

长信量化先锋混合型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

(2019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：交通银行股份有限公司

长信量化先锋混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）2010年7月14日经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】962号文核准募集。本基金基金合同于2010年11月18日正式生效。2017年1月9日，本基金在原基金份额基础之上对基金份额进行分类，原有长信量化先锋混合型证券投资基金基金份额归为A类份额（以下简称“量化先锋A类”），并增设C类份额（以下简称“量化先锋C类”）。

重要提示

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，以及本基金投资策略所特有的风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

2015年8月7日起本基金更名为长信量化先锋混合型证券投资基金，关于基金更名的事宜，我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2019年5月18日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。本基金托管人交通银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

一、基金管理人

(一) 基金管理人基本情况

| 基金管理人概况 | | | |
|---------|---|------------|-------------|
| 名称 | 长信基金管理有限责任公司 | | |
| 注册地址 | 中国(上海)自由贸易试验区银城中路68号9楼 | | |
| 办公地址 | 上海市浦东新区银城中路68号9楼 | | |
| 邮政编码 | 200120 | | |
| 批准设立机关 | 中国证券监督管理委员会 | | |
| 批准设立文号 | 中国证监会证监基金字[2003]63号 | | |
| 注册资本 | 壹亿陆仟伍佰万元人民币 | | |
| 成立日期 | 2003年5月9日 | | |
| 组织形式 | 有限责任公司 | | |
| 法定代表人 | 成善栋 | | |
| 电话 | 021-61009999 | | |
| 传真 | 021-61009800 | | |
| 联系人 | 魏明东 | | |
| 存续期间 | 持续经营 | | |
| 经营范围 | 基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】 | | |
| 股权结构 | 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 |

| | | | |
|-----|-------|---|--|
| 成善栋 | 董事长 | 男 | 中共党员，硕士，IMBA，曾任职中国人民银行上海市分行静安区办事处办公室科员，中国人民银行上海市分行、工商银行上海市分行办公室科员、科长，上海巴黎国际银行信贷部总经理，工商银行上海市分行办公室副主任、管理信息部总经理、办公室主任、党委委员、副行长，并历任上海市金融学会副秘书长，上海城市金融学会副会长、秘书长。 |
| 刘元瑞 | 非独立董事 | 男 | 中共党员，硕士，现任长江证券股份有限公司总裁。历任长江证券股份有限公司钢铁行业研究分析师、研究部副主管，长江证券承销保荐有限公司总裁助理，长江证券股份有限公司研究部副总经理、研究所总经理、副总裁。 |
| 陈谋亮 | 非独立董事 | 男 | 中共党员，法学硕士，工商管理博士，高级经济师，高级商务谈判师。现任上海市湖北商会常务副会长，曾任湖北省委组织部“第三梯队干部班”干部，中国第二汽车制造厂干部，湖北经济学院讲师、特聘教授，扬子石化化工厂保密办主任、集团总裁办、股改办、宣传部、企管处管理干部、集团法律顾问，中石化/扬子石化与德国巴斯夫合资特大型一体化石化项目中方谈判代表，交大南洋部门经理兼董事会证券事务代表，海欣集团董事会秘书处主任、战略投资部总监、总裁助理、副总裁、总裁。 |
| 何宇城 | 非独立董事 | 男 | 中共党员，硕士，MBA、EMPACC。现任武汉钢铁有限公司副总经理。曾任宝钢计划财务部助理会计师，宝钢资金管理处费用综合管理，宝钢成本管理处冷轧成本管理主办、主管，宝钢股份成本管理处综合主管，宝钢股份财务部预算室综合主管，宝钢股份财务部副部长，宝钢分公司炼钢厂副厂长，不锈钢分公司副总经理，宝钢股份钢管条钢事业部副总经理兼南通宝钢钢铁有限公司董事长、经营财务部部长。 |
| 覃波 | 非独立董事 | 男 | 中共党员，硕士，上海国家会计学院 EMBA 毕业，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司总经理、投资决策委员会主任委员。曾任职于长江证券有限责任公司。2002 年加入长信基金管理有限责任公司，历任市场开发部区域经理、营销策划部副总监、市场开发部总监、专户理财部总监、总经理助理、副总经理。 |
| 徐志刚 | 独立董事 | 男 | 中共党员，经济学博士，曾任中国人民银行上海市徐汇区办事处办公室副主任、信贷科副科长、党委副书记，中国工商银行上海市分行办公室副主任、主任、金融调研室主任、浦东分行副行长，上海实业（集团）有限公司董事、副总裁，上海实业金融控股有限公司董事、总裁，上海实业财务有限公司董事长、总经理，德勤企业咨询（上海）有限公司华东区财务咨询主管合伙人、全球金融服务行业合伙人。 |
| 刘斐 | 独立董事 | 女 | 中共党员，工商管理硕士。现任国和创新教育基金（筹）合伙人。曾任上海国和现代服务业股权投资管理有限公司董事总经理、创始合伙人，上海国际 |

