%	0.0032%	30.3778%	0.0039%

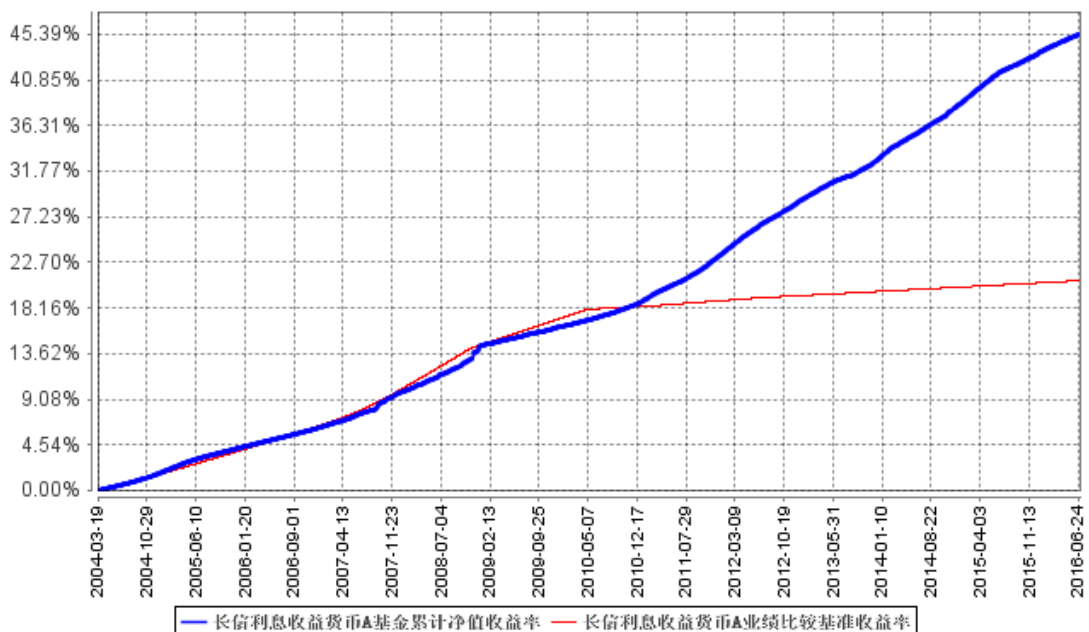
至今						
----	--	--	--	--	--	--

(二) 长信利息收益货币B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

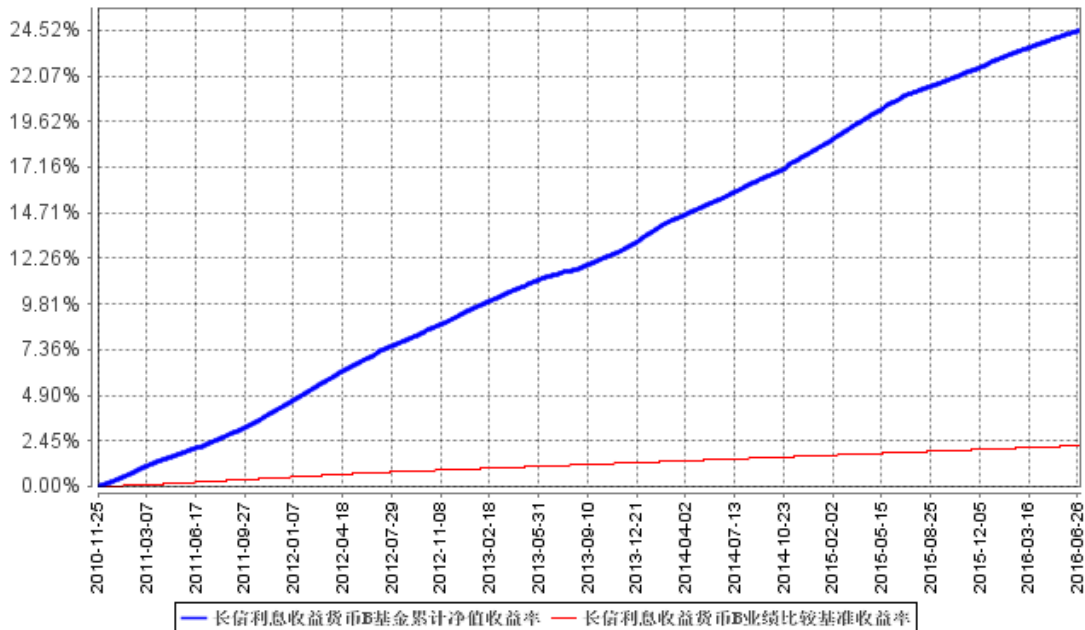
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2011%	0.0012%	0.0292%	0.0000%	0.1719%	0.0012%
过去三个月	0.6469%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.5584%	0.0013%
过去六个月	1.3624%	0.0013%	0.1769%	0.0000%	1.1855%	0.0013%
过去一年	2.9280%	0.0023%	0.3558%	0.0000%	2.5722%	0.0023%
过去三年	11.7838%	0.0046%	1.0656%	0.0000%	10.7182%	0.0046%
自基金合同生效起至今	24.4748%	0.0043%	2.1817%	0.0002%	22.2931%	0.0041%

(三) 自基金合同生效以来基金份额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

1、长信利息收益货币A自基金合同生效以来基金份额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



2、长信利息收益货币B自基金分级以来基金份额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、长信利息收益货币A图示日期为2004年3月19日至2016年6月30日，长信利息收益货币B图示日期为2010年11月25日（本基金分级日）至2016年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起3个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关费用

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）基金的销售服务费；
- （4）证券交易税费；
- （5）基金信息披露费用（本基金成立前的信息披露费用不从基金财产中列支）；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）与基金相关的会计师、律师等中介机构费用（本基金成立前所发生的

