长信利息收益开放式证券投资基金

更新的招募说明书

2023 年第【1】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

二〇二三年十一月

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。

本更新的招募说明书所载的内容截止日为2023年10月31日（其中基金管理人章节的信息截止日为2023年11月29日）。有关财务数据和净值截止日为2023年9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。

目 录

一、绪　言 4
二、释　义 5
三、基金管理人 9
四、基金托管人 22
五、相关服务机构 25
六、基金的募集 40
七、基金合同的生效 41
八、基金的申购、赎回与转换 42
九、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押 56
十、基金的投资 57
十一、基金的业绩 71
十二、基金的财产 75
十三、基金资产的估值 76
十四、基金的收益与分配 81
十五、基金费用与税收 80
十六、基金的会计与审计 86
十七、基金的信息披露 87
十八、风险揭示 91
十九、基金的终止与基金财产清算 95
二十、基金合同的内容摘要 97
二十一、基金托管协议的内容摘要 110
二十二、对基金份额持有人的服务 115
二十三、招募说明书存放及查阅方式 118
二十四、其他应披露的事项 119
二十五、备查文件 120

一、绪　言

长信利息收益开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）由长信基金管理有限责任公司依据《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》及有关法律法规、中国证监会发布的有关规定、《长信利息收益开放式证券投资基金基金契约》（现修改为《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》，以下简称“基金合同”）依法设立。

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施＜货币市场基金监督管理办法＞有关问题的规定》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）、《基金合同》及其他有关规定编写。

本《招募说明书》阐述了长信利息收益开放式证券投资基金的投资目标、投资理念、投资策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假内容、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本《招募说明书》所载明资料申请发行的。基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本《招募说明书》做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释　义

在《长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书》中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

释　义	
本合同、《基金合同》	指《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》及对本合同的任何修订和补充
中国	指中华人民共和国（就本合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》
《流动性风险规定》	指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
上海证交所《业务规则》	指2005年7月14日上海证券交易所发布并于2005年7月14日起施行的《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》
元	指中国法定货币人民币元
基金或本基金	指依据《基金合同》所设立的长信利息开放式证券投资基金
招募说明书	指《长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书》，一份公开披露本基金管理人及托管人、相关服务机构、基金的募集、基金合同的生效、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的业绩、基金的财产、基金资产的估值、基金收益与分配、基金的费用与税收、基金的会计与审计、基金的信息披露、风险揭示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其更新
发售公告	指《长信利息收益开放式证券投资基金基金份额发售公告》
业务规则	指《长信基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
基金管理人或本基金管理人、本公司	指长信基金管理有限责任公司
基金托管人	指中国农业银行股份有限公司
基金销售代理人	指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构，以及可通过上海证券交易所系统办理销售服务业务的会员单位
会员单位	指具有开放式基金代销资格经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的，可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上

	海证券交易所会员单位
销售机构	指基金管理人及基金销售代理人
基金销售网点	指基金管理人的直销中心及基金销售代理人的代销网点
注册业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册登记机构	指中国证券登记结算有限责任公司
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有权部门批准设立的机构
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金达到法律规定及基金合同规定的基金备案条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续，获得中国证监会书面确认之日
募集期	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月
基金存续期	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指日常申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购或发售	指本基金在募集期内投资者购买本基金份额的行为
日常申购	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
日常赎回	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理
场外或柜台	指不通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所
场内或交易所	指通过上海证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所
基金账户	指基金注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的凭证
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务
基金转换	指投资者将其所持有的本基金管理人管理的任一开放式基金向本基金管理人提出申请将其原有基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为本基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者

	指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金收益	指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
基金资产总值	指基金所拥有的所有资产（包括各类短期金融工具、银行存款和其他资产等）的价值总和
基金日收益	指每万份基金份额的日收益
基金 7 日年化收益率（%）	指以基金资产最近 7 日收益所折算的年资产收益率
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值、基金日收益和基金 7 日年化收益率
指定媒介	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
基金产品资料概要	指《长信利息收益开放式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。关于基金产品资料概要编制、披露与更新的要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行
不可抗力	指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易
销售服务费	也称基金销售与持有人服务费，主要用于支付销售机构佣金以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等，该笔费用从各级基金份额的基金财产中扣除，属于基金的营运费用
基金份额等级	指本基金根据投资者持有本基金的基金份额数量所设定的不同等级。本基金对投资者持有的基金份额按等级适用不同的销售服务费费率，并分别公布各级基金份额的每万份基金净收益和基金七日年化收益率
基金份额的升级	指当投资者在单个基金帐户保留的某级基金份额达到上一级基金份额的最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资者在该基金帐户保留的该级基金份额全部升级为上一级基金份额
基金份额的降级	指当投资者在单个基金帐户保留的某级基金份额不能满足该级基金份额最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资者在该基金帐户保留的该级基金份额全部降级为下一级基金份额
基金代码	A 级份额基金代码为 519999；B 级份额基金代码为：519998
摊余成本法	指计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益
影子定价	为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以

	上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

三、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、37 楼、38 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		
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	刘元瑞		
电话	021-61009999		
传真	021-61009800		
联系人	魏明东		
存续期间	持续经营		
经营范围	基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】		
股权结构	**股东名称**	**出资额**	**出资比例**
	长江证券股份有限公司	7350 万元	44.55%
	上海海欣集团股份有限公司	5149.5 万元	31.21%
	武汉钢铁有限公司	2500.5 万元	15.15%
	上海彤胜投资管理中心（有限合伙）	751 万元	4.55%
	上海彤骏投资管理中心（有限合伙）	749 万元	4.54%
	总计	16500 万元	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人的董事会成员情况

董事会成员			
姓名	**职务**	**性别**	**简历**
刘元瑞	董事长	男	中共党员，硕士，现任长信基金管理有限责任公司董事长、长江证券股份有限公司党委副书记、总裁、董事。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管，长江证券承销保荐有限公司总裁助理，长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。
任晓威	非独立董事	男	中共党员，学士，现任上海海欣集团股份有限公司总裁兼董秘，上海金欣联合发展有限公司董事长，上海东华海欣纺织科技发展有限公司董事长，苏中药业集团股份有限公司董事，泰州苏中企业管理有限公司董事，长信基金管理有限责任公司董事。曾任国开曹妃甸投资有限公司助理总经理及营运总监、国开吉林投资有限公司副总经

			理兼财务总监，中国新城镇发展有限公司（HK1278）执行董事、副总裁兼上海公司（上海金罗店开发有限公司）董事长，上海海欣集团股份有限公司副总裁（代为履行总裁职责）等职。
李 钊	非独立董事	男	硕士，现任中国宝武钢铁集团有限公司产业金融运营管理总监，历任上海宝钢集团公司财务部协理及管理师、宝山钢铁股份有限公司财务部主任管理师、宝钢集团有限公司经营财务部经理及高级经理、宝钢集团有限公司首席会计师、中国宝武钢铁集团有限公司首席会计师。兼任华宝证券股份有限公司监事、华宝资本有限公司监事、央企信用保障基金理事。
覃 波	非独立董事	男	中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。
徐志刚	独立董事	男	中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业（集团）有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询（上海）有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。
刘 斐	独立董事	女	中共党员，工商管理硕士。曾任上海国际集团旗下私募股权投资基金管理公司—上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理、创始合伙人，浦银安盛基金管理有限公司总经理、董事（浦银安盛创始人），上海东新国际投资管理有限公司总经理、董事（浦发银行与新鸿基合资组建的养老金投资管理公司），浦发银行办公室负责人。
闫立	独立董事	男	中共党员，博士研究生。曾任吉林省长春市公安局民警，中共吉林省委政法委主任科员，吉林省青少年犯罪研究所所长、研究员，上海政法管理干部学院、上海大学法学院副院长、二级教授、博士研究生导师，上海政法学院副院长、二级教授、博士研究生导师，上海政法学院终身教授、二级教授、博士研究生导师。
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**
赵雍	监事会主	男	中共党员，管理学学士，国际注册内部审计师、审

	席		计师、管理咨询师，现任中国宝武钢铁集团有限公司巡视办、审计部 巡视工作（综合管理）处长。历任宝钢集团有限公司综合审计管理员、宝钢集团有限公司经营审计管理师、宝钢集团有限公司经营审计专员、宝钢集团有限公司经营审计高级专员、中国宝武钢铁集团有限公司经营审计高级专员、中国宝武钢铁集团有限公司派出子公司监事管理处长。目前兼任宁波宝新不锈钢有限公司监事会主席、宝钢德盛不锈钢有限公司监事、中联先进钢铁材料技术有限责任公司监事。
李世英	监事	女	民革党员，硕士。现任长江证券股份有限公司财务总部总经理；兼任长江证券承销保荐有限公司、长江证券(上海)资产管理有限公司、长江成长资本投咨有限公司、长江证券创新投资(湖北)有限公司、长江期货股份有限公司和长江证券国际金融集团有限公司董事、湖北省武汉市江汉区第十六届人大代表，中南财经政法大学工商管理学院 MBA 教育中心硕士研究生合作导师。曾任长江三峡实业开发公司财务部出纳、会计；长江证券股份有限公司国际业务总部会计兼行政岗，投资银行总部财务部经理、财务总部核算部副经理，大鹏证券托管工作组财务管理岗，重庆营业部财务经理岗，财务总部财务管理岗、核算管理岗、副总经理，资本市场部副总经理，长江成长资本投资有限公司首席财务官。
王鹏	监事	男	工学博士，中共党员，高级经济师，金融风险管理师（FRM），湖南省湖湘青年英才。现任湖南财信金融控股集团有限公司机关第一党支部书记、集团风控合规部副总经理。兼任湖南省征信有限公司监事、湖南财信商业保理有限公司监事。历任中国人民财产保险股份有限公司信用保证保险事业部主管，吉祥人寿保险股份有限公司资产管理部信用评估室经理助理，财信吉祥人寿保险股份有限公司资产管理部信用评估室副经理、资产管理部总经理助理兼信用评估室经理等职。
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综合行政部总监。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监、零售服务部总监。
孙红辉	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。
魏明东	监事	男	中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司人力资源部副总监。曾任上海市徐汇区文化局（现为上海市徐汇区文化和旅游局）科员、华夏证券股份有限公司人事主管，国泰基金管理有限公司人力资源副经理、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。
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。曾任长江证券有限责任公司（现长江证券股份有限公司）武汉自治街营业部总经理，中南证券营业部副总经理，深圳燕南路证券营业部副总经理，彭刘杨路营业部总经理兼自治街证券营业部总经理，经纪事业部副总经理，北方总部副总经理兼北京展览路证券营业部总经理，北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，经纪业务总部副总经理，经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任，经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、经纪业务总部产品推广部经理，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。
邓　挺	副总经理	男	经济学、法学双学士，毕业于中南财经政法大学，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。曾任富国基金管理有限公司渠道经理、高级渠道经理、华东营销中心渠道总监、华中营销中心总经理，长信基金管理有限责任公司机构业务部总监、保险业务部总监、总经理助理。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

4、基金经理

本基金基金经理情况			
姓名	**职务**	**任职时间**	**简历**
陆莹	现金理财部副总监、基金经理	2016 年 12 月 30 日至今	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、现金理财部总监、先后于 2018 年 8 月至 2019 年 10 月担任长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、2017 年 1 月至 2019 年 11 月担任长信纯债半年债券型证券投资基金的基金经理、2017 年 11 月至 2020 年 9 月担任长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、

			2019 年 11 月至 2022 年 2 月担任长信易进混合型证券投资基金的基金经理、2017 年 1 月至 2022 年 2 月担任长信稳健纯债债券型证券投资基金的基金经理、2019 年 9 月至 2022 年 2 月担任长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、2020 年 6 月至 2022 年 3 月担任长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。现任现金理财部副总监、2016 年 12 月至今担任长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理、2017 年 9 月至今担任长信长金通货币市场基金的基金经理、2018 年 1 月至今担任长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、2020 年 8 月至今担任长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、2021 年 9 月至今担任长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理。
钱进	基金经理	2021 年 10 月 28 日至 2023 年 9 月 15 日	曾任本基金的基金经理。
段博卿	基金经理	2019 年 11 月 29 日至 2021 年 4 月 15 日	曾任本基金的基金经理。
张文琍	基金经理	2013 年 8 月 8 日至 2019 年 9 月 23 日	曾任本基金的基金经理。
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。
张文琍	基金经理	2005 年 11 月 26 日至 2011 年 6 月 4 日	曾任本基金的基金经理。
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 2005 年 11 月 26 日	曾任本基金的基金经理。
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。
注：上述人员之间均不存在近亲属关系			

5、投资决策委员会成员

投资决策委员会成员	
姓名	**职务**
覃波	总经理、投资决策委员会主任委员
李家春	公司总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金和长信稳健成长混合型证券投资基金的基金经理
高远	研究发展部总监、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金和长信均衡优选混合型证券投资基金的基金经理
张文琍	固收多策略部副总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理
陆莹	现金理财部副总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理
叶松	总经理助理、绝对收益部总监兼权益投资部总监兼养老 FOF 投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金和长信先锐混合型证券投资基金的基金经理
傅瑶纯	国际业务部总监、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理
左金保	总经理助理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金和长信汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理
涂世涛	量化专户投资部总监兼投资经理
蔡军华	固收研究部总监
陈言午	专户投资部总监兼投资经理
宋海岸	量化研究部总监、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理
冯彬	固收多策略部总监、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金和长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理
崔飞燕	固收专户投资部总监兼投资经理