| | | | |
|--------------------------|------|---|--|
| | | | 集团旗下私募股权投资基金管理公司，浦银安盛基金管理有限公司总经理、董事（浦银安盛创始人），上海东新国际投资管理有限公司总经理、董事（浦发银行与新鸿基合资养老金投资管理公司），浦发银行办公室负责人。 |
| 马晨光 | 独立董事 | 女 | 致公党党员，法律硕士。现任上海市协力律师事务所律师，管理合伙人，上海市浦东新区人大代表，中国致公党上海市浦东新区副主委，上海市法学会金融法研究会理事，上海国际仲裁中心仲裁员，上海仲裁委员会仲裁员，复旦大学研究生校外导师，华东政法大学校外兼职导师，上海对外经贸大学兼职教授，上海市浦东新区法律服务业协会副会长。 |
| 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 |
| 吴伟 | 监事会主席 | 男 | 中共党员，研究生学历。现任武汉钢铁有限公司经营财务部总经理。历任武钢计划财务部驻工业港财务科副科长、科长、资金管理处主任科员、预算统计处处长，武汉钢铁有限公司经营财务部部长。 |
| 陈水元 | 监事 | 男 | 硕士研究生，会计师、经济师。现任长江证券股份有限公司财务负责人，兼任武汉股权托管交易中心监事长；曾任湖北证券有限公司营业部财务主管、经纪事业部财务经理，长江证券有限责任公司经纪事业部总经理助理、经纪业务总部总经理助理、营业部总经理，长江证券股份有限公司营业部总经理、总裁特别助理、执行副总裁、财务负责人、合规负责人、首席风险官。 |
| 杨爱民 | 监事 | 男 | 中共党员，在职研究生学历，会计师。现任上海海欣集团股份有限公司财务总监。曾任甘肃铝厂财务科副科长、科长，甘肃省铝业公司财务处副处长、处长，上海海欣集团审计室主任、财务副总监。 |
| 李毅 | 监事 | 女 | 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理。曾任长信基金管理有限责任公司综合行政部副总监、零售服务部总监。 |
| 孙红辉 | 监事 | 男 | 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、运营总监兼基金事务部总监。曾任职于上海机械研究所、上海家宝燃气具公司和长江证券有限责任公司。 |
| 魏明东 | 监事 | 男 | 中共党员，硕士。现任长信基金管理有限责任公司综合行政部总监兼人力资源总监。曾任职于上海市徐汇区政府、华夏证券股份有限公司和国泰基金管理有限公司。 |
| 注：上述人员之间均不存在近亲属关系 | | | |

3、经理层成员

| 经理层成员 | | | |
|-------------------|------|----|---|
| 姓名 | 职务 | 性别 | 简历 |
| 覃波 | 总经理 | 男 | 简历同上。 |
| 周永刚 | 督察长 | 男 | 经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。 |
| 邵彦明 | 副总经理 | 男 | 硕士，毕业于对外经济贸易大学，具有基金从业资格。现任长信基金管理有限责任公司副总经理兼北京分公司总经理。曾任职于北京市审计局、上海申银证券公司、大鹏证券公司、嘉实基金管理有限公司。2001年作为筹备组成员加入长信基金，历任公司北京代表处首席代表、公司总经理助理。 |
| 程燕春 | 副总经理 | 男 | 华中科技大学技术经济学士，具有基金从业资格，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，曾任中国建设银行江西省分行南昌城东支行副行长，中国建设银行纪检监察部案件检查处监察员，中国建设银行基金托管部市场处、信息披露负责人，融通基金管理有限公司筹备组成员、总经理助理兼北京分公司总经理、上海分公司总经理、执行监事，金元惠理基金管理有限公司首席市场官，历任长信基金管理有限责任公司总经理销售助理、总经理助理。 |
| 安昀 | 副总经理 | 男 | 经济学硕士，复旦大学数量经济学研究生毕业，具有基金从业资格。曾任职于申银万国证券研究所，担任策略研究工作，2008年11月加入长信基金管理有限责任公司，历任策略研究员、基金经理助理、研究发展部副总监、研究发展部总监和基金经理。2015年5月6日至2016年9月6日在敦和资产管理有限公司股票投资部担任基金经理。2016年9月8日重新加入长信基金管理有限责任公司，曾任总经理助理，现任公司副总经理和投资决策委员会执行委员、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 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 |
| 左金保 | 基金经理 | 自2015年3月14日起至今 | 经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析 |

