

# 长信利众债券型证券投资基金（LOF）

## 更新的招募说明书摘要

### 2017 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：上海浦东发展银行股份有限公司

长信利众分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2012 年 12 月 19 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1708 号文核准募集。本基金的基金合同于 2013 年 2 月 4 日正式生效。根据基金合同的有关规定，基金合同生效后 3 年期届满即 2016 年 2 月 4 日，无需召开基金份额持有人大会，本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“长信利众债券型证券投资基金（LOF）”。基金管理人已于 2016 年 2 月 5 日办理完毕运作期届满转换有关工作，自 2016 年 2 月 5 日起，基金名称变更为“长信利众债券型证券投资基金（LOF）”。2016 年 6 月 24 日，本基金在原基金份额基础之上对基金份额进行分类，原有长信利众债券型证券投资基金（LOF）基金份额为 C 类份额（以下简称“利众（LOF）C 类”），并增设 A 类份额（以下简称“利众（LOF）A 类”）。

#### 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。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金经基金份额分级后，自本基金基金合同生效之日起 3 年内，利众 A 为低风险、收益相对稳定的

基金份额；利众 B 为较高风险、较高收益的基金份额。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。投资有风险，投资者认购（或申购）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，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）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者基金投资要承担相应风险，包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者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，以及本基金投资策略所特有的风险等。

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 2017 年 8 月 4 日，有关财务数据和净值截止日为 2017 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人上海浦东发展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%      |
|      | 武汉钢铁股份有限公司                | 2500.5 万元  | 15.15%      |
|      | 上海彤胜投资管理中心（有限合伙）          | 751 万元     | 4.55%       |
|      | 上海彤骏投资管理中心（有限合伙）          | 749 万元     | 4.54%       |
|      | 总计                        | 16500 万元   | 100%        |

## （二）主要人员情况

### 1、基金管理人的董事会成员情况

| 董事会成员 |       |    |   |
|-------|-------|----|---|
| 姓名    | 职务    | 性别 | 简历  |
| 成善栋   | 董事长   | 男  | 中共党员，硕士研究生，IMBA，曾任职中国人民银行上海市分行静安区办事处办公室科员，中国人民银行上海市分行、工商银行上海市分行办公室科员、科长，上海巴黎国际银行信贷部总经理，工商银行上海市分行办公室副主任、管理信息部总经理、办公室主任、党委委员、副行长，并历任上海市金融学会副秘书长，上海城市金融学会副会长、秘书长。  |
| 刘元瑞   | 非独立董事 | 男  | 中共党员，硕士研究生，现任长江证券股份有限公司副总裁。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。   |
| 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。曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁、总裁。 |
| 何宇城   | 非独立董事 | 男  | 中共党员，硕士，MBA、EMPACC。现任武汉钢铁有限公司副总经理。曾任宝钢计划财务部助理会计师，宝钢资金管理处费用综合管理，宝钢成本管理处冷轧成本管理主办、主管，宝钢股份成本管理处综合主管，宝钢股份财务部预算室综合主管，宝钢股份财务部副部长，宝钢分公司炼钢厂副厂长，不锈钢分公司副总经理，宝钢股份钢管条钢事业部副总经理兼南通宝钢钢铁有限公司董事长、经营财务部部长。                       |

|                          |       |   |   |
|--------------------------|-------|---|---|
| 覃波                       | 非独立董事 | 男 | 中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。                                |
| 吴稼祥                      | 独立董事  | 男 | 经济学学士，研究员。现任中国生物多样性保护与绿色发展基金会副理事长、中国体制改革研究会公共政策研究部研究员。曾任职中共中央宣传部和中共中央书记处办公室、华能贵诚信托投资公司独立董事。   |
| 谢红兵                      | 独立董事  | 男 | 中共党员，学士。曾任营教导员、军直属政治处主任，交通银行上海分行杨浦支行副行长、营业处处长兼房地产信贷部经理、静安支行行长、杨浦支行行长，交通银行基金托管部副总经理、总经理，交银施罗德基金管理有限公司董事长，中国交银保险(香港)副董事长。   |
| 徐志刚                      | 独立董事  | 男 | 中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长、党委副书记，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业（集团）有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询（上海）有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。 |
| <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   |
| 吴伟    | 监事会主席 | 男  | 中共党员，研究生学历。现任武汉钢铁股份有限公司经营财务部总经理。历任武钢计划财务部驻工业港财务科副科长、科长、资金管理处主任科员、预算统计处处长，武汉钢铁股份有限公司计划财务部副部长。   |
| 陈水元   | 监事    | 男  | 硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司执行副总裁、财务负责人。曾任湖北证券有限责任公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理、总裁特别助理。 |
| 杨爱民   | 监事    | 男  | 中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。  |

|     |    |   |  |
|-----|----|---|--|
| 李毅  | 监事 | 女 | 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理兼零售服务部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监。                |
| 孙红辉 | 监事 | 男 | 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。 |
| 魏明东 | 监事 | 男 | 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。   |

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

### 3、经理层成员

| 经理层成员 |      |    |  |
|-------|------|----|--|
| 姓名    | 职务   | 性别 | 简历   |
| 覃波    | 总经理  | 男  | 简历同上。  |
| 周永刚   | 督察长  | 男  | 经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。   |
| 邵彦明   | 副总经理 | 男  | 硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。  |
| 李小羽   | 副总经理 | 男  | 上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大 Investors Group Financial Services Co., Ltd。2002年加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金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。现任长信基金管理有限责任公司副总经理、长信利丰债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金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。 |

|     |      |   |  |
|-----|------|---|--|
| 程燕春 | 副总经理 | 男 | 华中科技大学技术经济学士，具有基金从业资格，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，曾任中国建设银行江西省分行南昌城东支行副行长，中国建设银行纪检监察部案件检查处监察员，中国建设银行基金托管部市场处、信息披露负责人，融通基金管理有限公司筹备组成员、总经理助理兼北京分公司总经理、上海分公司总经理、执行监事，金元惠理基金管理有限公司首席市场官，历任长信基金管理有限责任公司总经理销售助理、总经理助理。 |
|-----|------|---|--|

注：

- 1、上述人员之间均不存在近亲属关系；
- 2、自 2017 年 8 月 8 日起，李小羽先生不再担任长信利发债券型证券投资基金的基金经理。

#### 4、基金经理

| 本基金基金经理情况 |        |                              |   |
|-----------|--------|------------------------------|---|
| 姓名        | 职务     | 任职时间                         | 简历  |
| 李小羽       | 基金经理   | 2016 年 11 月 30 日起至今          | 简历同上  |
| 胡琼予       | 基金经理助理 | 自 2016 年 12 月 12 日起至今        | 美国波士顿大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任美世咨询研究分析师，2013 年加入长信基金管理有限责任公司，曾任债券交易部高级债券交易员，现任职于固定收益部，担任长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信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、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。 |
| 刘波        | 基金经理   | 自基金合同生效之日起至 2016 年 12 月 22 日 | 曾任本基金的基金经理  |