注：上述人员之间均不存在近亲属关系

（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、股票交易部、债券交易部、基金事务部、营销管理部、信息技术部、监察稽核部、综合行政部、人力资源部、国际业务部、战略与产品研发部、电子商务部、财务管理部、专户投资部、固收专户投资部、量化专户投资部、绝对收益部、养老 FOF 投资部、券商业务部、培训部、固收多策略部、现金理财部、集团业务部、量化研究部、固收研究部、营销服务部、资产配置研究部、机构服务部
分支机构	北京分公司、深圳分公司、武汉分公司、沈阳分公司
员工总数	244 人（截至 2023 年 11 月 29 日）

（四）基金管理人的职责

基金管理人应当履行下列职责：

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金日收益以及基金 7 日年化收益率；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

（五）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》及有关法律法规的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止以基金财产从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）不公平地对待基金管理人管理的不同基金财产；

（7）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

3、基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规、规章及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

（1）越权或违规经营；

（2）违反基金合同或托管协议；

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

（4）在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（8）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（9）违反证券交易场所业务规则，利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（10）贬损同行，以提高自己；

（11）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（12）以不正当手段谋求业务发展；

（13）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（14）其他法律、行政法规禁止的行为。

5、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（六）基金管理人的内部控制制度

基金管理人高度重视内部风险控制，建立了完善的风险管理体系和控制体系，从制度上保障本基金的规范运作。

1、公司内部控制的总体目标

（1）保证公司经营管理活动的合法合规性；

（2）保证基金份额持有人的合法权益不受侵犯；

（3）实现公司稳健、持续发展、维护股东权益；

（4）促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

2、内部控制制度遵循的原则

（1）合法合规性原则：公司内部控制制度应当符合国家法律法规和各项规定。

（2）全面性原则：内部控制制度应当覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一位员工。

（3）有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行，内部控制制度应当具有高度的权威性，任何员工不得拥有超越制度约束的权利。

（4）独立性原则：公司在精简的基础上设立能够充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立。公司固有财产、基金财产和其他财产的运作应当分离。

（5）相互制约原则：公司内部机构、部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

（6）防火墙原则：公司基金投资、交易、研究策划、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应当制定严格的审批程序和监管措施。

（7）审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

（8）适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

（9）成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

（10）保持与业务发展的同等地位原则：公司的发展必须建立在风险控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司业务发展放在同等地位上。

（11）定性和定量相结合原则： 建立完备风险控制指标体系， 使风险控制更具客观性和操作性。

3、内部风险控制体系结构

公司内控体系由以下不同层面构成。公司董事会、经营管理层（包括督察长）、内部控制委员会、监察稽核部及公司其他部门、各岗位在各自职责范围内承担风险控制责任。

（1）董事会：全面负责公司的风险控制工作，对建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；

（2）经营管理层：负责日常经营管理中的风险控制工作，对内部控制制度的有效执行承担责任；督察长：负责对公司内部管理、资产运作以及经营管理层、内部各部门、各岗位执行制度及遵纪守法情况进行监督和检查，并对公司内部风险控制制度的合法性、合规性、合理性进行评价；

（3）内部控制委员会：协助经营管理层负责公司风险控制工作，主要负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制定相应的控制制度，协调处理突发性重大事件或危机事件。内部控制委员会由公司总经理、副总经理、监察稽核部总监、基金事务部总监、市场开发部总监和部分从事内部控制方面的业务骨干组成；

（4）监察稽核部：负责检查评价公司内部控制制度的合法性、合规性、完备性、有效性以及执行情况；对公司经营业务和基金运作情况进行日常稽核；对各部门、各岗位、各项业务的风险控制情况实施全面的监督检查，并及时报告检查结果。监察稽核部独立行使检查权并对经营管理层负责；

（5）业务部门和公司各岗位：公司业务部门根据公司各项基本管理制度，结合部门具体情况制定本部门的管理办法和实施细则，加强对各项业务和各业务环节的风险控制；公司各岗位：根据岗位职责和业务操作流程，按业务授权规范操作，严格控制操作风险。

4、内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的内部风险控制制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成，按照其效力大小分为四个层面：

第一个层面是公司章程。

第二个层面是公司内部控制大纲，它是公司自定各项规章制度的基础和依据，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

第三个层面是公司基本管理制度，它包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、人力资源制度、业绩评估考核制度和危机处理制度，等等。

第四个层面是公司各部门业务规章、实施细则等。部门业务规章、实施细则是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

5、内部风险管理体系

基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规性风险以及不可抗力风险。

针对上述各种风险，基金管理人建立了一套完整的风险管理程序，具体包括以下内容：

（1）投资风险管理；

（2）交易风险管理；

（3）巨额赎回风险管理；

（4）基金注册登记风险管理；

（5）基金核算风险管理；

（6）市场开发风险管理；

（7）信息披露风险管理；

（8）不可抗力风险管理。

6、风险管理和内部控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度：建立、健全了行之有效的内控制度，确保各项业务活动都有适当的授权和明确的分工，确保监察稽核活动的独立性、权威性；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立了明确的岗位分离制度，做到研究、决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，同时进行空间隔离，建立防火墙，充分保证信息的隔离和保密，从制度上降低和防范风险；

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每位员工都明确自己的任务、职责，及时上报各自工作领域中发现的风险隐患，以防范和化解风险；

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了内部控制委员会，使用适合的程序和方法，确认和评估公司经营管理和基金运作中的风险；建立自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策，减少风险造成的损失；

（5）建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如计算机预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，不断提高员工素质和职业技能，防范和化解风险。

7、基金管理人关于内部合规控制声明书

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制。

四、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：谷澍

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

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 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：秦一楠

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”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号；2020 年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”；2021 年荣获全国银行间同业拆借中心首次设立的“银行间本币市场优秀托管行”奖；2022 年在权威杂志《财资》年度评选中首次荣获“中国最佳保险托管银行”。

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，目前内设风险合规部/综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、系统与信息管理部、营运管理部、营运一部、营运二部，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近 283 名，其中具有高级职称的专家 60 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 2023 年 9 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 831 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。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1	**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、37 楼、38 楼	
	法定代表人：刘元瑞	联系人：顾洵
	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：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座	
	法定代表人：谷澍	联系人：林葛
	电话：010-66060069	传真：010-68121816
	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：田国立	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：上海市浦东新区银城中路 188 号	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号	
	法定代表人：任德奇	联系人：高天
	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：缪建民	联系人：季平伟
	电话：0755-83198888	传真：0755-83195109
	客户服务电话：95555	网址：www.cmbchina.com
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：郑杨	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：高迎欣	联系人：罗菲菲
	电话：010-58560666	传真：010-58560666
	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：林军	联系人：孔文超
	电话：023-63799379	传真：023-63792412
	客户服务电话：956023	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：李民吉	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：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 号武汉商业银行大厦	
	法定代表人：刘波	联系人：张晓欢
	电话：027-82656924	传真：027-82656099
	客户服务电话：96558（武汉）；40060-96558（全国）	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：宋剑斌	联系人：严峻
	电话：0571-85108195	传真：0571-85106576
	客户服务电话：95398，400-8888-508	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：谢永林	联系人：赵杨
	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：姚志萍	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：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	
	办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	
	法定代表人：黄炎勋	联系人：陈剑虹
	电话：0755-82558305	传真：0755-28558355
	客户服务电话：95517	网址：http://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：王军	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：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号	
	办公地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号	
	法定代表人：金才玖	联系人：奚博宇
	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：郭岩	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	德邦证券股份有限公司	
	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：武晓春	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：吴礼顺	联系人：单晶
	电话：0755-23838750	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：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦	
	办公地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦,上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 3-6 层,12 层,13 层,22 层,25-27 层,29 层,32 层,36 层,38 层	
	法定代表人：金文忠	联系人：龚玉君
	电话：021-63325888-2103	传真：021-6332 6130
	客户服务电话：021-63325888	网址：www.dfzq.com.cn
20	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.dwjq.com.cn
21	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：刘秋明	联系人：龚俊涛
	电话：021-22169999	传真：021-22169134
	客户服务电话：95525	网址：www.ebscn.com
22	中信证券华南股份有限公司	
	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：陈可可	联系人：梁微
	电话：020-88836999	传真：020-88836654
	客户服务电话：95548	网址：www.gzs.com.cn
23	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：苏军良	联系人：张腾
	电话：0591-87383623	传真：0591-87383610
	客户服务电话：95547	网址：www.hfzq.com.cn

24	广发证券股份有限公司	
	注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室	
	办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦	
	法定代表人：林传辉	联系人：马梦洁
	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
25	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：翁振杰	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
26	国金证券股份有限公司	
	注册地址：成都市东城根上街 95 号	
	办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号	
	法定代表人：冉云	联系人：杜晶、贾鹏
	电话：028-86690057、028-86690058	传真：028-86690126
	客户服务电话：95310	网址：www.gjzq.com.cn
27	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：葛小波	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
28	国盛证券有限责任公司	
	注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号	
	办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼	
	法定代表人：徐丽峰	联系人：占文驰
	电话：0791-88250812	传真：0791-86281443
	客户服务电话：956080	网址： www.gszq.com
29	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：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦	
	法人代表人：贺青	联系人：朱雅崴
	电话：021-38676666	传真：021-38670666
	客户服务热线：95521/4008888666	网址：www.gtja.com

30	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：张纳沙	联系人：于智勇
	电话：0755-81981259	传真：0755-82133952
	客户服务电话：95536	网址：www.guosen.com.cn
31	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：周杰	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
32	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：章宏韬	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
33	华宝证券股份有限公司	
	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：刘加海	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
34	华龙证券股份有限公司	
	注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼	
	办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼	
	法定代表人：祁建邦	联系人：范坤
	电话：0931-4890208	传真：0931-4890628
	客户服务电话：95368、4006898888	网址：www.hlzq.com
35	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：张伟	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
36	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：赵洪波	联系人：高悦铭
	电话：0451-82336863	传真：0451-82287211
	客户服务电话：400-666-2288	网址：www.jhzq.com.cn
37	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：丛中	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
38	平安证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	
	办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）	
	法定代表人：何之江	联系人：王阳
	电话：0755-22626391	传真：0755-82400862
	客户服务电话：95511—8	网址：www.stock.pingan.com
39	中泰证券股份有限公司	
	注册地址：济南市市中区经七路 86 号	
	办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号	
	法定代表人：王洪	联系人：秦雨晴
	电话：021-20315197	传真：021-20315125
	客户服务电话：95538	网址：www.zts.com.cn
40	上海证券有限责任公司	
	注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼	
	办公地址：上海市西藏中路 336 号	
	法定代表人：何伟	联系人：许曼华
	电话：021-53686888	传真：021-53686100-7008、021-53686200-7008
	客户服务电话：4008918918	网址：www.shzq.com
41	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 号世纪商贸广场 45 层	
	法定代表人：杨玉成	联系人：陈宇
	电话：021-33388999	传真：021-33388224
	客户服务电话：95523；4008895523	网址：www.swhysc.com
42	申万宏源西部证券有限公司	
	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	

	办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	
	法定代表人：王献军	联系人：梁丽
	电话：0991-2307105	传真：010-88085195
	客户服务电话：95523；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：中国湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 48 层	
	法定代表人：余磊	联系人：程晓英
	电话：18064091773	传真：027-87618863
	客服电话：95391 或 400-800-5000	网址：www.tfzq.com
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：谭磊
	电话：010-66045182	传真：010-66045518
	客户服务电话：010-66045678	网址：www.txsec.com
45	湘财证券股份有限公司	
	注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	
	办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	
	法定代表人：高振营	联系人：江恩前
	电话：021-50295432	传真：021-68865680
	客户服务电话：95351	网址：www.xcsc.com
46	国融证券股份有限公司	
	注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼	
	办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层	
	法定代表人：张智河	联系人：叶密林
	电话：010-83991719	传真：010-66412537
	客户服务电话：95385	网址：www.grzq.com
47	兴业证券股份有限公司	
	注册地址：福州市湖东路 268 号	
	办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号	
	法定代表人：杨华辉	联系人：乔琳雪
	电话：021-38565547	
	客户服务电话：95562	网址：www.xyzq.com.cn
48	招商证券股份有限公司	
	注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号	
	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：霍达	联系人：业清扬
	电话：0755-82943666	传真：0755-82943121
	客户服务电话：95565 或 0755-95565	网址：www.cmschina.com
49	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
50	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：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦	
	法定代表人：陈亮	联系人：辛国政
	电话：010-80928123	
	客户服务电话：4008-888-888 或 95551	网址：www.chinastock.com.cn
51	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
52	中信期货有限公司	
	注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层	
	办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层	
	法定代表人：窦长宏	联系人：洪成
	电话：0755-23953913	传真：0755-83217421
	客户服务电话：4009908826	网址：www.citicsf.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：张佑君	联系人：侯艳红
	电话：010-60838888	传真：010-60833739
	客户服务电话：95548；400-889-5548	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 1 号楼 2001	
	办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层	
	法定代表人：肖海峰	联系人：焦刚