| | | | |
|-------------------|------|-------------------------------------|---|
| | | | 工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金和长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部兼量化研究部总监和投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放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、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。 |
| 胡倩 | 基金经理 | 自 2011 年 4 月 15 日起至 2015 年 3 月 14 日 | 曾任本基金的基金经理。 |
| 叶琦 | 基金经理 | 自 2011 年 11 月 1 日起至 2012 年 3 月 7 日 | 曾任本基金的基金经理。 |
| 卢曼 | 基金经理 | 自基金合同生效之日起至 2011 年 9 月 21 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 |
| 安昀 | 副总经理、投资决策委员会执行委员、长信内需成长混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金和长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 |
| 杨帆 | 国际业务部总监、投资决策委员会执行委员、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信全球债券证券投资基金和长信利泰灵活配置混合型证券投资基金 |

| | |
|--------------------------|--|
| | 的基金经理 |
| 李家春 | 公司总经理助理、投资决策委员会执行委员、长信利丰债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金和长信利盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 |
| 高远 | 研究发展部总监、长信银利精选混合型证券投资基金和长信金利趋势混合型证券投资基金的基金经理 |
| 易利红 | 股票交易部总监 |
| 张文琍 | 固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理 |
| 陆莹 | 现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金和长信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 |
| 叶松 | 权益投资部总监、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 |
| 左金保 | 量化投资部兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放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、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理 |
| 张飒岚 | 固收专户投资部总监兼投资经理 |
| 涂世涛 | 量化专户投资部副总监兼投资经理 |
| 秦娟 | 混合债券部总监、长信利保债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理 |
| 李欣 | 债券交易部副总监 |
| 陈言午 | 专户投资部副总监兼投资经理 |
| 卢靖 | 战略与产品研发部总监 |
| 宋海岸 | 长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理 |
| 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、固定收益部、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、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、综合机构部、培训部、混合债券部、现金理财部、集团业务部、量化研究部、固收研究部、北京机构业务部、上海机构业务部 |
| 分支机构 | 北京分公司、深圳分公司、武汉分公司 |
| 员工总数 | 205 人（截至 2019 年 5 月 18 日） |

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：彭纯

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2018 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 11 位，连续五年跻身全球银行 20 强；根据 2018 年美国《财富》杂志发布的

世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 168 位，较上年提升 3 位。

截至 2019 年 3 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 97,857.47 亿元。2019 年 1-3 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 210.71 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

彭纯先生，董事长、执行董事，高级会计师。

彭先生 2018 年 2 月起任本行董事长、执行董事。2013 年 11 月至 2018 年 2 月任本行副董事长、执行董事，2013 年 10 月至 2018 年 1 月任本行行长；2010 年 4 月至 2013 年 9 月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005 年 8 月至 2010 年 4 月任本行执行董事、副行长；2004 年 9 月至 2005 年 8 月任本行副行长；2004 年 6 月至 2004 年 9 月任本行董事、行长助理；2001 年 9 月至 2004 年 6 月任本行行长助理；1994 年至 2001 年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生 1986 年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生 2018 年 8 月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015

年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至2019年3月31日，交通银行共托管证券投资基金418只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管

理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

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

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理

人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人发生重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

长信量化先锋混合型证券投资基金 A 类份额销售机构：

| | |
|---------------------------------|------------------------|
| 1、直销中心：长信基金管理有限责任公司 | |
| 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼 | |
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼 | |
| 法定代表人：成善栋 | 联系人：陈竹君 |
| 电话：021-61009916 | 传真：021-61009917 |
| 客户服务电话：400-700-5566 | 公司网站：www.cxfund.com.cn |
| 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：周慕冰 | 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）中国工商银行股份有限公司 | |
| 注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号 | |
| 办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号 | |
| 法定代表人：陈四清 | 联系人：李鸿岩 |
| 电话：010-66105662 | |
| 客户服务电话：95588 | 网址：www.icbc.com.cn |
| （3）中国银行股份有限公司 | |
| 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 | |
| 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号 | |
| 法定代表人：陈四清 | 联系人：刘文霞 |
| 电话：010-66596325 | |