#### 5、投资决策委员会成员

| 投资决策委员会成员 |   |
|-----------|---|
| 姓名        | 职务  |
| 覃波        | 总经理、投资决策委员会主任委员   |
| 李小羽       | 副总经理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金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  |
| 常松  | 总经理助理兼混合策略部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金和长信先优债券型证券投资基金的基金经理   |
| 安昀  | 总经理助理、投资决策委员会执行委员   |
| 杨帆  | 国际业务部副总监、投资决策委员会执行委员、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信上证港股通指数型发起式证券投资基金的基金经理   |
| 高远  | 研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理  |
| 易利红   | 股票交易部总监兼债券交易部总监   |
| 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）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理   |
| 陆莹  | 长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金和长信稳健纯债债券型证券投资基金的基金经理  |
| 邓虎  | FOF 投资部总监、长信改革红利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、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金和长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）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、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金和长信多利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理  |
| 左金保   | 量化投资部总监、长信量化多策略股票型证券投资基金、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、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金和长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理 |
| 张飒岚   | 固收专户投资部总监兼投资经理  |
| 姚奕帆   | 量化专户投资部投资经理   |
| <b>注：</b><br>1、上述人员之间均不存在近亲属关系；<br>2、自 2017 年 8 月 8 日起，李小羽先生不再担任长信利发债券型证券投资基金的基金经理；<br>3、自 2017 年 8 月 18 日起，张文琍女士开始担任长信稳势纯债债券型证券投资基金的基金经理；<br>4、自 2017 年 8 月 30 日起，常松先生开始担任长信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理； |   |

5、自 2017 年 9 月 8 日起，陆莹女士开始担任长信长金货币市场基金的基金经理。

### （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  | 量化投资部、权益投资部、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、保险业务部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、银行机构业务部、国际业务部、战略与产品研发部、电子商务部、财务管理部、专户产品与机构服务部、专户投资部、固收专户投资部、量化专户投资部、绝对收益部、混合策略部、FOF 投资部、综合机构部、培训部、混合债券部。 |
| 分支机构  | 北京分公司、深圳分公司、武汉分公司、武汉办事处  |
| 员工总数  | 205 人（截至 2017 年 8 月 4 日）   |
| 注：为更好的厘清分支机构职能，进一步优化公司组织结构，根据董事会授权，经公司研究决定，拟撤销长信基金管理有限责任公司武汉办事处。撤销武汉办事处事项已向中国证监会、上海证监局和湖北证监局备案。 |  |

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：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：高国富

成立时间：1992 年 10 月 19 日

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票



以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

织形式： 股份有限公司

注册资本： 216.18 亿元人民币

存续期间： 持续经营

基金托管资格批文及文号： 中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人： 朱萍

联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## （二）主要人员情况

高国富，男，1956 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师职称。曾任上海外高桥保税区开发（控股）公司总经理；上海外高桥保税区管委会副主任；上海万国证券公司代总裁；上海久事公司总经理；上海市城市建设投资开发总公司总经理；中国太平洋保险（集团）股份有限公司党委书记、董事长。现任上海浦东发展银行股份有限公司党委书记、董事长。第十二届全国政协委员。伦敦金融城中国事务顾问委员会委员，中欧国际工商学院理事会成员、国际顾问委员会委员，上海交通大学安泰经济管理学院顾问委员会委员。

刘信义，男，1965 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任上海浦东发展银行上海地区总部副总经理，上海市金融服务办挂职任机构处处长、市金融服务办主任助理，上海浦东发展银行党委委员、副行长、财务总监，上海国盛集团有限公司总裁。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长。

刘长江，男，1966 年出生，硕士研究生，经济师。历任工商银行总行教育部主任科员，工商银行基金托管部综合管理处副处长、处长，上海浦东发展银行总行基金托管部总经理，上海浦东发展银行公司及投资银行总部资产托管部、企业年金部、期货结算部总经理，上海浦东发展银行公司及投资银行总部副总经理兼资产托管部、企业年金部、期货结算部总经理，上海浦东发展银行总行金融机构部总经理。现任上海浦东发展银行总行金融机构部、资产托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截止 2017 年 6 月 30 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 2456.43 亿元，比去年末增长 33.45%。托管证券投资基金共一百一十六只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、银华永泰债券型基金、长信利众债券基金（LOF）、华富保本混合型证券投资基金、中海安鑫保本基金、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金年、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、中信建投稳信债券基金、华富恒财分级债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、国寿安保尊益信用纯债基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、博时产业债纯债基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、国联安鑫富混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、国寿安保稳定回报基金、国寿安保稳健回报基金、国投瑞银新成长基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、国联安鑫禧基金、国联安鑫悦基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、国联安安稳保本基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、华富诚鑫灵活配置基金、富安达长盈保本基金、中信建投稳溢保本基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利

发债券基金、博时景发纯债基金、国泰添益混合基金、鑫元得利债券型基金、中银尊享半年定开基金、鹏华兴盛定期开放基金、华富元鑫灵活配置基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、鹏华兴锐定期开放基金、汇添富保鑫保本混合基金、景顺长城景颐盛利债券基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞一年定开债券基金、国联安鑫盛混合基金、汇安嘉汇纯债债券基金、鹏华普泰债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、国泰景益灵活配置混合基金、国联安鑫利混合基金、易方达瑞程混合基金、华福长富一年定开债券基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、工银瑞信瑞盈半年定开债券基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安丰泰灵活配置混合基金、汇安丰恒混合基金、交银施罗德启通灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数基金、南方和利定开债券基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、银河犇利灵活配置混合基金、长安鑫富领先混合基金、长盛盛泰灵活配置混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

1、本行内部控制目标为：确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和本行规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管

控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备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责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急预案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督依据

托管人严格按照有关政策法规、以及基金合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- （1）《中华人民共和国证券法》；
- （2）《中华人民共和国证券投资基金法》；
- （3）《公开募集证券投资基金运作管理办法》；；
- （4）《证券投资基金销售管理办法》
- （5）《基金合同》、《基金托管协议》；
- （6）法律、法规、政策的其他规定。

##### 2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的

投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

### 3、监督方法

（1）资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对基金管理人投资交易行为的监督职责，规范基金运作，维护基金投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

（2）在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

（3）对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

### 4、监督结果的处理方式

（1）基金托管人对基金管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向基金管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

（2）若基金托管人发现基金管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知基金管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内基金托管人再对基金管理人违规事项进行复查，如果基金管理人未予纠正，基金托管人将报告中国证监会。如果发现基金管理人投资运作有重大违规行为时，基金托管人应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正；