	电话：0531-89606166	传真：0532-85022605
	客户服务电话：95548	网址：http://sd.citics.com/
55	中山证券有限责任公司	
	注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层	
	办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层	
	法定代表人：李永湖	联系人：罗艺琳
	电话：0755-82943755	传真：0755-82960582
	客户服务电话：95329	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：祝瑞敏	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：吴坚	联系人：周青
	电话：023-63786633	传真：023-67616310
	客服热线：95355、4008096096	网址：www.swsc.com.cn
58	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	
	注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室	
	办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场 B 座 6 楼	
	法定代表人：祖国明	联系人：韩爱彬
	电话：0571-81137494	传真：4000-766-123
	客户服务电话：4000-766-123	网址：www.fund123.cn
59	上海长量基金销售有限公司	
	注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	
	办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层	
	法定代表人：张跃伟	联系人：马良婷
	电话：021-20691832	传真：021-20691861
	客户服务电话：400-820-2899	网址：www.erichfund.com
60	诺亚正行基金销售有限公司	
	注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室	
	办公地址：上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼	
	法定代表人：吴卫国	联系人：李娟
	电话：021-38602377	传真：021-38509777
	客户服务电话：400-821-5399	网址：www.noah-fund.com

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：陶怡	联系人：徐超逸
	电话：021-20613988	传真：021-68596916
	客户服务电话：4007009665	网址：www.ehowbuy.com
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 1002 室	
	办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	
	法定代表人：章知方	联系人：陈慧慧
	电话：010-85657353	传真：010-65884788
	客户服务电话：400-920-0022	网址：www.licaike.hexun.com
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：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦	
	法定代表人：其实	联系人：余强萍
	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（北京）基金销售有限公司	
	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：胡雄征	联系人：程刚
	电话：010-52855713	传真：010-85894285
	客户服务电话；400-6099-200	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：杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼 4 层	
	法定代表人：吴强	联系人：吴强
	电话：952555	传真：0571-86800423
	客户服务电话：952555	公司网站：www.5ifund.com
66	上海汇付基金销售有限公司	
	注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元	
	办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋	
	法定代表人：金佶	联系人：甄宝林
	电话：021-34013996-3011	
	客户服务电话：021-34013999	网址：www.hotjijin.com
67	上海陆金所基金销售有限公司	

	注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元	
	办公地址：上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼	
	法定代表人：陈祎彬	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	上海联泰基金销售有限公司	
	注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室	
	办公地址：上海市虹口区临潼路 188 号	
	法定代表人：尹彬彬	联系人：陈东
	电话：021-52822063	传真：021-52975270
	客户服务电话：400-118-1188	网址：www.66liantai.com
69	海银基金销售有限公司	
	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼	
	法定代表人：孙亚超	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
70	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
71	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：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层	
	法定代表人：李兴春	联系人：陈孜明
	电话：18516109631	传真：86-021-61101630
	客户服务电话：400-032-5885	网站：www.leadfund.com.cn
72	珠海盈米基金销售有限公司	
	注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室	
	办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 层	
	法定代表人：肖雯	联系人：邱湘湘
	电话：020-89629099	传真：020-89629011
	客户服务电话：020-89629066	网站：www.yingmi.cn
73	北京汇成基金销售有限公司	
	注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号	
	办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层	

	法定代表人：王伟刚	联系人：丁向坤
	电话：010-56282140	传真：010-62680827
	客户服务电话：400-619-9059	网站：www.hcfunds.com
74	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：毛淮平	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
75	长江期货股份有限公司	
	注册地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层	
	办公地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层	
	法定代表人：潘山	联系人：史萍
	电话：027-65261377	传真：027-85860103
	客户服务电话：027-85861133	网站：www.cjfco.com.cn
76	和谐保险销售有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区东三环中路 55 号楼 20 层 2302	
	办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 6 号安邦金融中心	
	法定代表人：刘正吉	联系人：张楠
	电话：010-85256214	
	客户服务电话：4008195569	网站：www.hx-sales.com
77	一路财富（深圳）基金销售有限公司	
	注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道兴海大道 3046 号香江金融大厦 2111	
	办公地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208	
	法定代表人：吴雪秀	联系人：徐越
	电话：010-88312877-8032	传真：010-88312099
	客户服务电话：400-001-1566	网站：www.yilucaifu.com
78	嘉实财富管理有限公司	
	注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元	
	办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 11 层	
	法定代表人：张峰	联系人：王宫
	电话：021-38789658	传真：021-68880023
	客户服务电话：400-600-8800	网站：www.jsfund.cn
79	北京雪球基金销售有限公司	
	注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室	
	办公地址：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层	
	法定代表人：李楠	联系人：吴迪
	电话：010-57319532	

	客户服务电话：400-1599-288	网站：www.danjuanfunds.com
80	上海基煜基金销售有限公司	
	注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）	
	办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室	
	法定代表人：王翔	联系人：张巍婧
	电话：021-65370077-255	传真：021-55085991
	客户服务电话：400-820-5369	网站：www.jiyufund.com.cn
81	开源证券股份有限公司	
	注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
	办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层	
	法定代表人：李刚	联系人：袁伟涛
	电话：029-88447611	传真：029-88447611
	客户服务电话：95325 或 400-860-8866	网站：www.kysec.cn
82	浙江网商银行股份有限公司	
	注册地址：浙江杭州市西湖区学院路 28 号德力西大厦 12-15 层	
	办公地址：浙江杭州市西湖区学院路 28 号德力西大厦 12-15 层	
	法定代表人：金晓龙	联系人：周玉霞
	电话：13600544572	
	客户服务电话：95188-3	网站：www.mybank.cn
83	江苏汇林保大基金销售有限公司	
	注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号	
	办公地址：南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室	
	法定代表人：吴言林	联系人：林伊灵
	电话：025-66046166（分机号转 810）	传真：025-53086966
	客户服务电话：025-66046166 转 849	网站：www.huilinbd.com
84	华鑫证券有限责任公司	
	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元	
	办公地址：上海市徐汇区宛平南路 8 号	
	法定代表人：俞洋	联系人：杨莉娟
	电话：021-54967552	传真：021-54967293
	客户服务电话：95323	网站：www.cfsc.com.cn
85	民商基金销售（上海）有限公司	
	注册地址：上海市黄埔区北京东陆 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室	
	办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼	
	法定代表人：贲惠琴	联系人：林志枫
	电话：15626219801	传真：021-50206001
	客户服务电话：021-50206003	网站：www.msftec.com

86	北京中植基金销售有限公司	
	注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室	
	办公地址：北京朝阳区大望路金地中心 A 座 28 层	
	法定代表人：武建华	联系人：丛瑞丰
	电话：010-59313555	传真：010-56642623
	客户服务电话：400-8180-888	网址：http://www.zzfund.com
1	**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，并在基金管理人网站公示。

（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	非直销渠道：中国证券登记结算有限责任公司	直销渠道：长信基金管理有限责任公司	上海源泰律师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室	上海市浦东新区世纪大道 100 号 50 楼
法定代表人	周明	刘元瑞	廖海（负责人）	毛鞍宁
联系电话	010-59378856	021-61009999	021-51150298	021-22282551
传真	010-59378907	021-61009800	021-51150398	021-22280071
联系人	崔巍	孙红辉	廖海、刘佳	王珊珊（王珊珊、夏秉雯为经办注册会计师）

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定、并经中国证券监督管理委员会《关于同意长信利息收益开放式证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2003】149 号文)核准募集。

本基金为契约型开放式基金，基金存续期为不定期。

本基金募集期自 2004 年 2 月 16 日至 2004 年 3 月 15 日。募集对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者。

本基金的面值为每份基金份额人民币 1.00 元。

七、基金合同的生效

（一）根据《基金法》、《运作办法》和基金合同的有关规定，本基金符合基金合同生效的条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，本基金基金合同于 2004 年 3 月 19 日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

（二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

在基金的存续期间内，本基金的基金份额持有人数量不满 200 人，或基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并提出解决方案。存续期间内，本基金的基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人有权利宣布基金合同终止。法律法规另有规定的，从其规定办理。

八、基金的申购、赎回与转换

（一）申购和赎回办理的场所

基金的申购、赎回将通过基金管理人的直销中心、基金代销机构的代销网点以及上海证券交易所证券交易系统办理申购、赎回及相关业务的上海证券交易所会员单位进行。

本基金直销中心、代销机构、场内销售机构的名称、住所或办公地址、联系人及电话、传真的具体内容详见本基金招募说明书“五、相关服务机构”。

基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

在条件成熟时，投资者可通过基金管理人或者指定的基金代销机构以电话或互联网等形式进行申购、赎回。

（二）申购与赎回办理的时间

1、开放日及开放时间

基金的开放日是指为投资者办理基金申购、赎回等业务的证券交易所交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。

若出现证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并公告。

2、申购、赎回的开始时间及业务办理时间

基金管理人已于 2004 年 3 月 19 日发布本基金日常申购、赎回公告，本基金自 2004 年 3 月 22 日开始办理申购、赎回。本基金日常申购和赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间，如各销售机构办理时间有所不同，请参照各销售机构的规定。

基金管理人已于 2011 年 12 月 16 日发布《关于长信利息收益开放式证券投资基金开通在上海证券交易所场内系统办理申购赎回业务的公告》，自 2011 年 12 月 19 日起，本基金可通过上证所开放式基金销售系统（以下简称“上证所场内系统”）办理申购、赎回业务。

本基金 A、B 等级基金份额在场外系统申购赎回的基金代码分别为 519999、519998，在上证所场内系统申购赎回的基金代码分别为 519599、519598，敬请投资者注意场外场内代码的差异。

（三）申购与赎回的原则

1、“确定价”原则，即申购、赎回基金的份额以 1 元人民币为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、投资者在全部赎回基金份额时，基金管理人自动将待支付的投资者收益一并结算并与赎回款一起支付给投资者；投资者部分赎回基金份额时，如其该笔赎回完成后剩余的基金份额按照 1 元人民币为基准计算的价值不足以弥补其赎回日的基金收益负值时，则以账户现有份额为有效数量进行确认；

4、当日的申购、赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前按规定在指定媒介予以公告。

（四）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金代销机构规定的书面方式或其他方式，在开放日的交易时间段内提出申购和赎回的申请。

投资者申购基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2、申购或赎回申请的确认

基金管理人应以在基金申购或赎回的交易时间段内收到申购或赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），并在 T+1 工作日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 工作日或之后到其提出申购或赎回申请的网点进行成交查询。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回款按有关规定自成交确认日起 1 个工作日内从基金托管账户划出。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照《基金合同》有关条款处理。

自 2013 年 6 月 21 日起，本基金在基金管理人“长金通”网上直销平台开通“T+0 快速赎回”业务。具体详见基金管理人已于 2013 年 6 月 19 日公开披露的《长信基金管理有限责任公司关于开通网上直销“T+0 快速赎回”业务的公告》；2013 年 6 月 21 日公开披露的《长信基金管理有限责任公司关于开通货币基金网上直销“T+0 快速赎回”业务调整的公告》；2013 年 10 月 31 日公开披露的《长信基金管理有限责任公司关于调整货币基金网上直销“T+0 快速赎回”业务规则的公告》和 2013 年 12 月 27 日公开披露的《长信基金管理有限责任公司关于延长货币基金网上直销“T+0 快速赎回”业务交易时间的公告》。

（五）申购和赎回的数额限制

1、申购基金的金额

自 2014 年 5 月 15 日起，投资者通过场外申购时，本基金的申购起点金额调整为人民币 0.01 元，即投资者首次申购长信利息收益基金的单笔最低金额为人民币 0.01 元，追加申购的单笔最低金额为人民币 0.01 元；超过最低申购金额的部分不设金额级差。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台申购本基金遵循上述规则；各基金代理销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理申购业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

投资者通过上海证券交易所场内申购时，每笔申购金额最低为人民币 100 元（含申购费），同时每笔申购必须是 100 元的整数倍。

投资者当期分配的基金收益转为基金份额时，不受追加申购最低金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、申请赎回基金的份额

自 2014 年 5 月 15 日起，投资者通过场外赎回时，本基金的最低赎回份额调整为 0.01 份，即投资者可将其全部或部分基金份额赎回，赎回的最低份额为 0.01 份。投资者通过本公司直销柜台及网上直销平台赎回本基金遵循上述规则；各基金代理销售机构有不同规定的，投资者在该销售机构办理赎回业务时，需同时遵循销售机构的相关业务规定。

投资者最低持有份额为 100 份，投资者当日持有份额减少导致在销售机构同一交易账户保留的基金份额不足 100 份的，注册登记机构将全部剩余份额自动赎回。

投资者通过场内赎回时，单笔赎回的基金份额为 1 份的整数倍。

3、为了保护基金份额持有人的合法权益，基金管理人可以依照相关法律法规以及基金合同的约定，在特定市场条件下暂停或者拒绝接受一定金额以上的资金申购，具体以基金管理人的公告为准。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的程序、数额以及基金交易账户保有最低基金份额限制，但应最迟在调整生效前按规定在指定媒介公告。