与本基金有关的会计师费和律师费不从基金财产支付);

(8) 按照国家有关规定和《基金合同》规定可以列入的其他费用。

上述基金费用由基金管理人按照公允的市场价格确定, 法律法规另有规定时从其规定。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的基金管理费

基金管理人的报酬是基金管理费, 在通常情况下, 基金管理费按前一日基金资产净值的 G%年费率计提。

基金	管理费率 (G%)
利息收益基金	0.33%

计算方法为:

$$H = E \times G\% \div \text{当年天数}$$

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;

G%为年管理费率;

基金管理费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。

(2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的托管费每日计算, 按前一日基金资产净值的 T%年费率计提, 每一基金的托管费率如下:

基金	托管费率 (T%)
利息收益基金	0.10%

托管费计算方法为:

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

H 为每日应支付的基金托管费;

T%为年托管费率;

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管

费划付指令，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，支付日期顺延。

(3) 基金的销售服务费

本基金依照相关法律法规和《基金合同》的规定收取基金销售与持有人服务费。本项费用专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。A 级基金份额按照 0.25% 的年费率计提销售服务费，B 级基金份额按照 0.01% 的年费率计提销售服务费。销售与持有人服务费计算方法为：

$$H=E \times X\% \div \text{当年天数};$$

H 为每日应支付的基金销售与持有人服务费；

X% 为年销售与持有人服务费率；

E 为前一日的基金资产净值。

基金销售与持有人服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售与持有人服务费划付指令，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销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

基金	销售与持有人服务费率(X%)
长信利息收益基金	0.25%

销售与持有人服务费计算方法为：

$$H=E \times X\% \div \text{当年天数};$$

H 为每日应支付的基金销售与持有人服务费；

X% 为年销售与持有人服务费率；

E 为前一日的基金资产净值。

基金销售与持有人服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售与持有人服务费划付指令，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销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(4) 上述与基金运作有关费用中 (4) 到 (8) 项费用由基金托管人根据

其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

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。

4、基金费用的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售与持有人服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和基金销售与持有人服务费率,经中国证监会核准后公告,无须召开基金份额持有人大会;调高基金管理费率、基金托管费率和基金销售与持有人服务费率,须召开基金份额持有人大会审议。调整基金管理费率和托管费率,基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在指定媒体上刊登公告。

(二) 与基金销售有关的费用

1、本基金的申购费、赎回费为 0。

2、基金的转换费

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)

基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下, 调整收费方式和费率水平, 但最迟应于新收费办法开始实施日前2个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

十四、基金的收益与分配

(一) 收益的构成

基金收益包括: 基金投资所得债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。因买卖证券差价关系, 本基金存在日净收益为负值的可能。

(二) 收益分配原则

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;
- 2、基金收益分配采用红利再投资分红方式, 投资者可通过赎回基金份额方式获取现金红利收益;
- 3、“每日分配、按日支付”。本基金从 2016 年 1 月 1 日起, 收益分配由以前的“每日分配、按月结转”调整为“每日分配、按日支付”。因 2016 年 1 月 1

日至1月3日为法定节假日，该节假日收益并入前一交易日2015年12月31日予以分配。本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；

4、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益；

5、在符合法律法规的前提下，本基金根据每日收益情况将当日收益全部分配，即当日收益分配比例为100%。如当日收益为正，则相应增加基金份额；如当日收益为负，则不进行收益分配并相应减少基金份额，保持基金份额净值为1元；

6、在不影响投资者利益情况下，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。。

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

（三）收益分配方案

本基金收益根据本基金合同规定的分配原则进行分配，收益公告由基金管理人编制，经基金托管人复核，每开放日公告一次，披露公告截止日前一个开放日每万份基金净收益及7日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，披露节假日期间的每万份基金净收益和节假日最后一日的7日年化收益率，以及节假日后首个开放日的每万份基金净收益和7日年化收益率。基金管理人另行公告基金收益分配方案。对上述事项，法律法规有新的规定时，基金管理人应按新的规定作出调整。

（四）收益公告

本基金每开放日公布前一开放日基金日收益以及基金7日年化收益率。基金收益公告由基金管理人拟定，基金托管人核实后确定。本基金按日计算收益，基金管理人另行公告基金收益分配方案。

日每万份基金净收益 = 当日基金净收益 / 当日基金份额总额 × 10000

结果精度为0.0001，第五位采用截位的方式。

$$7\text{ 日年化收益率}(\%) = \left\{ \left[\prod_{i=1}^7 \left(1 + \frac{R_i}{10000} \right) \right]^{365/7} - 1 \right\} \times 100\%$$

R_i 为最近第 i 个自然日（包括计算当日）的每万份基金净收益。如不足 7 日，则采取上述公式类似计算。

（五）基金收益分配中发生的费用

收益分配采用红利再投资方式，免收再投资费用。

十五、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，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书（《长信利息收益开放式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“三、基金管理人”部分，对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；
- 2、在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料；
- 3、在“五、相关服务机构”部分，更新部分渠道法定代表人、联系人、电话、注册地址、办公地址等信息，更新新增的场外代销机构的信息；
- 4、在“八、基金的申购、赎回与转换”部分，更新了可转换的基金信息、申购和赎回的数额约定以及赎回的数量；
- 5、在“十、基金的投资、十一、基金的业绩”部分，更新了最近一期投资组合报告的内容和基金的投资业绩；
- 6、在“二十二、对基金份额持有人的服务”部分，更新了对持有人服务的内容；
- 7、在“二十四、其他应披露的事项”部分，更新了本基金的相关公告事项。

长信基金管理有限责任公司

2016年11月2日