（3）针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应及时提供有关情况和资料。

## 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：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: 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  |
| (6) 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  |

|   |                        |
|---|------------------------|
| (7) 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  |
| (8) 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    |
| (9) 中国光大银行股份有限公司                            |                        |
| 注册地址: 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心                |                        |
| 办公地址: 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心                |                        |
| 法定代表人: 唐双宁                                  | 联系人: 沙牧楠               |
| 电话: 010-63639110                            |                        |
| 客户服务电话: 95595                               | 网址: cebbank.com        |
| (10) 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 |
| (11) 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      |
| (12) 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   |

|   |                            |
|---|----------------------------|
| (13) 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        |
| (14) 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 |
| (15) 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         |
| (16) 光大证券股份有限公司                         |                            |
| 注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号                   |                            |
| 办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号                   |                            |
| 法定代表人：薛峰                                | 联系人：刘晨                     |
| 电话：021-22169999                         | 传真：021-22169134            |
| 客户服务电话：95525                            | 网址：www.ebscn.com           |
| (17) 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          |
| (18) 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         |



|                                      |                      |
|--------------------------------------|----------------------|
| (19) 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     |
| (20) 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     |
| (21) 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   |
| (22) 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   |
| (23) 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   |
| (24) 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      |

|                                      |                      |
|--------------------------------------|----------------------|
| (25) 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    |
| (26) 国元证券股份有限公司                      |                      |
| 注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号                 |                      |
| 办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号                 |                      |
| 法定代表人：凤良志                            | 联系人：李飞               |
| 电话：05551-2615542                     | 传真：0551-2634906      |
| 客户服务电话：955784008-888-777             | 网址：www.gyzq.com.cn   |
| (27) 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     |
| (28) 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      |
| (29) 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 |
| (30) 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 |

|  |                         |
|--|-------------------------|
| (31) 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.jhzb.com.cn      |
| (32) 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      |
| (33) 平安证券股份有限公司                          |                         |
| 注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼              |                         |
| 办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）      |                         |
| 法定代表人：杨宇翔                                | 联系人：周一涵                 |
| 电话：0755-22626391                         | 传真：0755-82400862        |
| 客户服务电话：95511—8                           | 网址：www.stock.pingan.com |
| (34) 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      |
| (35) 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       |
| (36) 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       |

|  |                       |
|--|-----------------------|
| (37) 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      |
| (38) 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     |
| (39) 西藏东方财富证券股份有限公司                    |                       |
| 注册地址: 拉萨市北京中路 101 号                    |                       |
| 办公地址: 上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号           |                       |
| 法定代表人: 贾绍君                             | 联系人: 汪尚斌              |
| 电话: 021-36533017                       | 传真: 021-36533017      |
| 客户服务电话: 400-8811-177                   | 网址: www.xzsec.com     |
| (40) 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   |
| (41) 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   |
| (42) 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 |

|  |                          |
|--|--------------------------|
| (43) 中国银河证券股份有限公司                              |                          |
| 注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层                     |                          |
| 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座                 |                          |
| 法定代表人：陈共炎                                      | 联系人：邓颜                   |
| 电话：010-66568292                                | 传真：010-66568990          |
| 客户服务电话：4008-888-888                            | 网址：www.chinastock.com.cn |
| (44) 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：张颖                   |
| 电话：010-85130588                                | 传真：010-65182261          |
| 客户服务电话：400-8888-108                            | 网址：www.csc108.com        |
| (45) 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        |
| (46) 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      |
| (47) 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：95329                                   | 网址：www.zszq.com.cn       |
| (48) 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       |

|   |                      |
|---|----------------------|
| (49) 西南证券股份有限公司                           |                      |
| 注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号                        |                      |
| 办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦                  |                      |
| 法定代表人：吴坚                                  | 联系人：张煜               |
| 电话：023-63786633                           | 传真：023-63786212      |
| 客服热线：4008096096                           | 网址：www.swsc.com.cn   |
| (50) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司                       |                      |
| 注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室      |                      |
| 办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼              |                      |
| 法定代表人：陈柏青                                 | 联系人：韩爱彬              |
| 电话：0571-81137494                          | 传真：4000-766-123      |
| 客户服务电话：4000-766-123                       | 网址：www.fund123.cn    |
| (51) 上海长量基金销售投资顾问有限公司                     |                      |
| 注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室           |                      |
| 办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层               |                      |
| 法定代表人：张跃伟                                 | 联系人：马良婷              |
| 电话：021-20691832                           | 传真：021-20691861      |
| 客户服务电话：400-820-2899                       | 网址：www.erichfund.com |
| (52) 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 |
| (53) 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   |
| (54) 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   |
| (55) 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 |
| (56) 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  |
| (57) 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   |
| (58) 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   |
| (59) 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    |
| (60) 大泰金石基金销售有限公司                           |                       |
| 注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室 |                       |
| 办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼              |                       |
| 法定代表人：袁頌明                                   | 联系人：朱真卿               |
| 电话：021-22267943                             | 传真：021-22268089       |
| 客户服务电话：400-928-2266                         | 网址：www.dtfortune.com  |
| (61) 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   |
|  |   |
| （62）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   |
|  |   |
| （63）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   |
|  |   |
| （64）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： <a href="http://a.leadfund.com.cn/">http://a.leadfund.com.cn/</a> |
|  |   |
| （65）珠海盈米财富管理有限公司                             |   |
| 注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491               |   |
| 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 |   |
| 法定代表人：肖雯                                     | 联系人：钟琛  |
| 电话：020-89629012                              | 传真：020-89629011   |
| 客户服务电话：020-89629066                          | 网站：www.yingmi.cn  |
|  |   |
| （66）北京汇成基金销售有限公司                             |   |
| 注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108              |   |
| 办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108              |   |
| 法定代表人：王伟刚                                    | 联系人：丁向坤   |
| 电话：010-56282140                              | 传真：010-62680827   |
| 客户服务电话：400-619-9059                          | 网站：www.hcjjjin.com  |
|  |   |
| （67）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 |
| <b>3、场内销售机构</b>   |                       |
| 场内销售机构是指有资格的深圳证券交易所会员，名单详见深圳证券交易所网站：<br><a href="http://www.szse.cn">http://www.szse.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基金份额，并及时公告。

## （二）其他相关机构

| 信息类型  | 注册登记机构           | 律师事务所                      | 会计师事务所                         |
|-------|------------------|----------------------------|--------------------------------|
| 名称    | 中国证券登记结算有限责任公司   | 上海源泰律师事务所                  | 毕马威华振会计师事务所（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 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 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 | 周明               | 廖海（负责人）                    | 邹俊（执行事务合伙人）                    |
| 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、薛晨俊为经办注册会计师）           |

## 四、基金的名称

长信利众债券型证券投资基金（LOF）

## 五、基金的类型

契约型

## 六、基金份额的分级

### （一）基金份额的分级

本基金将基金份额持有人初始有效认购的基金份额按照不超过 7：3 的份额配比，分为预期收益和预期风险不同的两级基金份额，即利众 A 和利众 B。自本基金基金合同生效之日起 3 年内，利众 A 和利众 B 的基金资产合并运作。

## （二）基金份额的运作

### 1、利众 A、利众 B 运作方式

本基金基金合同生效之日起 3 年内，利众 A 在基金合同生效后每满 6 个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。利众 A 的开放日原则上为自基金合同生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日（利众 A 的开放日以及开放办理申购与赎回业务的具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准）。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。利众 A 的第一次开放日为基金合同生效日至 6 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；第二次开放日为基金合同生效之日至 12 个月满的日期，如该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日；以此类推。

利众 B 封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。利众 B 的封闭期为自基金合同生效之日起至 3 年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