| | |
|-------------------------------|----------------------|
| 客户服务电话: 95566 | 网址: www.boc.cn |
| (4) 中国建设银行股份有限公司 | |
| 注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号 | |
| 办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 | |
| 法定代表人: 王洪章 | 联系人: 张静 |
| 电话: 010-67596084 | |
| 客户服务电话: 95533 | 网址: www.ccb.com |
| (5) 交通银行股份有限公司 | |
| 注册地址: 上海市银城中路 188 号 | |
| 办公地址: 上海市银城中路 188 号 | |
| 法定代表人: 彭纯 | 联系人: 王菁 |
| 电话: 021-58781234 | 传真: 021-58408483 |
| 客户服务电话: 95559 | 网址: www.bankcomm.com |
| (6) 招商银行股份有限公司 | |
| 注册地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| 办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| 法定代表人: 李建红 | 联系人: 季平伟 |
| 电话: 0755-83198888 | 传真: 0755-83195109 |
| 客户服务电话: 95555 | 网址: www.cmbchina.com |
| (7) 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 注册地址: 上海市中山东一路 12 号 | |
| 办公地址: 上海市中山东一路 12 号 | |
| 法定代表人: 吉晓辉 | 联系人: 唐苑 |
| 电话: 021-61618888 | 传真: 021-63604199 |
| 客户服务电话: 95528 | 网址: www.spdb.com.cn |
| (8) 中国民生银行股份有限公司 | |
| 注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号 | |
| 办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号 | |
| 法定代表人: 洪崎 | 联系人: 徐野 |
| 电话: 010-58560666 | 传真: 010-58560666 |
| 客户服务电话: 95568 | 网址: www.cmbc.com.cn |
| (9) 中信银行股份有限公司 | |
| 注册地址: 北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 | |
| 办公地址: 北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 | |
| 法定代表人: 常振明 | 联系人: 方爽 |
| 电话: 010-65558888 | |
| 客户服务电话: 95558 | 网址: bank.ecitic.com |

| | |
|--------------------------------|-------------------------|
| (10) 重庆银行股份有限公司 | |
| 注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号 | |
| 办公地址：重庆市渝中区邹容路 153 号 | |
| 法定代表人：马千真 | 联系人：孔文超 |
| 电话：023-63799379 | 传真：023-63792412 |
| 客户服务电话：(023) 63836229 | 网址：www.cqcbank.com |
| (11) 华夏银行股份有限公司 | |
| 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦 | |
| 办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦 | |
| 法定代表人：吴建 | 联系人：刘军祥 |
| 电话：010-85238667 | 传真：010-85238680 |
| 客户服务电话：010-95577 | 网址：www.hxb.com.cn |
| (12) 汉口银行股份有限公司 | |
| 注册地址：武汉市江汉区建设大道 933 号武汉商业银行大厦 | |
| 办公地址：武汉市江汉区建设大道 933 号 | |
| 法定代表人：陈新民 | 联系人：李星 |
| 电话：027-82656224 | 传真：027-82656236 |
| 客户服务电话：(027) 96558, 4006096558 | 网址：www.hkbchina.com |
| (13) 杭州银行股份有限公司 | |
| 注册地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦 | |
| 办公地址：杭州银行庆春路 46 号杭州银行大厦 | |
| 法定代表人：吴太普 | 联系人：严峻 |
| 电话：0571-85108195 | 传真：0571-85106576 |
| 客户服务电话：96523, 400-8888-508 | 网址：www.hzbank.com.cn |
| (14) 平安银行股份有限公司 | |
| 注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦 | |
| 办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦 | |
| 法定代表人：孙建一 | 联系人：张莉 |
| 电话：0755-22166118 | 传真：0755-25841098 |
| 客户服务电话：95511-3 | 网址：bank.pingan.com |
| (15) 厦门银行股份有限公司 | |
| 注册地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦 | |
| 办公地址：福建省厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦 | |
| 法定代表人：吴世群 | 联系人：林黎云 |
| 电话：0592-5365735 | 传真：0592-5061952 |
| 客户服务电话：400-858-8888 | 网址：www.xmbankonline.com |