（六）基金的申购费和赎回费

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

（1）本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于 5%且偏离度为负时。

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

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

（七）基金申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

申购份额=申购金额/基金份额净值

申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入。例：某投资者申购金额为 1 万元，当日基金份额净值是 1.00 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=10000/1.00＝10000 份

即：投资者申购金额为 1 万元，当日基金份额净值是 1.00 元，则其可得到

的申购份额为 10000 份。

申购金额	申购费率	净申购金额	申购费用	基金份额净值	申购份数
10,000 元	0	10,000 元	0 元	1.000 元	10,000 份

2、赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的赎回费用，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，小数点两位后的部分四舍五入。

赎回金额=基金份额净值×赎回份额-赎回费用

例：某投资者赎回 1 万份基金份额，未超过当日基金总份额的 1%，赎回当日基金份额净值是 1.00 元，赎回费用为 0 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回金额=10000×1.00-0＝10000 元

即：投资者赎回本基金 1 万份基金份额，未超过当日基金总份额的 1%，赎回当日基金份额净值是 1.00 元，则其可得到的赎回金额为 10000 元。

赎回份额	赎回费率	赎回总额	赎回费用	赎回当日基金份额净值	赎回金额
10,000 元	0	10,000 元	0 元	1.000 元	10,000 份

3、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式，但应最迟在新的公式适用前按规定予以公告。

（八）申购和赎回的注册登记

1、基金投资者提出的申购或赎回申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

2、投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 工作日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 工作日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 工作日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前按规定予以公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

若单个开放日内的本基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一日该基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况对于赎回申请决定全额赎回或者部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于该基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占该基金赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确做出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。投资者在提出赎回申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

（3）本基金发生巨额赎回时，对单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额 20%以上的赎回申请，基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动的，基金管理人有权对该基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 20%以上的那部分赎回申请进行延期办理；对该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（4）当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真、电话或在基金代销机构网点发布公告等方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时通过指定媒介予以公告。

（5）本基金连续两日以上（含两日）发生巨额赎回时，即为连续巨额赎回。

发生连续巨额赎回时，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已

经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

3、为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额 10%的，基金管理人可对其采取延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的措施。

（十）拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理

1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2）证券交易场所在交易时间非正常停市；

（3）基金财产规模过大，使相应的基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（4）当基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

（5）基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

（6）接受某笔或者某些申购申请可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时；

（7）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取暂停接受基金申购申请的措施；

（8）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

当本基金影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内，并根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。

如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

（1）拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；

（2）拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；

（3）按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请：

（1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；

（2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致基金的现金支付出现困难、有损于现有基金份额持有人的利益或可能会对基金资产净值造成较大波动时；

（4）单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额的 1%时；

（5）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

（6）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应按规定立即向中国证监会备案，并按规定编制临时报告书，在指定媒介上予以公告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付时，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分由基金管理人按照相应的处理办法在后续开放日予以兑付。

3、发生本基金影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%的情形时，基金管理人有权选择暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算。基金管理人应当在实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，但无需召开基金份额持有人大会审议。

4、发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。

5、基金暂停申购、赎回，基金管理人应按规定在指定媒介上公告：

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日在指定媒介刊登基金重新开放申购、赎回的公告，并公告最近 1 个开放日的基金日收益和基金 7 日年化收益率。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应按规定在指定媒介刊登基金重新开放申购、赎回的公告，并公告最近 1 个开放日的基金日收益和基金 7 日年化收益率。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购、赎回时，基金管理人应按规定在指定媒介连续刊登基金重新开放申购、赎回的公告，并公告最近 1 个开放日的基金日收益和基金 7 日年化收益率。

（十一）基金的转换

1、基金转换受理时间

投资者可在基金开放日申请办理基金转换业务，具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间相同。

2、转换份额的计算公式：

（1）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）

（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)

3、基金转换规则

（1）基金转换只能在同一销售机构办理，转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金。

（2）基金转换采取未知价法，即以申请受理当日各转出、转入基金的单位资产净值为基础进行计算。

（3）基金转换遵循“份额转换”的原则，转换申请份额精确到小数点后两位，单笔转换申请份额不得低于 0.01 份。

（4）当日的基金转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

（5)本公司已开通了长信利息收益货币基金 A、B 级份额(A 级代码:519999；B 级代码：519998）(非直销渠道)与长信银利精选混合基金 A 类前端份额（A 类前端代码:519997)、长信低碳环保量化股票基金 A 类份额(A 类代码:004925)、长信增利动态混合基金（前端代码：519993）、长信金利趋势混合基金 A 类前端份额（A 类前端代码：519995）、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、长信利丰债券基金 C 类份额（C 类代码：519989）、长信恒利优势混合基金、长信双利优选混合基金 A 类份额（A 类代码：519991）、长信量化先锋混合基金 A 类份额（A 类代码：519983）、长信内需成长混合基金 A 类份额（A 类代码：519979）、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金 A 类份额（A 类代码：519967）、长信量化多策略股票基金 A 类份额（A 类代码：519965）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金(非直销渠道)、长信多利混合基金 A 类份额（A 类代码：519959）、长信睿进混合基金、长信利保债券基金 A 类份额（A 类代码：519947）、长信利泰混合基金 A 类份额（A 类代码：519951）、长信利泰混合基金 C 类份额（C 类代码：007863）、长信先锐混合基金 A 类份额（A 类代码：519937)、长信利发债券基金、长信电子信息量化混合基金 A 类份额(A 类代码：519929）、长信利信混合基金 A 类份额（A 类代码：519949）、长信先优债券基金 A 类份额(A 类代码：004885)、长信中证 500 指数基金 A 类份额(A 类代码：004945）、长信乐信混合基金(非直销渠道)、长信创新驱动股票基金、长信利率债债券基金、长信消费精选股票基金 A 类份额（A 类代码：004805）(非直销渠道)和长信价值优选混合基金之间的双向转换；长信银利精选混合基金（后端代码：519996）、长信金利趋势混合基金（后端代码：519994）、长信增利动态策略混合基金（后端代码：519992）可转换转入长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级别代码：519999；B 级代码：519998）；长信利息收益货币基金 A、B 级

份额（A 级别代码：519999；B 级代码：519998）暂不能转换转入长信银利精选混合基金（后端代码：519996）、长信金利趋势混合基金（后端代码：519994）、长信增利动态策略混合基金（后端代码：519992），具体开通时间另行公告。

本公司已开通了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）(直销渠道) 与长信长金通货币基金 A、B 级份额（A 类代码：005134；B 类代码：005135）、长信沪深 300 指数基金、长信国防军工量化混合基金、长信利信混合基金 C 类份额（C 类代码：007293）、长信利信混合基金 E 类份额（E 类代码：007294）、长信稳益纯债债券基金、长信稳势纯债债券基金、长信纯债壹号债券基金 C 类份额（C 类代码：004220）、长信乐信混合基金（直销渠道）、长信量化先锋混合基金 C 类份额（C 类代码：004221）、长信利丰债券基金 A 类份额（A 类代码：005991）、长信利丰债券基金 E 类份额（E 类代码：004651）、长信消费精选量化股票基金 A 类份额（A 类代码：004805）（直销渠道）、长信量化多策略股票基金 C 类份额（C 类代码：004858）、长信稳健纯债债券基金、长信双利优选混合基金 E 类份额（E 类代码：006396）、长信内需成长混合基金 E 类份额（E 类代码：006397）、长信易进混合基金、长信利保债券基金 C 类份额（C 类代码：008176）、长信利泰混合基金 E 类份额（E 类代码：008071）、长信利广混合基金(直销渠道)、长信量化价值驱动混合基金、长信稳健精选混合基金、长信消费升级混合基金、长信优质企业混合基金、长信内需均衡混合基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合基金、长信 30 天滚动持有短债债券基金、长信稳丰债券基金、长信稳惠债券基金、长信低碳环保量化股票基金 C 类份额（C 类代码：013151）、长信中证 500 指数基金 C 类份额（C 类代码：013881）、长信消费精选量化股票基金 C 类份额（C 类代码：013152）、长信电子信息量化混合基金 C 类份额（C 类代码：013153）、长信医疗保健混合（LOF）基金 C 类份额（C 类代码：013154）、长信多利混合基金 C 类份额（C 类代码：013488）、长信利富债券基金 C 类份额（C 类代码：013558）、长信银利精选混合基金 C 类份额（C 类代码：014572）、长信金利趋势混合基金 C 类份额（C 类代码：015039）、长信先进装备三个月持有混合基金、长信企业优选一年持有混合基金、长信稳健成长混合基金、长信稳航 30 天持有中短债债券基金、长信稳恒债券基金、长信中证科创创业 50 指数增强基金、长信稳健增长一年持有混合基金、长信中证 1000 指数增强基金、长信均衡优选混合基金、长信 90 天滚动持

有债券型证券投资基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

投资人可将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）(直销渠道)转换至长信企业成长三年持有混合基金、长信均衡策略一年持有混合基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

（6）发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认（另有公告的除外）；在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延。

（7）投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态。

（8）转换费用实行内扣法收取，基金转换费用由基金份额持有人承担。

（9）基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应最迟在新的原则实施前三个工作日予以公告。

4、基金转换的注册登记

（1）基金份额持有人的基金转换成功后，基金注册登记机构在 T+1 工作日为基金份额持有人申请进行确认，确认成功后为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。

（2）基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前按规定予以公告。

5、基金转换费率

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。

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按规定在中国证监会指定媒介上公告。

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。

（十二）基金份额的分级

为了满足投资者的理财需求，本基金自 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费分级收费方式，单个基金账户保留的本基金份额低于 500 万份的享受 A 级基金份额的收益，单个基金账户保留的本基金份额达到或超过 500 万份的享受 B 级基金份额的收益。两级基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。A 级基金份额的基金代码为 519999(与代码合并前的前端代码相同)，新设 B 级基金份额的基金代码为 519998（与代码合并前的后端代码相同）。如未特别说明，长信利息收益基金指长信利息收益基金的 A、B 级基金，包含 A 级和 B 级份额。根据投资者持有本基金的份额划分 A、B 等级并适用不同的销售服务费率。基金份额分级标准以及各级基金份额适用的费率如下：

类别	A 级基金份额（519999）	B 级基金份额（519998）
分级标准 (单个基金账户保留的基金份额)	＜500 万份	≥500 万份
管理费率(年费率)	0.33%	0.33%
托管费率(年费率)	0.08%	0.08%
销售服务费率(年费率)	0.25%	0.01%

注：基金管理人可以调整本基金的分级标准和各级基金份额的销售服务费年费率，基金管理人应在变更前依照相关法律法规的规定报中国证监会备案后并在指定媒介上公告。

（十三）基金份额的升级和降级

当投资者在单个基金账户保留的某级基金份额达到上一级基金份额的最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资者在该基金账户保留的该级基金份额全部升级为上一级基金份额。

当投资者在单个基金账户保留的某级基金份额不能满足该级基金份额最低份额要求时，基金的注册登记机构自动将投资者在该基金账户保留的该级基金份额全部降级为下一级基金份额。

在投资者持有的某级基金份额满足升降级条件后，基金的注册登记机构自动为其办理升降级业务，投资者持有的基金份额在升降级业务办理后的当日按照新的基金份额等级享有基金收益。如果注册登记机构在 T 日对投资者持有的基金份额进行了升降级处理，那么投资者在该日对升降级前的基金份额提交的赎回、转换出和转托管等交易申请将被确认失败，基金管理人不承担由此造成的一切损失。从 T＋1 日起，投资者可以正常提交上述交易申请。基金份额升降级的相关规则由基金管理人制定。

本公司于 2019 年 2 月 23 日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金取消基金份额升降级业务的公告》，自 2019 年 2 月 25 日起（含 2019 年 2 月 25 日）取消本公司长信利息收益开放式证券投资基金（A 类基金份额场外代码 519999，场内代码 519599；B 类基金份额场外代码 519998，场内代码 519598，以下简称“本基金”）基金份额的升降级业务。

九、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

（一）基金注册登记机构只受理继承、捐赠、强制执行等情况下的非交易过户。其中：

1、继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人或受遗赠人继承。

2、捐赠仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

3、强制执行是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

（二）办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，非交易过户直接向基金注册登记机构统一申请办理。

（三）符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，在注册登记机构规定的时间内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

（四）基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。

转托管在转出方进行申报，基金份额转托管一次完成。投资者于 T 日转托管基金份额申请成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起对该部分基金份额进行正常交易。投资者事先应在转入方做好注册确认。

本基金可在场外各销售机构之间、上证所会员场内系统之间转托管，但不可以在上证所场内系统和场外系统（指上证所以外本公司及代销机构的开放式基金柜台销售系统）之间进行跨市场转托管。

（五）基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。

冻结基金份额参与基金每日收益分配，即根据当日收益（亏损）变动率，计算当日应增（减）份额，对原冻结份额进行调增（减）。

（六）在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人可以办理基金份额的质押业务或其他非交易过户业务，并制定、公布并实施相应的业务规则。