### 2、利众 A 基金份额的折算

基金管理人可在基金份额折算基准日对利众 A 进行基金份额折算。折算后利众 A 的基金份额净值为 1.0000 元，基金份额持有人持有的利众 A 的份额数按折算比例相应增减。利众 A 的基金份额折算基准日与开放日为同一天。具体份额折算方法参照基金合同中“七、利众 A 的基金份额折算”以及基金管理人届时在指定媒体上发布的相关公告。

### 3、基金份额配比与规模控制

利众 A、利众 B 的份额分开募集、资产合并运作。本基金募集设立时，利众 A、利众 B 的份额配比原则上不超过 7：3。本基金基金合同生效之日起 3 年内，基金管理人可在基金份额折算基准日对利众 A 进行份额折算，并确保开放日利众 A 的基金份额净值为 1.0000 元，基金份额持有人持有的利众 A 的份额数按折算比例相应增减。在每一个开放日的下一个工作日，即 T+1 日，所有经确认有效的

利众 A 的赎回申请全部予以成交确认，所有经确认有效利众 A 的申购申请，基金管理人按照历史累计申购份额数不超过历史累计赎回份额数的原则进行成交确认。

具体规模控制及其控制措施见发售公告以及基金管理人在指定媒体上发布的其他相关公告。

### （三）利众 A、利众 B 基金份额收益分配规则

利众 A 根据基金合同的规定获取约定收益，其收益率将在每个开放日设定一次并公告。计算公式为：

利众 A 的年收益率（单利）=1.2×1 年期银行定期存款利率+1.0%

利众 A 的年收益率计算按照四舍五入的方法保留到以百分比计算的小数点后第 2 位。

在基金合同生效日当日，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率设定利众 A 的首次年收益率；在利众 A 的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定利众 A 的年收益率，且约定收益率为单利。

如届时法律法规及其他规定对 1 年期银行存款利息征收利息税，则利众 A 的年收益率（单利）的计算公式中“1 年期银行定期存款利率”指征税后的利率。例如：假设某一开放日中国人民银行公布的 1 年期银行定期存款利率为 2.5%，利息税为 5%，则 1 年期银行定期存款利率为  $2.5\% \times (1-5\%) = 2.375\%$ 。

本基金的净资产将优先支付利众 A 的本金及约定收益，在扣除利众 A 的应计收益后的全部剩余收益归利众 B 享有。如本基金的净资产等于或低于利众 A 的本金及其约定应得收益的总额，则本基金净资产全部分配予利众 A 后，仍存在额外未弥补的利众 A 本金及约定收益总和的差额，则不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证封闭期满时利众 A 份额持有人的约定应得收益，即如果在封闭期末本基金资产出现极端损失的情况下，利众 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金损失的风险。

#### （四）基金份额发售

利众 A、利众 B 将分别通过各自销售机构的销售网点独立进行公开发售。

#### （五）本基金的基金份额净值计算

本基金的基金份额净值计算公式如下：

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日闭市后的基金资产净值 /  $T$  日基金份额的余额数量

本基金基金合同生效之日起 3 年内， $T$  日基金份额的余额数量为利众 A 和利众 B 的份额总额；本基金基金合同生效后 3 年期满并转为上市开放式基金（LOF）后， $T$  日基金份额的余额数量为该 LOF 基金的份额总额。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

$T$  日的基金份额净值在当天收市后计算，并在  $T+1$  日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （六）利众 A 和利众 B 的基金份额参考净值计算

本基金基金合同生效后 3 年期内，基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算并公告利众 A 和利众 B 的基金份额参考净值，其中利众 A 的基金份额参考净值计算日不包括利众 A 的开放日。基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

##### 1、利众 A 的基金份额参考净值计算

本基金基金合同生效后 3 年期内，在利众 A 的非开放日（ $t$  日），设  $t_a$  为自利众 A 上一次开放日（如  $t$  日之前利众 A 尚未进行开放，则为基金合同生效日）至  $t$  日的运作天数， $NV_t$  为  $t$  日闭市后的基金资产净值， $F_{at}$  为  $t$  日利众 A 的份额余额， $NAV_a$  为  $t$  日利众 A 的基金份额参考净值， $r$  为在利众 A 上一次开放日（如  $t$  日之前利众 A 尚未进行开放，则为基金成立日）设定的利众 A 的年收益率。

（1）如果  $t$  日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00 元乘以  $t$  日利众 A 的份额余额加上  $t$  日全部利众 A 份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{at} = 1.00 \times \left( 1 + \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times t_a \right)$$

“t 日全部利众 A 份额应计收益”计算公式如下：

$$t \text{ 日全部利众 A 份额应计收益} = F_{at} \times 1.00 \times \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times t_a \quad (\text{下同})$$

以上各式中，运作当年实际天数指利众 A 上一次开放日（如 t 日之前利众 A 尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

(2) 如果 t 日闭市后的基金资产净值小于“1.00 元乘以 t 日利众 A 的份额余额加上 t 日全部利众 A 份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{at} = \frac{NV_t}{F_{at}}$$

## 2、利众 B 的基金份额参考净值计算

设 NAV<sub>bt</sub> 为 t 日利众 B 的基金份额参考净值，F<sub>bt</sub> 为 t 日利众 B 的份额余额，利众 B 的基金份额参考净值计算公式如下：

$$NAV_{bt} = \frac{NV_t - NAV_{at} \times F_{at}}{F_{bt}}$$

利众 A、利众 B 的基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

t 日的利众 A 和利众 B 的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 t+1 日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

## （七）利众 A 与利众 B 开放日基金份额净值的计算

### 1、利众 A 开放日基金份额净值的计算

本基金基金合同生效后，截止利众 A 的某一开放日或者利众 B 的封闭期届满日（T 日），设 T<sub>a</sub> 为自利众 A 上一次开放日（如 T 日之前利众 A 尚未进行开放，则为基金成立日）至 T 日的运作天数，N<sub>T</sub> 为 T 日闭市后的基金资产净值，F<sub>aT</sub> 为 T 日利众 A 的份额余额，NAV<sub>aT</sub> 为 T 日利众 A 的基金份额净值，r 为在利众 A 上一次开放日（如 T 日之前利众 A 尚未进行开放，则为基金成立日）设定的利众 A 的年收益率。

(1) 如果 T 日闭市后的基金资产净值大于或等于“1.00 元乘以 T 日利众 A 的份额余额加上 T 日全部利众 A 份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{aT} = 1.00 \times \left( 1 + \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a \right)$$

“T 日全部利众 A 份额应计收益”计算公式如下：

$$T \text{ 日全部利众 A 份额应计收益} = F_{aT} \times 1.00 \times \frac{r}{\text{运作当年实际天数}} \times T_a \quad (\text{下同})$$

以上各式中，运作当年实际天数指利众 A 上一次开放日（如 T 日之前利众 A 尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数，下同。