| | |
|--|-----------------------|
| (16) 江苏银行股份有限公司 | |
| 注册地址：南京市中华路 26 号 | |
| 办公地址：南京市中华路 26 号 | |
| 法定代表人：夏平 | 联系人：张洪玮 |
| 电话：025-58587036 | 传真：025-58587820 |
| 客户服务电话：95319 | 网址：www.jsbchina.cn |
| (17) 安信证券股份有限公司 | |
| 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 | |
| 办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 | |
| 法定代表人：牛冠兴 | 联系人：陈剑虹 |
| 电话：0755-82558305 | 传真：0755-28558355 |
| 客户服务电话：4008-001-001 | 网址：www.essence.com.cn |
| (18) 长城证券股份有限公司 | |
| 注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 | |
| 办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 | |
| 法定代表人：黄耀华 | 联系人：高峰 |
| 电话：0755-83516289 | 传真：0755-83515567 |
| 客户服务电话：400-6666-888 | 网址：www.cgws.com |
| (19) 长江证券股份有限公司 | |
| 注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 | |
| 办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦 | |
| 法定代表人：李新华 | 联系人：李良 |
| 电话：027-65799999 | 传真：027-85481900 |
| 客户服务电话：95579 或 4008-888-999 | 网址：www.95579.com |
| (20) 大通证券股份有限公司 | |
| 注册地址：辽宁省大连市中山区人民路 24 号 | |
| 办公地址：辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连期货大厦 39 层 | |
| 法定代表人：张智河 | 联系人：谢立军 |
| 电话：0411-39673202 | 传真：0411-39673219 |
| 客户服务电话：4008-169-169 | 网址：www.daton.com.cn |
| (21) 德邦证券有限责任公司 | |
| 注册地址：上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼 | |
| 办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼 | |
| 法定代表人：姚文平 | 联系人：王志琦 |
| 电话：021-68761616 | 传真：021-68767032 |
| 客户服务电话：400-8888-128 | 网址：www.tebon.com.cn |
| (22) 第一创业证券股份有限公司 | |

| | |
|---|----------------------------|
| 注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 | |
| 办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼 | |
| 法定代表人：刘学民 | 联系人：吴军 |
| 电话：0755-23838751 | 传真：0755-25831754 |
| 客户服务电话：95358 | 网址：www.firstcapital.com.cn |
| (23) 东莞证券有限责任公司 | |
| 注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号 | |
| 办公地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼 | |
| 法定代表人：张运勇 | 联系人：乔芳 |
| 电话：0769-22112062 | 传真：0769-22119423 |
| 客户服务电话：0769-961130 | 网址：www.dgzq.com.cn |
| (24) 东吴证券股份有限公司 | |
| 注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号 | |
| 办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号 | |
| 法定代表人：范力 | 联系人：陆晓 |
| 电话：0512-62938521 | 传真：0512-65588021 |
| 客户服务电话：400 860 1555 | 网址：www.dwzq.com.cn |
| (25) 光大证券股份有限公司 | |
| 注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号 | |
| 办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 | |
| 法定代表人：周健男 | 联系人：龚俊涛 |
| 电话：021-22169999 | 传真：021-22169134 |
| 客户服务电话：95525 | 网址：www.ebscn.com |
| (26) 广州证券股份有限公司 | |
| 注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 | |
| 办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼 | |
| 法定代表人：胡伏云 | 联系人：梁微 |
| 电话：020-88836999 | 传真：020-88836654 |
| 客户服务电话：95396 | 网址：www.gzs.com.cn |
| (27) 华福证券有限责任公司 | |
| 注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层 | |
| 办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层 | |
| 法定代表人：黄金琳 | 联系人：张腾 |
| 电话：0591-87383623 | 传真：0591-87383610 |
| 客户服务电话：95547 | 网址：www.hfzq.com.cn |
| (28) 广发证券股份有限公司 | |
| 注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼 | |

| | |
|--------------------------------------|----------------------|
| 办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼 | |
| 法定代表人：孙树明 | 联系人：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 |
| | |
| (29) 国都证券股份有限公司 | |
| 注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 | |
| 办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 | |
| 法定代表人：王少华 | 联系人：李弢 |
| 电话：010-84183389 | 传真：010-84183311-3389 |
| 客户服务电话：400-818-8118 | 网址：www.guodu.com |
| | |
| (30) 国金证券股份有限公司 | |
| 注册地址：成都市东城根上街 95 号 | |
| 办公地址：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 |
| | |
| (31) 国联证券股份有限公司 | |
| 注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号 | |
| 办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702 | |
| 法定代表人：雷建辉 | 联系人：沈刚 |
| 电话：0510-82831662 | 传真：0510-82830162 |
| 客户服务电话：95570 | 网址：www.glsc.com.cn |
| | |
| (32) 国盛证券有限责任公司 | |
| 注册地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦） | |
| 办公地址：南昌市北京西路 88 号（江信国际金融大厦） | |
| 法定代表人：马跃进 | 联系人：俞驰 |
| 电话：0791-86283080 | 传真：0791-86288690 |
| 客户服务电话：4008-222-111 | 网址：www.gsstock.com |
| | |
| (33) 国泰君安证券股份有限公司 | |
| 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号 | |
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼 | |
| 法人代表人：杨德红 | 联系人：芮敏祺 |
| 电话：95521 | 传真：021-38670666 |
| 客户服务热线：4008888666 | 网址：www.gtja.com |
| | |
| (34) 国信证券股份有限公司 | |
| 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 | |
| 办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 | |

| | |
|-----------------------------------|----------------------|
| 法定代表人：何如 | 联系人：李颖 |
| 电话：0755-82130833 | 传真：0755-82133952 |
| 客户服务电话：95536 | 网址：www.guosen.com.cn |
| (35) 国元证券股份有限公司 | |
| 注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号 | |
| 办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号 | |
| 法定代表人：凤良志 | 联系人：李飞 |
| 电话：05551-2615542 | 传真：0551-2634906 |
| 客户服务电话：955784008-888-777 | 网址：www.gyzq.com.cn |
| (36) 海通证券股份有限公司 | |
| 注册地址：上海市淮海中路 98 号 | |
| 办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦 | |
| 法定代表人：王开国 | 联系人：李笑鸣 |
| 电话：021-23219000 | 传真：021-23219100 |
| 客户服务电话：400-8888-001 或 95553 | 网址：www.htsec.com |
| (37) 华安证券股份有限公司 | |
| 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 | |
| 办公地址：合肥市蜀山区南二环 959 号 B1 座华安证券 | |
| 法定代表人：李工 | 联系人：汪燕 |
| 电话：0551-5161666 | 传真：0551-5161600 |
| 客户服务电话：96518、400-80-96518 | 网址：www.hazq.com |
| (38) 华宝证券有限责任公司 | |
| 注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层 | |
| 办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层 | |
| 法定代表人：陈林 | 联系人：刘闻川 |
| 电话：021-68777222 | 传真：021-68777822 |
| 客户服务电话：400-820-9898 | 网址：www.cnhbstock.com |
| (39) 华龙证券股份有限公司 | |
| 注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富大厦 21 楼 | |
| 办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号 19 楼 | |
| 法定代表人：陈牧原 | 联系人：范坤 |
| 电话：0931-4890208 | 传真：0931-4890628 |
| 客户服务电话：95368、4006898888 | 网址：www.hlzq.com |
| (40) 华泰证券股份有限公司 | |
| 注册地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 | |
| 办公地址：南京市中山东路 90 号华泰证券大厦 | |
| 法定代表人：吴万善 | 联系人：郭琳 |

| | |
|--|--|
| 电话：025-83290979 | 传真：025-84579763 |
| 客户服务电话：95597 | 网址：www.htsc.com.cn |
| (41) 江海证券有限公司 | |
| 注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 | |
| 办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号 | |
| 法定代表人：孙名扬 | 联系人：高悦铭 |
| 电话：0451-82336863 | 传真：0451-82287211 |
| 客户服务电话：400-666-2288 | 网址：www.jhzq.com.cn |
| (42) 中航证券有限公司 | |
| 注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼 | |
| 办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼 | |
| 法定代表人：王宜四 | 联系人：戴蕾 |
| 电话：0791-86768681 | 传真：0791-86770178 |
| 客户服务电话：400-8866-567 | 网址：www.avicsec.com |
| (43) 平安证券股份有限公司 | |
| 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 |
| (44) 中泰证券股份有限公司 | |
| 注册地址：济南市市中区经七路 86 号 | |
| 办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号 | |
| 法定代表人：李玮 | 联系人：秦雨晴 |
| 电话：021-20315197 | 传真：021-20315125 |
| 客户服务电话：95538 | 网址：www.zts.com.cn |
| (45) 上海证券有限责任公司 | |
| 注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼 | |
| 办公地址：上海市西藏中路 336 号 | |
| 法定代表人：李俊杰 | 联系人：许曼华 |
| 电话：021-53686888 | 传真：021-53686100-7008、 021-53686200-7008 |
| 客户服务电话：4008918918 | 网址：www.shzq.com |
| (46) 申万宏源证券有限公司 | |
| 注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 | |
| 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层 | |
| 法定代表人：李梅 | 联系人：黄莹 |