十、基金的投资

（一）投资目标

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。

（二）投资理念

1、有效规避市场风险

本基金管理人相信通过投资短期金融工具，可以最大限度地规避市场风险，实现投资的安全。

2、获取稳定收益

本基金管理人认为通过有效选择短期金融工具及科学的价值分析，可以减少预期收益的不确定性，保证基金财产获得持续稳定的收益。

3、主动投资与被动投资相结合

本基金管理人认为通过主动投资和被动投资相结合的策略，可以更大程度地实现资产增值。

（三）投资范围

本基金的投资对象主要包括：

1、现金；

2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；

3、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；

4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

（四）投资策略

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。

（五）选券标准

1、短期债券品种到期期限小于等于 397 天；

2、有良好流动性；

3、收益率较高；

4、企业债信用评级须为 AAA 级的。

（六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：银行活期存款利率（税后）

（七）投资决策

1、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。

2、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）量化投资部定期对基金投资组合进行绩效和风险评估；

（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。

（八）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期不得超过 240 天；

2、本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 10%；

3、根据本基金基金份额持有人的集中度，对上述第 1、2 项投资组合实施如下调整：

当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；

当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；

4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5、本基金投资于有固定期限银行存款的比例不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受该比例限制；

6、本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存

单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%；投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%；

7、本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；

8、本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于 5%；

9、除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%；

10、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

11、本基金投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级，且其信用评级应不低于国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的信用级别。本基金持有的资产支持证券信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在评级报告发布之日起 3 个月内对其予以全部卖出；

12、在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

13、投资于短期金融工具的比重不低于基金资产总值的 80%；

14、本基金的基金总资产不得超过基金资产净值的 140%；

15、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

16、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%；因证券市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

17、本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资

产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；

前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种；

18、本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；

19、中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除第 1、8、11、15 和 16 项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

（九）投资禁止及特殊交易行为

1、本基金不得投资于下列金融工具：

（1）股票；

（2）可转换债券、可交换债券；

（3）剩余期限超过 397 天的债券；

（4）信用等级在 AAA 级以下的企业债券及信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具；

（5）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但已进入最后一个利率调整期的除外；

（6）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

3、本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。

（十）投资组合平均剩余期限与平均剩余存续期的计算

1、计算公式

本基金按下列公式计算平均剩余期限：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

本基金投资组合平均剩余存续期限的计算公式为：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余存续期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{剩余存续期限} + \text{债券正回购} \times \text{剩余存续期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、期限在一年以内（含一年）的债券逆回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、买断式回购产生的待回购债券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

投资于金融工具产生的负债包括期限在 1 年以内（含 1 年）的债券正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

2、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定

（1）银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为 0 天；证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算；买断式回购履约金的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算。

（2）银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；有存款期限，根据协议可提前支取且没有利息损失

的银行存款，剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算。

（3）组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数，以下情况除外：

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

（4）回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。

（5）中央银行票据的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。

（6）买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限。

（7）买断式回购产生的待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算。

（8）对其它金融工具，本基金管理人将基于审慎原则，根据法律法规或中国证监会的规定、或参照行业公认的方法计算其剩余期限和剩余存续期限。

平均剩余期限和剩余存续期限的计算结果保留至整数位，小数点后四舍五入。如法律法规或中国证监会对剩余期限和剩余存续期限计算方法另有规定的，从其规定。

（十一）基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

1、有利于本基金财产的安全和增值；

2、基金管理人按照国家有关规定代表本基金行使债权人权力，保护基金投资者利益。

（十二）基金的融资

本基金可以按照国家的有关规定进行融资。

（十三）基金投资组合报告

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基金合同规定，于 2023 年 11 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 2023 年 9 月 30 日（摘自 2023 年第 3 季度报告），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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	17,444,831,234.19	25.85
	其中：债券	17,444,831,234.19	25.85
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,510,327,000.00	6.68
	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	45,537,924,784.43	67.47
4	其他资产	514,195.99	0.00
5	合计	67,493,597,214.61	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	4.78
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	2,996,073,062.63	5.00
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内本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	90

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	89

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

（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	30.51	12.52
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	22.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	15.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	22.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天（含）	21.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		112.16	12.52

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,888,249,638.89	4.82
	其中：政策性金融债	1,548,523,211.78	2.58
4	企业债券	812,814,595.05	1.36

5	企业短期融资券	425,118,158.16	0.71
6	中期票据	30,748,111.37	0.05
7	同业存单	13,287,900,730.72	22.17
8	其他	-	-
9	合计	17,444,831,234.19	29.10
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

6、报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112305152	23 建设银行 CD152	6,000,000	590,806,194.37	0.99
2	190305	19 进出 05	4,900,000	502,381,414.16	0.84
3	112304002	23 中国银行 CD002	5,000,000	498,988,840.59	0.83
4	112309113	23 浦发银行 CD113	5,000,000	492,750,798.31	0.82
5	112381889	23 徽商银行 CD100	5,000,000	492,175,810.63	0.82
6	2028043	20 建设银行双创债	4,500,000	463,183,083.04	0.77
7	112321175	23 渤海银行 CD175	4,000,000	396,359,214.03	0.66
8	112387056	23 郑州银行 CD231	4,000,000	390,329,247.83	0.65
9	230301	23 进出 01	3,400,000	345,019,317.25	0.58
10	112382424	23 青岛农商行 CD129	3,000,000	299,841,871.63	0.50

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	0.0439%
报告期内偏离度的最低值	-0.0310%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0257%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8、期末按摊余成本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。

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期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国建设银行股份有限公司于 2022 年 9 月 30 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕51 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，建设银行理财业务存在以下违法违规行为：老产品规模在部分时点出现反弹。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对建设银行处以罚款 200 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国建设银行股份有限公司于 2023 年 2 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2023〕10 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第三十四条、第三十五条、第四十条、第五十条、第六十二条、第七十三条、第七十四条和相关审慎经营规则，经查，中国建设银行存在以下行为：一、公司治理和内部控制制度与监管规定不符；二、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改；三、向检查组提供企业出具的虚假证明材料；四、未按规定及时报送案件信息；五、违规发放房地产贷款；六、贷款审查严重不尽职，违规办理虚假按揭贷款；七、违规发放固定资产贷款；八、违规为地方政府融资平台提供融资，后期以流动资金贷款承接前期融资；九、信用卡资金违规流入证券公司；十、违反产业政策为“两高一剩”企业提供融资；十一、小微企业统计数据与事实不符，企业划型不准确，将大中型企业纳入小微

企业统计；十二、小微快贷业务违反审慎经营规则；十三、违规收取民营企业、小微企业费用；十四、违规借贷搭售理财产品；十五、精准扶贫小额贷款资金违规归集使用；十六、向关系人发放信用贷款；十七、违规发放贷款掩盖风险；十八、违规变相突破单一法人客户授信额度限制；十九、搭桥贷款业务不合规；二十、流动资金贷款管理违反审慎经营规则；二十一、固定资产贷款管理违反审慎经营规则；二十二、并购贷款管理违反审慎经营规则；二十三、个人贷款管理严重违反审慎经营规则；二十四、理财业务风险隔离不符合监管规定；二十五、理财业务投资运作不合规；二十六、违规通过理财业务实现不良资产虚假出表；二十七、违规虚增资本；二十八、面向一般个人客户销售的理财产品资金流向不符合规定，违规投资权益类资产；二十九、理财产品信息登记不及时，部分产品未登记底层资产；三十、理财业务统计数据与事实不符；三十一、理财资金投资非标准化债权资产的余额超过监管比例要求；三十二、同业投资业务管理违反审慎经营规则；三十三、债券投资业务未准确计量风险，个别债券风险加权资产计提比例低于监管要求；三十四、串用银行承兑汇票保证金掩盖信用风险；三十五、贴现资金违规回流出票人；三十六、违规向委托贷款借款人收取手续费；三十七、对信用卡业务异常交易行为监控不力导致频繁套现；三十八、银行集团并表统一授信管理流于形式。综上，中国银行保险监督管理委员会对中国建设银行没收违法所得并处罚款合计 19891.5626 万元，其中总行 7341.5626 万元，分支机构 12550 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国银行股份有限公司于 2023 年 2 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2023〕5 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第七十三条和相关审慎经营规则，经查，中国银行存在以下行为：一、小微企业贷款风险分类不准确；二、小微企业贷款资金被挪用于房地产领域；三、贷款资金被挪用于证券市场；四、小微企业贷款资金被挪用于购买本行理财；五、小微企业贷款统计数据不真实；六、向银行员工和公务员发放个人经营性贷款；七、违反监管规定向小微企业客户收取承诺费、咨询费。综上，中国银行保险监督管理委员会对中国银行总行罚款 1600 万元，对分支机构罚款 1680 万元，合计罚款 3280 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体渤海银行股份有限公司于

2023 年 2 月 16 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2023〕8 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，渤海银行存在以下行为：一、小微企业贷款风险分类不准确；二、小微企业贷款资金被挪用于购买理财产品；三、将银行员工、公务员等个人商用房贷款计入普惠型个体工商户或小微企业主贷款统计口径；四、将非小微企业划归统计口径；五、违规发放商用房贷款。综上，中国银行保险监督管理委员会对渤海总行罚款 430 万元，对分支机构罚款 1230 万元，合计罚款 1660 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体渤海银行股份有限公司于 2023 年 2 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2023〕21 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则，经查，渤海银行存在以下行为：一、风险加权资产计算不准确；二、流动性风险指标计算不准确；三、全部关联度计算不准确；四、未准确反映信用风险信息；五、未准确反映国别风险信息；六、股权质押业务错报；七、理财业务数据错报；八、主要股东数据错报；九、大中小微型企业贷款、普惠型消费贷款数据错报；十、投资数据错报；十一、同业交易对手错报；十二、数据治理机制不健全；十三、制度建设和信息系统建设不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对渤海银行罚款 860 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体渤海银行股份有限公司于 2023 年 4 月 24 日收到中国证券监督管理委员会天津监管局《关于对渤海银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》，经查，渤海银行股份有限公司基金销售业务存在以下违规行为:一、基金销售业务部门负责人、部分分支行基金销售业务负责人未取得基金从业资格；二、合规风控人员未对基金新销售产品进行合规审查并出具合规审查意见；三、未将基金销售保有规模、投资人长期收益纳入分支机构和基金销售人员考核评价指标体系。上述行为违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第八条第四项、第二十六条第二款、第三十条第一款的规定，中国证券监督管理委员会天津监管局决定对渤海银行股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛农村商业银行股份有限公司于 2023 年 4 月 14 日收到青岛银保监局行政处罚信息公开表（青银保监罚决

字〔2023〕37 号、38 号），经查，青岛农村商业银行股份有限公司存在同业业务授信管理不审慎等问题。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、四十八条，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局决定对青岛农村商业银行股份有限公司处以罚款人民币 100 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛农村商业银行股份有限公司于 2022 年 8 月 26 日、2022 年 8 月 30 日收到青岛银保监局行政处罚信息公开表（青银保监罚决字〔2022〕86-92 号），经查，青岛农村商业银行股份有限公司存在公司类贷款风险分类调整不及时、向关系人发放担保贷款的条件优于其他借款人同类贷款的条件、流动资金贷款管理不审慎、贷后管理不审慎等问题。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、四十八条；《中华人民共和国商业银行法》第七十四条、八十九条，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局决定对青岛农村商业银行股份有限公司处以合计 3087.27 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

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

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	513,995.99
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	200.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	514,195.99

（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。

十一、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 2023 年 9 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
自基金合同生效日（2004 年 3 月 19 日）至 2004 年 12 月 31 日	1.7409%	0.0014%	1.2828%	0.0000%	0.4581%	0.0014%
2005 年	2.4594%	0.0039%	1.8000%	0.0000%	0.6594%	0.0039%
2006 年	1.9495%	0.0026%	1.9060%	0.0000%	0.0435%	0.0026%
2007 年	3.2407%	0.0076%	2.8497%	0.0019%	0.3910%	0.0057%
2008 年	4.2798%	0.0188%	3.8249%	0.0012%	0.4549%	0.0176%
2009 年	1.6201%	0.0034%	0.7587%	0.0021%	0.8614%	0.0013%
2010 年	2.0483%	0.0028%	0.3650%	0.0000%	1.6833%	0.0028%
2011 年	3.9417%	0.0032%	0.4762%	0.0001%	3.4655%	0.0031%
2012 年	4.3929%	0.0044%	0.4260%	0.0002%	3.9669%	0.0042%
2013 年	3.3316%	0.0035%	0.3549%	0.0000%	2.9767%	0.0035%
2014 年	3.9921%	0.0050%	0.3549%	0.0000%	3.6372%	0.0050%
2015 年	3.7256%	0.0048%	0.3549%	0.0000%	3.3707%	0.0048%
2016 年	2.5333%	0.0016%	0.3565%	0.0000%	2.1768%	0.0016%
2017 年	3.8395%	0.0016%	0.1790%	0.0000%	3.6605%	0.0016%