(2) 如果 T 日闭市后的基金资产净值小于“1.00 元乘以 T 日利众 A 的份额余额加上 T 日全部利众 A 份额应计收益之和”，则：

$$NAV_{aT} = \frac{NV_T}{F_{aT}}$$

## 2、利众 B 的基金份额净值计算

设 NAV<sub>bT</sub> 为 T 日利众 B 的基金份额净值，F<sub>bT</sub> 为 T 日利众 B 的份额余额，利众 B 的基金份额净值计算公式如下：

$$NAV_{bT} = \frac{NV_T - NAV_{aT} \times F_{aT}}{F_{bT}}$$

利众 A、利众 B 的基金份额净值的计算，保留到小数点后 8 位，小数点后第 9 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## (八) 利众 A 与利众 B 基金份额净值的公告

本基金基金合同生效后 3 年期内，在利众 A 的非开放日，本基金将公告利众 A 和利众 B 的基金份额参考净值；在利众 A 的开放日，本基金将公告利众 A 的基金份额净值和利众 B 的基金份额参考净值。

在利众 B 的 3 年封闭期届满日，本基金将公告利众 A 和利众 B 的基金份额净值。

## 七、利众 A 的基金份额折算

本基金基金合同生效之日起 3 年内，基金管理人可在利众 A 的折算基准日按以

下规则进行基金份额折算。

### （一）折算对象

基金份额折算基准日登记在册的所有利众A份额。

### （二）折算基准日

本基金基金合同生效之日起3年内利众A的基金份额折算基准日（T日）与其开放日为同一天工作日，原则上为自基金合同成立之日起每满6个月的最后一个工作日。（利众A的开放日以及开放办理申购与赎回业务的具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准）。基金份额折算基准日（T日）的具体计算（主要涉及到折算基准日（T日）折算前利众A基金份额净值的计算）见基金合同中“四、基金份额的分级”中有关利众A的运作方式的相关内容。

### （三）折算频率

自基金合同生效之日起3年内，每满6个月的基金份额折算基准日折算一次。

### （四）具体折算方法

折算基准日日终，利众A的基金份额净值调整为1.0000元，折算后，基金份额持有人持有的利众A的份额数按照折算比例相应增减。

利众A的基金份额折算公式为：

利众A的折算比例 = 折算基准日(T日)折算前利众A的基金份额净值 / 1.0000

利众A折算后的份额数 = 折算前利众A的份额数 × 利众A的折算比例

利众A折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算基准日折算前利众A的基金份额净值、利众A的折算比例的具体计算方法详见基金管理人届时发布的相关公告。

### （五）基金份额折算期间的基金业务办理

为保证基金份额折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停利众B的上市交易等

业务，详见基金管理人届时发布的相关公告。

## （六）基金份额折算的公告

1、基金管理人须最迟于基金份额折算方案实施日前2日，在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

2、基金管理人应在基金份额折算结束后2日内，在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

## 八、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市交易

本基金基金合同生效后，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，利众B的基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

本基金基金合同生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）份额后的基金份额经深圳证券交易所批准后将在深圳证券交易所上市交易。

### （二）上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

利众B上市后，登记在证券登记结算系统中的利众B份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的利众B份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

本基金基金合同生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）份额后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

### （三）上市交易的时间

利众B已于2013年4月26日开始在深圳证券交易所上市交易（场内简称：利众B，代码：150102），并于2016年2月4日终止上市。



本基金基金合同生效后 3 年期届满，本基金按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转换为上市开放式基金（LOF）份额。本基金将自转换为上市开放式基金（LOF）之日起 45 日内开始在深圳证券交易所上市交易。

利众（LOF）（场内简称：长信利众，代码：163005）于 2016 年 3 月 11 日开始在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易时间后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。

#### （四）上市交易的规则

- 1、利众 B 上市首日的开盘参考价为其前一工作日的基金份额参考净值；
- 2、本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金上市首日的开盘参考价为前一个工作日的基金份额净值；
- 3、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，自上市首日起实行；
- 4、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍；
- 5、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币；
- 6、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

#### （五）上市交易的费用

本基金（本基金基金合同生效之日起 3 年内，指利众 B）上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

#### （六）上市交易的行情揭示

本基金（本基金基金合同生效之日起 3 年内，指利众 B）在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值（本基金基金合同生效之日起 3 年内，为利众 B 的基金份额参考净值）。

#### （七）上市交易的停复牌与暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金（本基金基金合同生效之日起3年内，指利众B）的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

利众B于2016年2月4日终止上市。

（八）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 九、三年期届满基金的转换

### （一）三年期届满后基金的存续形式

本基金基金合同生效后3年期届满，无需召开基金份额持有人大会自动转换为上市开放式基金（LOF），本基金名称变更为“长信利众债券型证券投资基金（LOF）”。利众A、利众B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。2016年6月24日，本基金在原基金份额基础之上对基金份额进行分类，原有长信利众债券型证券投资基金（LOF）基金份额为C类份额，并增设A类份额。

本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。新增的利众（LOF）A类基金份额仅开通场外申赎，不开通场内申赎，且不进行上市交易。

### （二）三年期届满基金转换时利众A的处理方式

本基金基金合同生效后3年期届满日，利众A份额的基金份额持有人可选择将持有的份额赎回、或转入“长信利众债券型证券投资基金（LOF）”。若投资者不做选择，其持有的利众A份额将被默认转入“长信利众债券型证券投资基金（LOF）”份额。

本基金基金合同生效后3年期届满日前，基金管理人将提前公告并提示利众A的基金份额持有人作出选择申请，利众A的基金份额持有人可在届时公告规定的时间内按照公告规定的方式作出选择申请。

本基金基金合同生效后3年期届满日，基金份额持有人持有的利众B份额将直接转换为“长信利众债券型证券投资基金（LOF）”份额。

### （三）三年期届满基金份额的转换规则

#### 1、份额转换基准日

本基金的份额转换基准日为基金合同生效后3年期届满日，即本基金基金合同生效之日起3年后的对应日，如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

#### 2、份额转换方式

在份额转换基准日，本基金转换成上市开放式基金（LOF）后的基金份额净值调整为1.0000元。在份额转换基准日日终，以份额转换后1.0000元的基金份额净值为基准，利众A、利众B按照各自的基金份额净值转换成上市开放式基金（LOF）份额。

本基金的份额转换计算公式：

利众A份额（或利众B份额）的转换比率=份额转换基准日利众A（或利众B）的基金份额净值/1.0000

利众A（或利众B）基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金（LOF）份额=基金份额持有人持有的转换前利众A（或利众B）的份额数×利众A份额（或利众B份额）的转换比率

在进行份额转换时，利众A、利众B的场外份额将转换成上市开放式基金（LOF）场外份额，且均登记在注册登记系统下；利众B的场内份额将转换成上市开放式基金（LOF）场内份额，仍登记在证券登记结算系统下。

在实施基金份额转换时，利众A份额（或利众B份额）的转换比率、利众A（或利众B）基金份额持有人持有的转换后上市开放式基金（LOF）份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 3、份额转换后的基金运作

利众A、利众B的份额全部转换为上市开放式基金（LOF）份额之日起45日内，本基金将开始上市交易，并接受场外与场内申购和赎回。份额转换后本基金上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 4、份额转换的公告

（1）在本基金基金合同生效后 3 年期届满日前 30 个工作日，基金管理人将就本基金进行基金转换的相关事宜进行提示性公告。

（2）本基金基金合同生效后 3 年期届满时，本基金将转换为上市开放式基金（LOF），基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金转换的相关事宜进行公告，并报中国证监会备案；