| | |
|-----------------------------------|-------------------|
| 电话：021-33389888 | 传真：021-33388224 |
| 客户服务电话：95523 或 4008895523 | 网址：www.swhysc.com |
| | |
| (47) 天风证券股份有限公司 | |
| 注册地址：中国湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼 | |
| 办公地址：中国湖北省武汉市武昌区中南路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 |
| | |
| (48) 天相投资顾问有限公司 | |
| 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 | |
| 办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层 | |
| 法定代表人：林义相 | 联系人：谭磊 |
| 电话：010-66045182 | 传真：010-66045518 |
| 客户服务电话：010-66045678 | 网址：www.txsec.com |
| | |
| (49) 西藏东方财富证券股份有限公司 | |
| 注册地址：拉萨市北京中路101号 | |
| 办公地址：上海市永和路118弄东方企业园24号 | |
| 法定代表人：贾绍君 | 联系人：汪尚斌 |
| 电话：021-36533017 | 传真：021-36533017 |
| 客户服务电话：400-8811-177 | 网址：www.xzsec.com |
| | |
| (50) 湘财证券有限责任公司 | |
| 注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼 | |
| 办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心11楼 | |
| 法定代表人：林俊波 | 联系人：钟康莺 |
| 电话：021-68634518 | 传真：021-68865680 |
| 客户服务电话：400-888-1551 | 网址：www.xcsc.com |
| | |
| (51) 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 |
| | |
| (52) 招商证券股份有限公司 | |
| 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层 | |
| 办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层 | |
| 法定代表人：宫少林 | 联系人：黄婵君 |
| 电话：0755-82960223 | 传真：0755-82943121 |

| | | |
|--|--------------------------|----------------------|
| 客户服务电话：95565 或 400-8888-111 | | 网址：www.newone.com.cn |
| (53) 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 | |
| (54) 中国银河证券股份有限公司 | | |
| 注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层 | | |
| 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 | | |
| 法定代表人：陈共炎 | 联系人：辛国政 | |
| 电话：010-83574507 | 传真：010-83574807 | |
| 客户服务电话：4008-888-888 或 95551 | 网址：www.chinastock.com.cn | |
| (55) 中信建投证券股份有限公司 | | |
| 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 | | |
| 办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号 | | |
| 法定代表人：王常青 | 联系人：张颢 | |
| 电话：010-85130588 | 传真：010-65182261 | |
| 客户服务电话：400-8888-108 | 网址：www.csc108.com | |
| (56) 中信证券股份有限公司 | | |
| 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 | | |
| 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 | | |
| 法定代表人：王东明 | 联系人：侯艳红 | |
| 电话：010-60838888 | 传真：010-60833739 | |
| 客户服务电话：95558 | 网址：www.citics.com | |
| (57) 中信证券（山东）有限责任公司 | | |
| 注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 | | |
| 办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层 | | |
| 法定代表人：姜晓林 | 联系人：焦刚 | |
| 电话：0531-89606166 | 传真：0532-85022605 | |
| 客户服务电话：95548 | 网址：http://sd.citics.com/ | |
| (58) 中山证券有限责任公司 | | |
| 注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层 | | |
| 办公地址：深圳市福田区莲花街道益田路 6013 号江苏大厦 B 座 15 楼 | | |
| 法定代表人：吴永良 | 联系人：罗艺琳 | |
| 电话：0755-83734659 | 传真：0755-82960582 | |
| 客户服务电话：95329 | 网址：www.zszq.com.cn | |

| | |
|---------------------------------------|----------------------|
| (59) 信达证券股份有限公司 | |
| 注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 | |
| 办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 | |
| 法定代表人：张志刚 | 联系人：鹿馨方 |
| 电话：010-63081000 | 传真：010-63080978 |
| 客服热线：95321 | 网址：www.cindasc.com |
| (60) 西南证券股份有限公司 | |
| 注册地址：重庆市江北区桥北苑8号 | |
| 办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦 | |
| 法定代表人：廖庆轩 | 联系人：周青 |
| 电话：023-63786633 | 传真：023-67616310 |
| 客服热线：95355、4008096096 | 网址：www.swsc.com.cn |
| (61) 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 |
| (62) 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 |
| (63) 诺亚正行基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 | |
| 办公地址：上海市杨浦区长阳路1687号2号楼 | |
| 法定代表人：汪静波 | 联系人：李娟 |
| 电话：021-38602377 | 传真：021-38509777 |
| 客户服务电话：400-821-5399 | 网址：www.noah-fund.com |
| (64) 上海好买基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室 | |
| 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室 | |
| 法定代表人：杨文斌 | 联系人：徐超逸 |
| 电话：021-20613988 | 传真：021-68596916 |
| 客户服务电话：4007009665 | 网址：www.ehowbuy.com |
| (65) 和讯信息科技有限公司 | |