2018 年	3.1806%	0.0020%	0.3555%	0.0000%	2.8251%	0.0020%
2019 年	2.4257%	0.0016%	0.3555%	0.0000%	2.0702%	0.0016%
2020 年	2.0729%	0.0014%	0.3565%	0.0000%	1.7164%	0.0014%
2021 年	2.1641%	0.0009%	0.3555%	0.0000%	1.8086%	0.0009%
2022 年	1.7570%	0.0008%	0.3555%	0.0000%	1.4015%	0.0008%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	0.9167%	0.0010%	0.1761%	0.0000%	0.7406%	0.0010%
2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	0.4440%	0.0020%	0.0895%	0.0000%	0.3545%	0.0020%

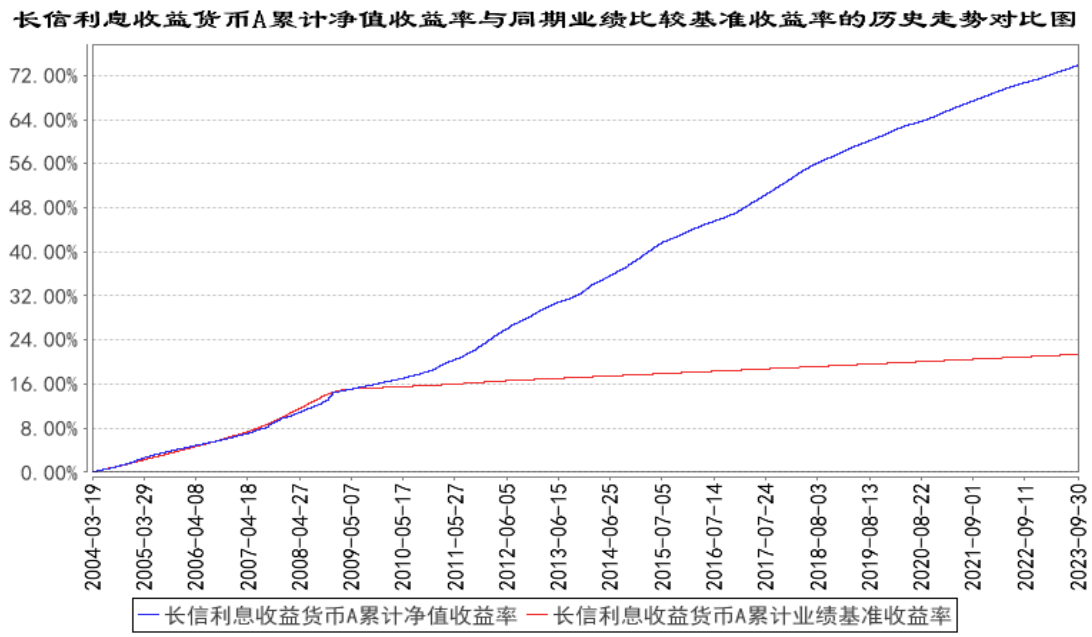
（二）长信利息收益货币 B 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金分级日（2010 年 11 月 25 日）至 2010 年 12 月 31 日	0.3308%	0.0037%	0.0370%	0.0000%	0.2938%	0.0037%
2011 年	4.1903%	0.0032%	0.4762%	0.0001%	3.7141%	0.0031%
2012 年	4.6424%	0.0044%	0.4260%	0.0002%	4.2164%	0.0042%
2013 年	3.5803%	0.0035%	0.3549%	0.0000%	3.2254%	0.0035%
2014 年	4.2415%	0.0050%	0.3549%	0.0000%	3.8866%	0.0050%
2015 年	3.9742%	0.0048%	0.3549%	0.0000%	3.6193%	0.0048%
2016 年	2.7795%	0.0016%	0.3565%	0.0000%	2.4230%	0.0016%
2017 年	4.0891%	0.0016%	0.1790%	0.0000%	3.9101%	0.0016%
2018 年	3.3939%	0.0021%	0.3555%	0.0000%	3.0384%	0.0021%
2019 年	2.6459%	0.0016%	0.3555%	0.0000%	2.2904%	0.0016%
2020 年	2.3179%	0.0014%	0.3565%	0.0000%	1.9614%	0.0014%

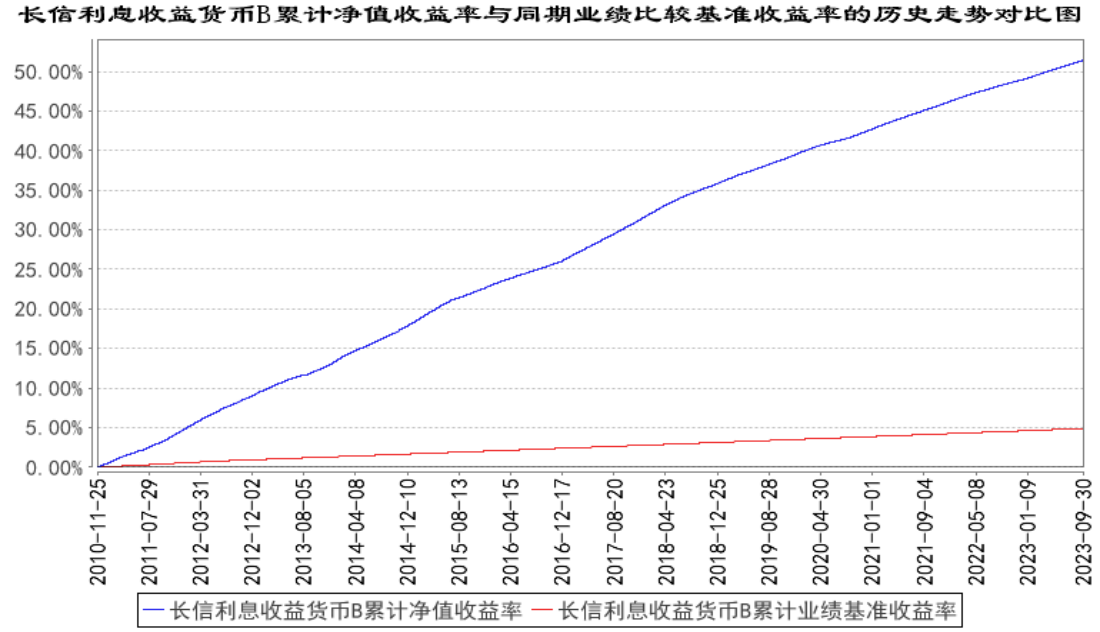
2021 年	2.4093%	0.0009%	0.3555%	0.0000%	2.0538%	0.0009%
2022 年	2.0014%	0.0008%	0.3555%	0.0000%	1.6459%	0.0008%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	1.0367%	0.0010%	0.1761%	0.0000%	0.8606%	0.0010%
2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	0.5047%	0.0020%	0.0895%	0.0000%	0.4152%	0.0020%

（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 2023 年 9 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 2023 年 9 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。

十二、基金的财产

（一）基金资产总值

指基金所拥有的所有资产（包括各类短期金融工具、银行存款和其他资产等）的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

基金财产使用以基金托管人的名义开立的基金托管专户和交易结算资金帐户，并以本基金的名义开立基金证券帐户、银行间债券托管帐户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构、注册登记机构自有的资产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管与处分

基金财产独立于基金管理人和基金托管人的固有资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人、基金托管人以其固有财产承担法律责任，非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。

除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

十三、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金财产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值计算出的基金份额收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为 1.00 元。

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

（三）估值方法

本基金估值采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提收益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

1、本基金目前投资工具的估值方法如下：

（1）基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

（2）基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

（3）基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

（4）基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

（5）基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

2、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

即使存在上述情况，基金管理人若采用上述（1）-（5）规定的方法为基金财产进行了估值，仍应被认为采用了适当的估值方法。

3、为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

4、如有新增事项，按国家有关法律法规的最新规定估值。

5、采用本估值方法可能对基金资产净值波动带来的影响：适用影子定价法对估值对象进行调整时，调整差额于当日计入基金资产净值，基金资产净值可能产生相应的波动。

6、上述估值方法如有变动，基金管理人将依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

根据有关法律法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

（四）估值对象

本基金依法持有的银行存款、各类有价证券和应收款项以及其他投资等资产。

（五）估值程序

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、

固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时；

2、因其它任何不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；

4、法律法规、中国证监会认定的其他情形。

（七）每万份基金净收益的确认和估值错误的处理

本基金的估值采用截位方式，每万份基金净收益的计算保留到小数点后 4 位，基金 7 日年化收益率保留到小数点后 3 位，国家另有规定的从其规定。

当基金资产的估值导致每万份基金净收益小数点后 4 位或基金 7 日年化收益率小数点后 3 位以内发生差错时，视为估值错误。国家另有规定的，从其规定。

当基金管理人确认已经发生估值错误情形时，基金管理人应当立即公告并予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金资产净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。基金合同的当事人应将按照以下约定

处理：

1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

（5）当错误达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金资产净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

（八）特殊情形的处理

1、基金管理人按上述估值方法的第 3 条方法进行估值时，所造成的误差不作为基金估值错误处理；

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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。

基金管理人不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，基金管理人不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。

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

%

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、基金费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

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），但法律法规、中国证监会另有规定的除外；

（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%）
长信利息收益基金	0.33%

计算方法为：

H＝E×G%÷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%)
长信利息收益基金	0.08%

托管费计算方法为：

H＝E×T%÷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×X%÷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的费用中（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按规定在指定媒介上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、除上述征收强制赎回费的情形外，本基金的申购费、赎回费一般为 0。

2、本基金具体转换费率详见本更新的招募说明书“八、基金的申购、赎回与转换（十一）基金转换”部分。基金的转换费由投资者承担，用于支付有关手续费和注册登记费。

基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率在《更新的招募说明书》中列示。上述费率如发生变更，基金管理人还应最迟于新的费率实施前按规定在指定媒介公告。

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。

（三）基金税收

基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十六、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为基金会计责任方。

2、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元。

4、会计制度执行国家有关的会计制度。

5、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。

6、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金年度审计

1、基金管理人聘请具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意。基金管理人应当在更换会计师事务所后按规定编制临时报告书，在指定媒介予以公告。

十七、基金的信息披露

（一）披露原则

本基金的信息披露将严格按照《基金法》、《信息披露办法》、《证券投资基金信息披露内容和格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》、基金合同及其他有关规定进行。基金的信息披露应当在指定媒介上公告。相关法律法规关于信息披露的披露内容、披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

（二）信息披露文件的种类、形式和时间

1、基金募集信息披露

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》及中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式在指定媒介上公告基金招募说明书、基金合同、托管协议和基金产品资料概要。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

基金合同生效后，基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要，并登载在指定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。

基金终止运作的，基金管理人可以不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

2、基金运作信息披露

本基金运作信息披露包括年度报告、中期报告、季度报告等定期报告和基金收益公告等。由基金管理人和基金托管人按照《基金法》等相关法律法规和中国证监会颁布相关文件进行编制，在指定媒介予以公告。

（1）年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基

金年度报告，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在中国证监会指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

（2）中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在中国证监会指定报刊上。

（3）季度报告：基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金应当在年度报告、中期报告中至少披露报告期末基金前 10 名基金份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。

（4）基金收益公告：

基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各级基金基金日收益和基金 7 日年化收益率（%）。

基金管理人应当应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日各级基金基金日收益和基金 7 日年化收益率（%）。

3、基金临时信息披露

基金发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金资产估值产生重大影响的重大事件时，有关信息披露义务人应当按规定编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

(1)基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

(2)基金合同终止、基金清算；

(3)转换基金运作方式、基金合并；

(4)更换基金管理人、基金托管人；

(5)基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

(6)基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

(7)基金管理公司变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；

(8)基金募集期延长；

(9)基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

(10)基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过 50%；

(11)基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过 30%；

(12)涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(13) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

(14) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

(15)管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(16)基金计价错误偏差达到基金资产净值的 0.5%；

(17)基金改聘会计师事务所；

(18)基金更换注册登记机构；

(19)开放式基金开始办理申购、赎回；

(20)开放式基金发生巨额赎回并延期办理；

(21)开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(22)开放式基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（23）当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的正负偏离度绝对值达到 0.5%时的情形；当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值连续 2 个交易日出现负偏离度绝

对值超过 0.5%的情形；

（24）本基金遇到极端风险情形，基金管理人及其股东使用固有资金从本基金购买相关金融工具；

（25）本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项；

（26）本基金投资于主体信用评级低于 AA+的商业银行的银行存款与同业存单时；

(27) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

4、澄清公告与说明

在基金合同有效期内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金资产估值产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

5、清算报告

基金合同出现终止情形的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（三）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，以供社会公众查阅、复制。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复制件或复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告文本的内容完全一致。

十八、风险揭示

（一）投资于基金的风险

1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对基金财产产生潜在风险，主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响本基金收益。

（2）经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，国家经济和各个行业也呈周期性变化，从而影响到证券市场和短期资金市场的走势。

（3）利率风险

由于短期金融工具对利率变动相对敏感，因此央行利率政策的变化将直接对本基金的收益产生影响；另外，在基准利率不变的情况下，市场的短期利率也会发生变化，从而对基金收益产生影响。