（3）利众A、利众B进行份额转换后，基金管理人应在指定媒体公告，并报中国证监会备案。

#### （四）三年期届满基金转换后的投资管理

本基金基金合同生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，本基金的投资目标、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等保持不变。

#### （五）特殊情况下基金份额的转换

本基金基金合同生效之日起 3 年内，利众 A、利众 B 的基金份额持有人可以通过基金份额持有人大会申请转换基金的运作方式，基金份额持有人大会的具体召开方式参见基金合同中“基金份额持有人大会”部分。上述“转换时利众 A 的处理方式、基金份额的转换规则及基金转换后的投资管理”也同样适用于本情况下基金份额的转换。

### 十、基金的投资目标

本基金的投资目标是在严格控制投资风险与追求基金资产稳定增值的前提下，力争为各级投资者谋求与其风险公正匹配的投资回报。

### 十一、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，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据、中小企业私募债券以及法律、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的相关规定）。

本基金主要投资于国内依法发行上市的国债、金融债、公司债、企业债、次

级债、短期融资券、政府机构债、央行票据、银行同业存款、回购、可转债、资产证券化产品、中期票据、中小企业私募债券等固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证及因投资可分离债券而产生的权证等非固定收益类品种。

基金的投资组合比例为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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

## 十二、基金的投资策略

本基金A、B两级虽然分别募集及申购、赎回，但两级资金将融合一起来进行投资管理。

本基金根据对宏观经济、宏观调控政策走向以及各类资产市场风险收益特征及其演变趋势的综合分析、比较，首先采用类属配置策略进行大类资产的配置，在此基础上，再根据对各类资产风险收益特征的进一步分析预测，制定各自策略。

### 1、类属资产配置策略

本基金根据对宏观经济、货币、财政政策走向以及各类资产的风险来源、收益率水平、利息税务处理和市场流动性等因素的综合分析，将市场细分为普通债券（含国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券等）、附权债券（含可转换公司债、各类附权债券等）、资产证券化产品、新股申购四个子市场，采取积极投资策略，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权数，力求在较低风险下获得较高组合收益。

### 2、普通债券投资策略

本基金根据自上而下和自下而上的分析方法对宏观经济和债券市场的走势做出分析。

自上而下：通过对基本面和资金面的分析对债券市场走势做出判断，以作为确定组合久期大小的依据。主要根据中长期的宏观经济走势和经济周期性特征，

对收益率的未来变化趋势做出判断，从而对组合久期进行动态调整，以获取稳健的超越市场的投资收益。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，我们将缩短组合久期，以本金安全为主要策略；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，我们将增加组合久期，以获取更高的票息和价差收益。

自下而上：通过对个券的分析来选择投资品种。主要根据各品种的收益率、流动性和信用风险等指标，挑选被市场低估的品种。在严控风险的前提下，获取稳定的收益。在确定债券组合久期之后，本基金将通过对不同信用类别债券的收益率基差分析，结合税收差异、信用风险分析、期权定价分析、利差分析以及交易所流动性分析，判断个券的投资价值，以挑选风险收益相匹配的券种，建立具体的个券组合。

本基金具体的普通债券投资策略主要有骑乘策略、息差策略及利差策略等。

#### （1）骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。骑乘策略的关键影响因素是收益率曲线的陡峭程度。若收益率曲线较为陡峭，则随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会有较大下滑，进而获得较高的资本利得。

#### （2）息差策略

息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

#### （3）利差策略

利差策略是指对两个期限相近的债券的利差进行分析，从而对利差水平的未来走势做出判断，进而相应地进行债券置换。影响两期限相近债券的利差水平的因素主要有息票因素、流动性因素及信用评级因素等。当预期利差水平缩小时，

可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

### 3、附权债券投资策略

#### （1）可转换公司债券投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征。本基金利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债品种。本基金利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的安全性；本基金利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。

在选择可转换债券品种时，本基金将与本公司的股票投研团队积极合作，深入研究，力求选择被市场低估的品种，来构建本基金可转换债券的投资组合。

#### （2）其它附权债券投资策略

分离交易可转换公司债券，是认股权证和公司债券的组合产品，该产品中的公司债券和认股权证可在上市后分别交易，即发行时是组合在一起的，而上市后则自动拆分成公司债券和认股权证。一方面，本基金因认购分离交易可转换公司债券所获得的认股权证可以择时卖出或行使新股认购权；另一方面，分离交易可转换公司债券上市后分离出的公司债券的投资按照普通债券投资策略进行管理。

### 4、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券，是未上市中小微型企业以非公开方式发行的债券，其采取备案制发行，对于发行人没有净资产和盈利能力的门槛要求，是完全市场化的信用债券品种。

从国内债券市场发展来看，普通投资策略绝大部分都是建立在对利率风险的判断基础上；中小企业私募债券由于单只规模较小、收益率接近 10% 的水平、期限在 1-3 年内等特征，提供了非常好的构建分散化、持有到期的投资组合。本基金在构建债券投资组合时将降低对利率风险的关注度，通过个券精选、分散化配置，加强对信用风险的控制和管理，即以控制信用风险、持有到期为主的投资策

略。

#### 5、资产证券化产品投资策略

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

#### 6、新股申购策略

本基金将在审慎原则下参与一级市场新股与增发新股的申购。通过研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素，分析新股内在价值、市场溢价率、中签率和申购机会成本等综合评估申购收益率，从而制定相应的申购策略以及择时卖出策略。

### 十三、基金的业绩比较基准

#### 1、本基金的业绩比较基准

中债综合（全价）指数。

#### 2、选择业绩比较基准的理由

中债综合（全价）指数由在沪深证券交易所及银行间市场上市的国债、金融债、企业债、央行票据、及企业短期融资券所构成，该类人民币债券均为投资级以上，其剩余期限大于一个月，且付息方式均为固定利率付息和一次还本付息。中债综合指数样本每月调整一次，符合上述基本条件的债券自下个月第一个交易日起计入指数；不合格债券将在每月最后一个交易日被剔除。

由于本基金为债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具，并以为投资者创造持续稳健投资收益为目标，因此以中债综合指数作为本基金的业绩比较基准能比较贴切体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

若未来市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告。



#### 十四、基金的风险收益特征

总体上，本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

利众 A 级为低风险、收益稳定的基金份额；利众 B 级为较高风险、较高收益的基金份额。

#### 十五、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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定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 2017 年 6 月 30 日（摘自本基金 2017 年 2 季报），本报告中所列财务数据未经审计。

##### （一）报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,611,377,116.62 | 97.38        |
|    | 其中：债券             | 1,611,377,116.62 | 97.38        |
|    | 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      | 6,305,997.47     | 0.38         |
| 8  | 其他资产              | 37,047,725.04    | 2.24         |
| 9  | 合计                | 1,654,730,839.13 | 100.00       |

注：本基金本报告期末未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

本基金本报告期末未持有股票。

### 2、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## （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

本基金报告期末未持有股票。

## （四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 158,517,000.00   | 12.32        |
|    | 其中：政策性金融债 | 158,517,000.00   | 12.32        |
| 4  | 企业债券      | 1,334,841,561.82 | 103.73       |
| 5  | 企业短期融资券   | 40,107,000.00    | 3.12         |
| 6  | 中期票据      | 77,789,000.00    | 6.04         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 122,554.80       | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,611,377,116.62 | 125.21       |

## （五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 170210  | 17国开10  | 1,000,000 | 98,750,000.00 | 7.67 |
| 2 | 1580025 | 15宜春创投债 | 500,000   | 51,195,000.00 | 3.98 |
| 3 | 1380388 | 13河池债   | 600,000   | 50,832,000.00 | 3.95 |
| 4 | 170401  | 17农发01  | 500,000   | 49,810,000.00 | 3.87 |
| 5 | 1580329 | 15津东债   | 500,000   | 48,450,000.00 | 3.76 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**2、本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**1、本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### （十一）投资组合报告附注

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

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

#### 3、其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 21,515.69     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 36,313,656.17 |
| 5  | 应收申购款   | 712,553.18    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 37,047,725.04 |

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 113008 | 电气转债 | 122,554.80 | 0.01         |

#### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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。

## 十六、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

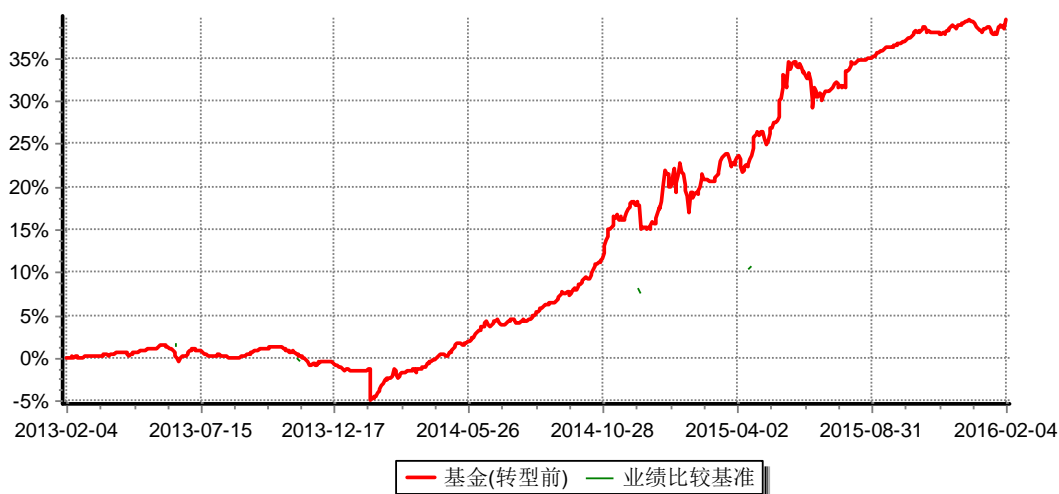
现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### （一）基金净值表现（转型前）

#### 1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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   |
|--------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2013年2月4日（基金合同生效日）至2013年12月31日 | -1.40% | 0.11%     | -4.19%     | 0.09%         | 2.79%  | 0.02% |
| 2014年1月1日-2014年12月31日          | 19.95% | 0.36%     | 6.54%      | 0.11%         | 13.41% | 0.25% |
| 2015年1月1日-2015年1月31日           | 17.66% | 0.48%     | 4.19%      | 0.08%         | 13.47% | 0.40% |
| 2016年1月1日-2016年2月4日            | -1.57% | 0.32%     | -0.07%     | 0.10%         | -1.50% | 0.22% |

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



注：1、本基金基金合同生效日为2013年2月4日，图示日期为2013年2月4日至2016年2月4日

（转型前）；

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，本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。

## （二）基金净值表现（转型后）

### 1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

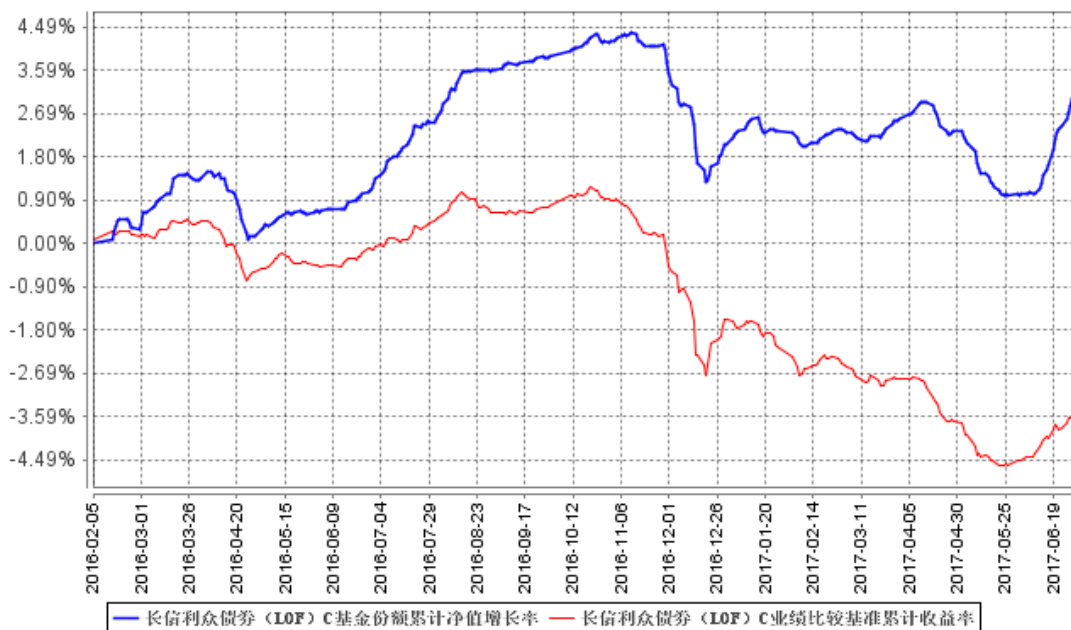
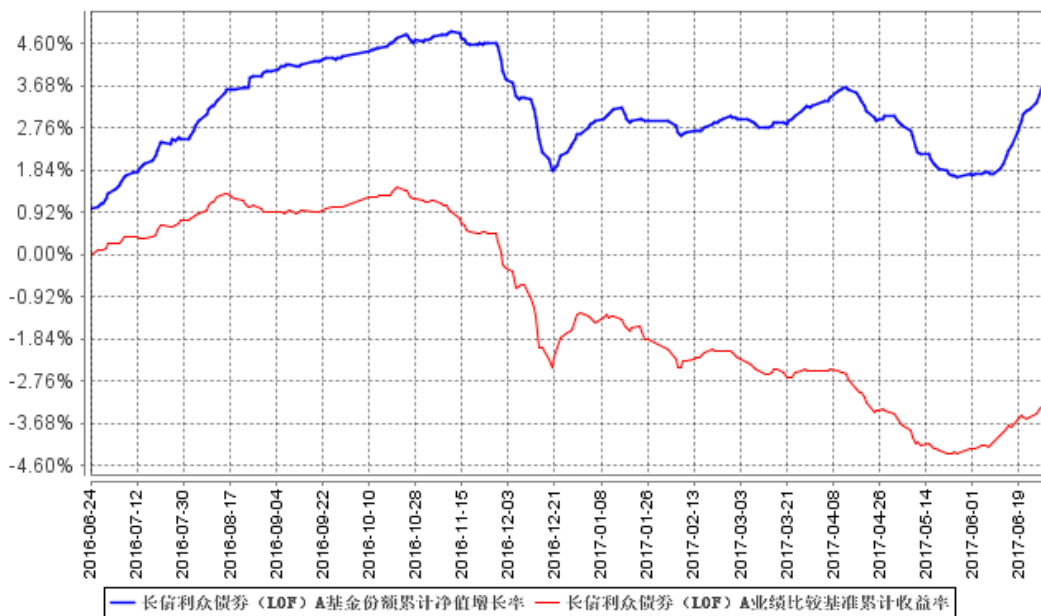
长信利众债券（LOF）A