（4）购买力风险

基金投资的目的是使基金财产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金财产的保值增值。

2、信用风险

基金在交易过程中发生交收或抵押违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，均会降低本基金的投资收益。

本基金投资的回购品种，如果到期对方不履约，将导致本基金可能出现损失或增加基金的投资风险。

3、流动性风险

流动性风险是指金融资产不能及时变现或无法按照正常的市场价格交易而引起损失的可能性。

本基金拟投资市场、行业及资产具有较好的流动性，与基金合同约定的申购

赎回安排相匹配，能够支持不同市场情形下投资者的赎回要求。本基金主要的流动性风险为投资者可能会面临因巨额赎回带来的流动性风险。若是由于投资者大量赎回而导致基金管理人被迫抛售持有投资品种以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，在巨额赎回发生时采取备用的流动性风险管理应对措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

（1）基金申购、赎回安排

本基金申购赎回的具体安排可见本招募说明书“八、基金的申购、赎回与转换”章节。

（2）拟投资市场的流动性风险评估

1）从投资范围上看，本基金主要投资于现金及各类货币市场工具，该类资产总体上具有很高的流动性。

2）投资限制上，本基金管理人将严格按照《流动性风险规定》的要求，从组合久期、持有人集中度及组合变现能力等方面施加投资限制，控制流动性风险；

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

（3）巨额赎回下的流动性风险管理措施

基金管理人已建立内部巨额赎回应对机制，对基金巨额赎回情况进行严格的事前监测、事中管控与事后评估。当基金发生巨额赎回时，基金经理和风险管理部会根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以支付所有的赎回款项。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，基金管理人会在充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回申请。具体措施详见本招募说明书“八、基金的申购、赎回与转换”章节中“（九）巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

1）暂停赎回或延缓支付赎回款项：上述具体措施详见招募说明书“八、基金的申购、赎回与转换”章节中“（十）拒绝或暂停申购和暂停赎回的情形及处理”及“（九）巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

2）延期办理巨额赎回申请：上述具体措施可见本招募说明书“八、基金的申购、赎回与转换”章节中“（九）巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

3）暂停基金估值

暂停估值的情形详见招募说明书“十三、基金资产的估值”章节第（六）条的相关约定，若当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，实施暂停基金估值，基金管理人相应会采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

4、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金的收益水平。基金托管人的管理水平对基金收益水平也存在影响。

5、操作或技术风险

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

6、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

7、特殊风险

结构调整滞后风险。当利率发生不利变化时，由于本基金所投资的回购品种必须持有到期才能进行期限结构调整，从而使得本基金对市场的反应相对滞后，并降低本基金的投资收益。

8、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

（二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。中国证监会对本基金募集

的批准，并不表明其对本基金的价值和收益做出了任何实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、除基金管理人直接办理基金的销售外，基金还通过中国农业银行等代销机构代理销售，但是，基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

3、基金管理人保证依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但由于证券投资具有一定风险，因此不能保证本基金一定赢利，也不保证基金份额持有人的最低收益。投资人自愿投资于基金，须自行承担投资风险。

十九、基金的终止与基金财产清算

（一）基金的终止事由

有下列情形之一的，本基金将终止：

1、基金份额持有人大会表决终止的；

2、因重大违法、违规行为，本基金被中国证监会责令终止的；

3、基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；

4、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；

5、基金存续期内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元；

6、中国证监会允许的其他情况。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人依照《基金法》及有关法律法规、基金合同的规定，行使请求给付报酬从该基金财产中获得补偿的权利时，可以留置该基金财产或者向该基金财产的权利归属人提出请求。

（二）基金财产的清算

1、基金清算小组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算；

（2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。基金清算小组在成立后 5 个工作日内应当公告；

（3）基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

2、基金清算程序

（1）基金合同终止后，由基金清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）将基金清算结果报告中国证监会；

（5）公布基金清算公告；

（6）对基金财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

4、基金财产按下列顺序清偿：

（1） 支付清算费用；

（2） 交纳所欠税款；

（3） 清偿基金债务；

（4） 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5、基金清算的公告

清算组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报国务院证券监督管理机构备案并公告。

6、基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十、基金合同的内容摘要

（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金管理人的权利

（1）自基金合同生效之日起，依法并依照《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（2）依据《基金合同》的规定，获得基金管理费；

（3）销售基金份额和为基金份额持有人提供服务，收取基金销售与持有人服务费用及其他事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的费用；

（4）依照有关法律法规，代表基金行使因投资而产生的相关权利；

（5）依据有关法律及《基金合同》的规定决定基金收益的分配方案；

（6）在基金存续期内，依据有关的法律法规和《基金合同》的规定，决定暂停受理申购和暂停受理赎回申请；

（7）选择或更换基金代销机构，并对其销售代理行为进行必要的监督；

（8）监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家法律法规，应呈报中国证监会和其他监管部门，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取必要措施保护基金投资者的利益；

（9）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（10）负责办理注册登记业务或委托其他机构代为办理注册登记业务，并对注册登记代理机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（11）有关法律法规及《基金合同》规定的其它权利。

2、基金管理人的义务

（1）基金管理人应遵守《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；

（2）基金管理人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金财产；

（3）充分考虑本基金的特点，设置相应的部门并配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产，防范和降低风险；

设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其它业务或委托合格机构代为办理；

设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与过户登记工作或委托其它机构代理该项业务；

（4）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证基金管理人的固有财产和基金财产相互独立，确保分别管理、分别核算、记账；保证与基金管理人管理的其他基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，确保分别管理、分别记账；

（5）除依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三方谋取利益，基金管理人不得委托第三人管理、运作基金财产；

（6）接受基金份额持有人、基金份额持有人大会、基金托管人依照《基金合同》及相关法律规定对管理人履行《基金合同》情况进行的监督；

（7）采取所有必要措施对基金托管人违反法律法规、《基金合同》和《托管协议》的行为进行纠正和补救；

（8）按规定计算并公告基金日收益以及基金 7 日年化收益率；

（9）按照法律和《基金合同》的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（10）严格按照《基金法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定履行信息披露及报告义务；

（11）保守基金的商业秘密，不泄露基金投资计划和投资意向等；除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不向他人泄露，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露不应视为基金管理人违反《基金合同》规定的保密义务；

（12）依据《基金合同》规定制订基金收益分配方案，并向基金份额持有人分配基金收益；

（13）不谋求对基金财产所投资的公司的控股和直接管理；

（14）依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会，执行基金份额持有人大会决议；

（15）编制基金的财务会计报告；保存基金的会计账册、报表及其他处理有关基金事务的完整记录 15 年以上；

（16）参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（17）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（18）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务；基金托管人因过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；

（19）基金管理人因过错致使基金财产受到损失的，应当承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

（20）确保向基金份额持有人和基金份额持有人大会提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

（21）不从事任何有损本基金及本基金其他当事人利益的活动；

（22）法律法规、《基金合同》以及依据《基金合同》制定的其他法律文件所规定的其他义务。

3、基金托管人的权利

（1）依法持有并保管基金财产；

（2）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（3）监督基金管理人对基金的投资运作，如基金托管人认为基金管理人违反《基金合同》或有关法律法规的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益，必要时可向有关部门、基金份额持有人大会提议更换基金管理人；

（4）依据《基金合同》规定获得基金托管费；

（5）法律法规及《基金合同》规定的其它权利。

4、基金托管人的义务

（1）基金托管人应遵守《基金法》、《基金合同》、《托管协议》及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；基金托管人保证恪尽职守，

依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险；

（3）购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行；

（4）建立健全内部风险、监察与稽核、财务管理及人事管理等控制制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人固有财产相互独立，保证其托管的基金财产与其托管的其他基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（5）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金财产，造成基金财产损失的，承担赔偿责任，基金托管人不得委托第三人托管基金财产；

（6）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（7）以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以基金托管人及本基金联名的方式开立基金证券账户，以基金的名义开立银行间债券托管账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

（8）对基金商业秘密和基金份额持有人、投资者进行基金交易有关情况负有保密义务，不泄露基金投资计划、投资意向及基金投资者、基金份额持有人的相关情况及资料等；除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露不应视为基金托管人违反《基金合同》规定的保密义务；

（9）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金日收益和基金 7 日年化收益率；

（10）按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会；

（11）采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、申购和赎回等事项符合《基金合同》等有关法律文件的规定；

（12）采取适当、合理的措施，使基金投、融资条件和基金管理人用以计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定；

（13）监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违法、违规的，不予执行，并向中国证监会报告；

（14）在定期报告内出具基金托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行，如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（15）按有关规定，建立并保存基金的持有人名册、会计账册、报表和其他有关基金托管事务的完整记录等 15 年以上；

（16）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（17）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（18）参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

（20）基金管理人因过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

（21）因过错导致基金财产的损失或因违背托管职责或者处理基金事务不当对第三人所负债务或者自己受到的损失，应以其固有财产承担，其责任不因其退任而免除；

（22）不从事任何有损本基金及本基金其他当事人利益的活动；

（23）法律法规、《基金合同》和依据《基金合同》制定的其他法律文件所规定的其他义务。

5、基金份额持有人权利

（1）按《基金合同》的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，就审议事项行使平等表决权；

（2）按《基金合同》的规定取得基金收益；

（3）监督基金经营情况，查询或获取公开的基金业务及财务状况的资料；

（4）申购或赎回基金份额；

（5）获取基金清算后的剩余资产；

（6）依照《基金合同》的规定，召集基金份额持有人大会；

（7）要求基金管理人或基金托管人及时行使法律法规、《基金合同》以及依据《基金合同》制定的其他法律文件所规定的义务；

（8）法律法规、《基金合同》以及依据《基金合同》制定的其他法律文件规定的其他权利。

6、基金份额持有人义务

（1）遵守《基金合同》；

（2）缴纳基金认购、申购等事宜涉及的款项及规定的费用；

（3）以其对基金的投资额为限承担该基金亏损或者终止的有限责任；

（4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；

（5）法律法规、《基金合同》以及依据《基金合同》制定的其他法律文件所规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会的召集、议事及表决的程序和规则

1、基金份额持有人大会的召集事由：

（1）修改《基金合同》，但《基金合同》另有约定的除外；

（2）决定终止《基金合同》；

（3）转换基金运作方式；

（4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（5）更换基金管理人；

（6）更换基金托管人；

（7）本基金与其他基金合并；

（8）单独或合计持有本基金 10%以上（不含 10%）基金份额的基金份额持有人依法定程序（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）要求召开基金份额持有人大会；

（9）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（10）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他情形或对《基金合同》当事人权利、义务产生重大影响的其他事项。

以下情况不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费、基金托管费、基金销售与持有人服务费及其他应由基金承担的费用；

（2）在本《基金合同》规定的范围内变更基金的申购、赎回费率或收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动必须对本《基金合同》进行相应的修改；

（4）对《基金合同》的修改不涉及本《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

（5）《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）按照法律法规或本《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、召集方式

（1）除法律法规或本《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会时间及地点由召集人选择确定。

（2）在更换基金管理人、审议与基金管理人有利益冲突的事项或基金管理人未能行使召集权的情况下，由基金托管人召集基金份额持有人大会。

（3）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

（4）代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出

具书面决定之日起六十日内召开。

基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，基金份额持有人可以依法自行召集基金份额持有人大会。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和方式；

（2）会议拟审议的主要事项；

（3）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

（4）代理投票授权委托书送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名、电话；

（6）如采用通讯表决方式，则载明投票表决的截止日以及表决票的送达地址；

（7）采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交截止时间和收取方式。

4、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照本《基金合同》的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人或基金托管人的更换事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证以及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、本《基金合同》和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，

全部有效的凭证对应的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（不含 50%）。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按本《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，所有出具有效书面意见所代表的基金份额持有人所持有的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（不含 50%）；

（4）直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托代表他人出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证以及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、本《基金合同》和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前已报中国证监会备案。

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

议事内容为关系全体基金份额持有人利益的重大事项，如修改《基金合同》、终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、基金与其它基金合并以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其它事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日前 10 天公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（不含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前 15 天提交召集人。召集人对于基金管理人和基金托管人提交的临时提案应当在大会召开日前 10 天公告。对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和本《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（2）议事程序

a. 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会召集人按照规定程序确定和公布监票人，然后由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会由基金管理人授权代表主持，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（不含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

b. 通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，召集人应提前 30 日公布提案。在所通知的表决截止日期第二天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3)基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

6、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

a. 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权 50%（不含 50%）通过方为有效；

b. 特别决议

特别决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止本《基金合同》等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(3)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4)采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

(5)基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

（1）现场开会

a.基金份额持有人大会的召集人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

b.监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

c.如果会议召集人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议召集人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议召集人应当立即重新清点并公布重新清点结果。

(2)通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

8、生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。生效的基金份额持有人大会决议对全体《基金合同》当事人均有约束力。

基金份额持有人大会决议应自生效之日起按规定在指定媒介上公告。

（三）基金合同的终止的事由、程序

1、基金的终止事由

有下列情形之一的，本《基金合同》经中国证监会批准后终止：

（1）基金份额持有人大会表决终止的；

（2）因重大违法、违规行为，《基金合同》被中国证监会责令终止的；

（3）基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；

（4）基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；

（5）基金存续期内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 户，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元；

（6）中国证监会允许的其他情况。

基金终止后，基金管理人和基金托管人依照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，行使请求给付报酬从该基金财产中获得补偿的权利时，可以留置该基金财产或者向该基金财产的权利归属人提出请求。

2、基金财产的清算

（1）基金清算小组

1）自《基金合同》终止之日起 30 个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。基金清算小组在成立后五个工作日内应当公告。

3）基金清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（2）基金清算程序

1）《基金合同》终止后，由基金清算小组统一接管基金；

2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3）对基金财产进行估值和变现；

4）将基金清算结果报告中国证监会；

5）公布基金清算公告；

6）对基金财产进行分配。

（3）基金清算费用

清算费用是指基金清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算小组优先从基金财产中支付。

（4）清算后的基金财产清偿顺序

1）支付清算费用；

2）交纳所欠税款；

3）清偿基金债务；

4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1） 至 3） 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（5）基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并在指定媒介上公告。

（6）基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

（四）争议解决方式

各方当事人因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，可向基金管理人所在地有管辖权的人民法院起诉。

（五）基金合同的存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以《基金合同》正本为准。

二十一、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

基金管理人：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：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

邮政编码：200120

法定代表人：刘元瑞

成立时间：2003 年 5 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]63 号

注册资本：1.65 亿元人民币

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】

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

基金托管人：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

法定代表人：周慕冰

托管资格的批准文号：证监基字【1998】23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、

咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

（二）基金管理人与基金托管人之间的业务监督、核查

1、基金托管人对基金管理人的监督和核查

（1）监督和核查内容

基金托管人就基金管理人投资交易行为、基金资产的投资组合的比例、投资范围、基金管理人的报酬计提比例和支付方法、基金资产核算、基金资产净值的计算、收益分配、基金的申购、赎回和转换等是否符合《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定，对基金管理人进行监督和核查、定期审核基金管理人的投资管理情况，对基金潜在的风险控制隐患提出意见和建议。

（2）处理方式和程序

基金托管人发现基金管理人有违规行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式给托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金管理人有重大违规行为时，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。并将纠正结果报告中国证监会。

2、基金管理人对基金托管人的监督和核查

（1）监督和核查内容

根据《暂行办法》、《基金合同》及其它有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的投资指令、是否擅自动用基金财产、是否妥善保管基金的全部资产、是否及时准确的收妥申购资金和支付赎回资金、是否按时将分配给基金持有人的收益划入分红派息账户、是否及时按照基金管理人的指令支付基金代销人（如有）和注册登记人的手续费、是否对基金管理人计算的基金资产

净值、每万份基金份额收益及基金投资收益率进行及时的审查和复核等事项，对基金托管人进行监督和核查。

（2）处理方式和程序

基金管理人应定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因托管人的过错导致基金资产灭失、减损、或处于危险状态的，基金管理人应以书面方式要求托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有义务要求托管人赔偿基金因此所受的损失。

基金管理人发现基金托管人的其它违法行为，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金托管人有重大违规行为，基金管理人应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

（三）基金财产的保管

1、基金托管人应安全、完善保管本基金的全部资产。

2、基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。托管人必须为基金设立独立的账户，必须将本基金资产与托管人自身的资产及其受托的其他基金的资产实行严格的分账管理。托管人未经基金管理人授权，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

3、基金的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时采取措施进行催收，并将催收情况及时通知基金管理人，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

4、托管人应对基金资产运作情况严格保密（中国证监会要求披露的除外）。

（四）基金净值的计算与复核

1、基金资产净值的计算和基金投资收益率的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金份额净值等于计算日基金资产净值除以计算日基金份额总份额后的价

值。

日每万份基金净收益 R=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。

基金投资收益率为公告日最近 7 日收益折算的年资产收益率（%）

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

Ri 为最近第 i 日的每万份基金份额收益。如不足 7 日，则采取上述公式类似进行计算。

基金管理人按规定计算基金资产净值、基金资产单位净值、每万份基金份额收益和以最近七日收益折算的年资产收益率，并由基金托管人核实后确定，于每个开放日的次日按规定予以公告。

基金管理人和基金托管人应每日对基金资产进行估值。当基金持有的某项资产以现有的估值方法不能客观反映其公允价值时，基金管理人应与基金托管人共同协商，并按最能反映公允价值的方法进行估值。

2、复核程序

基金管理人每日对基金资产进行估值后，将估值结果（估值表）通过加密传真传送给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行逐项复核；经基金托管人复核无误后，签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账户的核对同时进行。

因基金资产净值计算错误造成损失，由基金管理人和基金托管人共同承担责任；各自承担责任的具体比例根据有关法律法规、行业规则和权责一致的原则确定。

基金托管人应采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算本基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件规定。

（五）基金份额持有人名册的登记和保管

1、基金持有人名册的登记

基金持有人名册由基金托管人向注册登记机构取得，包括初次募集的基金持有人名册、基金权益登记日的基金持有人名册、基金持有人大会登记日的基金持有人名册、每月最后一个交易日的基金持有人名册。

2、基金持有人名册的保管

基金持有人名册由基金管理人和基金托管人分别保管。

（六）争议的解决方法

1、发生纠纷时，本托管协议当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，向有管辖权的人民法院提起诉讼。

2、争议处理期间，双方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金持有人的合法权益。

（七）托管协议的修改与终止

1、本托管协议的任何修改或补充，须经本协议双方当事人一致书面同意，但修改后内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的托管协议报中国证监会批准后生效，并通过适当方式通知基金持有人。

2、发生以下情形，托管协议将终止：

（1）基金合同终止；

（2）基金托管人解散、撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、撤销、破产或由其他基金管理人接管其基金管理权；

（4）发生《暂行办法》规定的基金终止事项。

二十二、对基金份额持有人的服务

长信基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”，或“基金管理人”，或“公司”）将为基金份额持有人提供一系列的服务，并根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。基金份额持有人可以通过销售网点、客户服务中心、网站等渠道享受全方位、全过程的服务。以下是主要的服务方式和内容：

基金份额持有人服务内容			
序号	**类型**	**明细**	**内容详述**
（一）	**账户服务**	对账单寄送服务	每次交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印确认单； 每月结束后的 5 个工作日内，基金管理人根据投资者的对账单定制需求以电子或纸质形式寄送交易对账单。
		其他资料	基金管理人将按基金份额持有人的需求不定期向其邮寄相关公司介绍和产品介绍的资料。
（二）	**查询服务**	网络在线查询	客户通过基金账户号码或开户证件号码登录基金管理人网站“账户登录”栏目，可享有账户查询、短信/邮件信息定制、资料修改等多项在线服务。
		交易信息查询	在一笔交易结束后，投资者可在 T+2 个工作日开始通过销售机构的网点或登录基金管理人网站“账户登录”栏目查询交易情况，包括客户购买总金额、基金购买份额、基金分红份额、历史交易信息等等。
		客户账户信息的修改	基金份额持有人可以直接登录基金管理人网站修改账户的非重要信息，如联系地址、电话、电子邮箱等等。也可以亲自到网点或致电客户服务专线，由人工坐席提供相关服务。为了维护投资者的利益，投资者重要信息的更改手续办理如下： 1、代销客户：由代销渠道提交办理（具体提供材料请咨询代销机构）。以配号方式开立的开放式基金账户资料中的投资者名称、证件类型、证件号码的变更业务，在一个工作日内，对单个开放式基金账户只能够修改其中一项关键信息。 2、直销客户：非正常变更需要提供本人身份证复印件、公安机关证明原件、开放式基金账户业务申请表、开放式基金账户资料变更申请表；正常变更需要提供本人身份证复印件、开放式基金账户业务申请表、开放式基金账户资料变更申请表；银行柜台出具的新旧银行卡转换证明原件，邮寄到本公司。
（三）	**基金投资服务**	网上交易	投资者除可通过销售机构和基金管理人的直销网点办理申购、赎回及信息查询外，还可通过基金管理人的网站（www.cxfund.com.cn）享受网上交易服务。具体业务规则详见本公司网站说明。
（四）	**客户服务**		客户服务中心自动语音系统提供 7×24 小时基金净值信息、账户交易情况、基金产品与服务等信息查询。

	中心电话服务		每交易日客户服务中心人工坐席提供服务,投资者可以通过该专线获得业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。
（五）	**客户投诉受理服务**	客户投诉处理流程	本公司客户投诉受理由客户服务中心统一管理，指定专人负责，设定专门的投诉管理工作流程，并由监察稽核部负责督促投诉的处理情况。
		客户投诉方式	投资者可通过本公司的客户服务专线（400-700-5566）、代销机构、公司网站（www.cxfund.com.cn）、电子邮件(service@cxfund.com.cn)、信件、各销售机构网点柜台等多种形式对本公司所提供的服务以及公司的政策规定进行投诉。客户投诉都将被定期汇总登记并存档，通过拨打客户服务专线进行的投诉将被电话录音存档，本公司将采取适当措施，及时妥善处理客户投诉，总结相关问题，完善内控制度。
（六）	**增值服务**	信息定制服务	基金份额持有人可以在基金管理人网站或致电客户服务专线定制自己所需要的信息，包括产品净值、交易确认、公司新闻、基金信息、账户信息等方面的内容。基金管理人按照要求，将以手机短信或者电子邮件的方式定期向投资者发送信息，投资者也可以直接登录基金管理人网站浏览相关信息。
		个性化理财服务	随着公司的发展，本公司将酌情为基金份额持有人提供个性化理财服务，如配备理财顾问为基金份额持有人提供理财建议以及相关的理财计划等形式。
		组织投资者交流会	本公司将不定期地举行投资者交流会，为基金份额持有人提供基金、投资、理财等方面的讲座，使得本公司基金份额持有人能得到更多的理财信息和其他增值服务。另外，本公司基金经理也将通过多种方式不定期地与基金份额持有人交流，让基金份额持有人了解更多基金运作情况。
（七）	**投资者教育服务**		为了进一步做好投资者服务，让投资者了解证券市场和各类证券投资品种的特点和风险，熟悉证券市场的法律法规，树立正确的投资理念，增强风险防范意识，依法维护自身合法权益，本公司将开展普及证券知识、宣传政策法规、揭示市场风险、引导依法维权等投资者教育活动。
（八）	**公开信息披露服务**	披露公司信息	为方便社会公众了解公司的信息，包括本公司的发展概况、组织结构、公司文化、经营理念、经营管理层、经营情况等公开信息,本公司开通了全国统一的客户服务专线 400-700-5566（免长话费）和公司网站（www.cxfund.com.cn），以方便投资者查询。
		披露基金信息	本公司将按规定在中国证监会指定的信息披露媒介上披露法定的文件、公告信息。 本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构及相关基金宣传资料来披露本基金相关信息，包括本基金的概况、投资理念、投资对象、风险收益特征、净值及其变化情况、基金经理介绍等多方面的信息。 本公司将通过客户服务中心、公司网站、代销机构等途径来告知认购、申购、赎回的手续、流程、费用和其他注意事项，基金投资者可以通过登陆公司网站下载相关表格。
		其他信息的披露	本公司客户服务中心和网站除为投资者提供上述信息咨询外，还提供其他信息咨询，包括托管人的情况、基金知识、市场新闻和行情、产品信息等多方面内容。

（九）	客户服务联络方式	客户服务专线	4007005566（免长话费）、工作时间（8：30-12:00 13:00-17:00）内可转人工坐席。
		传真	021-61009865
		公司网址	https://www.cxfund.com.cn/
		电子信箱	service@cxfund.com.cn

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》存放在基金管理人、基金托管人和代销机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

二十四、其他应披露的事项

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于增加方正证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/11/8
2	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/11/30
3	长信基金管理有限责任公司关于增加甬兴证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/12/16
4	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2022/12/27
5	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/1/17
6	长信利息收益开放式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/1/20
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/1/20
8	长信基金管理有限责任公司关于增加东方证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/3/13
9	长信利息收益开放式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/3/31
10	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/3/31
11	长信基金管理有限责任公司关于增加博时财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/4/20
12	长信利息收益开放式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/4/21

13	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2023年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/4/21
14	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/4/25
15	长信基金管理有限责任公司关于增加五矿证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/5/25
16	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/6/16
17	长信利息收益开放式证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/7/21
18	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2023年第二季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/7/21
19	长信基金管理有限责任公司关于增加国元证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/8/11
20	长信基金管理有限责任公司关于增加西南证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/8/14
21	长信基金管理有限责任公司关于增加江海证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/8/29
22	长信利息收益开放式证券投资基金2023年中期报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/8/31
23	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金2023年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/8/31
24	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金基金经理变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/9/16
25	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/9/20

26	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/9/25
27	长信利息收益开放式证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/10/25
28	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023/10/25
本信息披露事项截止时间为 2023 年 10 月 31 日			

二十五、备查文件

（一）中国证监会批准长信利息收益开放式证券投资基金设立的文件；

（二）《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》；

（三）开放式基金注册登记委托代理协议；

（四）托管协议；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

长信基金管理有限责任公司

二〇二三年十一月三十日