| 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6月24日（份额增加日）至2016年12月31日 | 2.63%  | 0.10%     | -1.24%     | 0.11%         | 3.87% | -0.01% |
| 2017年1月1日-2017年3月31日          | 0.60%  | 0.05%     | -1.24%     | 0.07%         | 1.84% | -0.02% |
| 2017年4月1日-2017年6月30日          | 0.56%  | 0.10%     | -0.88%     | 0.08%         | 1.44% | 0.02%  |

长信利众债券（LOF）C

| 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2月5日（转型起始日）至2016年12月31日 | 2.06%  | 0.09%     | -1.57%     | 0.11%         | 3.63% | -0.02% |
| 2017年1月1日-2017年3月31日         | 0.52%  | 0.05%     | -1.24%     | 0.07%         | 1.76% | -0.02% |
| 2017年4月1日-2017年6月30日         | 0.46%  | 0.10%     | -0.88%     | 0.08%         | 1.34% | 0.02%  |

### 2、自基金转型/份额增加日以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、自2016年6月24日起对长信利众债券型证券投资基金（LOF）进行份额分类，原有基金份额为C类份额，增设A类份额。

2、本基金转型起始日为2016年2月5日，长信利众债券（LOF）A图示日期为2016年6月24日（份额增加日）至2017年6月30日，长信利众债券（LOF）C图示日期为2016年2月5日至2017年6月30日。

3、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，本基金基金合同生效日为2013年2月4日，转型起始日为2016年2月5日，转型后的投资范围及投资比例与转型前一致，转型后本基金的各项投资比例符合基金合同约定的各项投资范围及比例要求。

## 十七、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、基金销售服务费；
  - 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
  - 5、基金份额持有人大会费用；
  - 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
  - 7、基金的证券交易费用；
  - 8、基金的银行汇划费用；
  - 9、基金的上市交易费用；
  - 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

### （三）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

本基金年管理费率为年费率 0.70%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，



支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

## 2、基金托管人的托管费

本基金年托管费率为年费率 0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

## 3、基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

本基金利众（LOF）A 类基金份额不收取销售服务费，利众（LOF）C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。。

利众（LOF）C 类基金份额的基金销售服务费按前一日利众（LOF）C 类基金资产净值 0.35%的年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为利众（LOF）C 类每日应计提的基金销售服务费

E 为利众（LOF）C 类前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

4、上述（一）中第 4 到第 9 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，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。

#### **（四）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。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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

#### **（五）基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整**

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和基金托管费率。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；降低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率的，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体刊登公告。

#### **（六）其他费用**

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关法律法规的规定进行公告或备案。

#### **（七）基金税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

#### **（八）与基金销售有关的费用**

##### **（1）申购、赎回费用**

基金合同生效后三年期届满转为 LOF 基金后的申购、赎回费率

在基金合同生效后三年期届满转为 LOF 基金并对基金份额进行分类后，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额两种。利众（LOF）A 类在申购时收取

申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费；利众（LOF）C类不收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费。本基金的赎回费用由基金赎回人承担。本基金的赎回费率最高不超过5%。现将相关申购、赎回费率列示如下：

### 1) 利众（LOF）A类

在基金合同生效后三年期届满转为LOF基金后，利众（LOF）A类仅开通场外申赎，不开通场内申赎，具体申购、赎回费率如下：

#### A、申购费率

| 单笔申购金额（M，含申购费）      | 申购费率      |
|---------------------|-----------|
| M < 100 万元          | 0.8%      |
| 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.5%      |
| M ≥ 500 万元          | 每笔 1000 元 |

注：M为申购金额

#### B、赎回费率

| 持有期限（Y）         | 赎回费率  |
|-----------------|-------|
| Y < 3 个月        | 0.3%  |
| 3 个月 ≤ Y < 6 个月 | 0.15% |
| 6 个月 ≤ Y < 1 年  | 0.1%  |
| Y ≥ 1 年         | 0     |

### 2) 利众（LOF）C类：

#### A、场内赎回费率

在基金合同生效后三年期届满转为LOF基金后，利众（LOF）C类场内赎回费率为固定0.10%；

#### B、场外赎回费率

本基金在基金合同生效后三年期届满转为LOF基金后，利众（LOF）C类场外赎回费率如下表所示：

| 持有期限           | 赎回费率  |
|----------------|-------|
| 90 天以内         | 0.10% |
| 90 天以上（含 90 天） | 0     |

基金合同生效后三年期届满，由原有利众A、利众B份额转为利众（LOF）C类的场外份额不收取赎回费，由原有利众A、利众B份额转为利众（LOF）C类的

场内份额赎回费率为固定 0.10%。

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的 25%

## （2）转换费用与计算方式

本公司在直销柜台和直销网上交易开通了长信利众债券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）之间的相互转换业务。具体业务信息详见本公司相关公告。

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

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

### 2、转换份额的计算公式：

#### （1）货币基金转至非货币基金

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值 + 转出份额对应的未结转收益

补差费 = 转出份额 × 转出基金份额净值 × 补差费率 ÷ (1 + 补差费率)

转入确认金额 = 转出确认金额 - 补差费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 转入基金份额净值

（货币基金份额净值为 1.00 元，没有赎回费）

#### （2）非货币基金转至货币基金

转出确认金额 = 转出份额 × 转出基金份额净值

赎回费 = 转出确认金额 × 赎回费率

转入确认金额 = 转出确认金额 - 赎回费

转入确认份额 = 转入确认金额 ÷ 货币基金份额净值

（货币基金份额净值为 1.00 元，补差费为零）

## 十八、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，对基金管理人股权结构、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，更新了托管人信息；
- 3、在“五、相关服务机构”部分，更新部分代销机构信息以及会计事务所信息；
- 4、在“十四、基金的投资组合报告、十五、基金的业绩”部分，根据最近一期投资组合报告的内容和基金的投资业绩更新了相关的信息；
- 5、在“十、基金份额的申购与赎回”部分，更新了基金转换信息；
- 6、在“二十七、其它应披露的事项”部分，更新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

二〇一七年九月十六日