| | |
|---|-----------------------|
| 注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室 | |
| 办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层 | |
| 法定代表人：王莉 | 联系人：陈慧慧 |
| 电话：010-85657353 | 传真：010-65884788 |
| 客户服务电话：400-920-0022 | 网址：www.licaikexun.com |
| | |
| (66) 上海天天基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层 | |
| 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦 | |
| 法定代表人：其实 | 联系人：朱钰 |
| 电话：021-54509998 | 传真：021-64385308 |
| 客户服务电话：400-1818-188 | 网址：fund.eastmoney.com |
| | |
| (67) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司 | |
| 注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809 | |
| 办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 | |
| 法定代表人：沈伟桦 | 联系人：程刚 |
| 电话：010-52855713 | 传真：010-85894285 |
| 客户服务电话：4006099400 | 网址：www.yixinfund.com |
| | |
| (68) 浙江同花顺基金销售有限公司 | |
| 注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室 | |
| 办公地址：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：凌顺平 | 联系人：吴强 |
| 电话：0571-88911818 | 传真：0571-86800423 |
| 客户服务电话：4008-773-772 | 公司网站：www.5ifund.com |
| | |
| (69) 上海汇付基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元 | |
| 办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋 | |
| 法定代表人：金佶 | 联系人：甄宝林 |
| 电话：021-34013996-3011 | 传真： |
| 客户服务电话：021-34013999 | 网址：www.hotjjin.com |
| | |
| (70) 上海陆金所基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元 | |
| 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 | |
| 法定代表人：郭坚 | 联系人：宁博宇 |
| 电话：021-20665952 | 传真：021-22066653 |
| 客户服务电话：4008219031 | 网址：www.lufunds.com |
| | |
| (71) 大泰金石基金销售有限公司 | |
| 注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室 | |

| | |
|--|------------------------------|
| 办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼 | |
| 法定代表人：袁顾明 | 联系人：朱真卿 |
| 电话：021-22267943 | 传真：021-22268089 |
| 客户服务电话：400-928-2266 | 网址：www.dtfunds.com |
| (72) 上海联泰基金销售有限公司 | |
| 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室 | |
| 办公地址：上海长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 楼 | |
| 法定代表人：燕斌 | 联系人：陈东 |
| 电话：021-52822063 | 传真：021-52975270 |
| 客户服务电话：400-046-6788 | 网址：www.66zichan.com |
| (73) 海银基金销售有限公司 | |
| 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室 | |
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼 | |
| 法定代表人：惠晓川 | 联系人：毛林 |
| 电话：021-80133597 | 传真：021-80133413 |
| 客户服务电话：4008081016 | 网址：www.fundhaiyin.com |
| (74) 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 |
| (75) 上海利得基金销售有限公司 | |
| 注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室 | |
| 办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼 | |
| 法定代表人：李兴春 | 联系人：徐鹏 |
| 电话：86-021-50583533 | 传真：86-021-50583633 |
| 客户服务电话：400-921-7755 | 网站：http://a.leadfund.com.cn/ |
| (76) 珠海盈米基金销售有限公司 | |
| 注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491 | |
| 办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203 | |
| 法定代表人：肖雯 | 联系人：邱湘湘 |
| 电话：020-89629099 | 传真：020-89629011 |
| 客户服务电话：020-89629066 | 网站：www.yingmi.cn |
| (77) 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.hcjjin.com |
| (78) 财通证券股份有限公司 | |
| 注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 | |
| 办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716 | |
| 法定代表人：陆建强 | 联系人：陶志华 |
| 电话：0571-87789160 | 传真：0571-87818329 |
| 客户服务电话：95336, 40086-96336 | 网站：www.ctsec.com |
| (79) 上海华夏财富投资管理有限公司 | |
| 注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室 | |
| 办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层 | |
| 法定代表人：李一梅 | 联系人：仲秋玥 |
| 电话：010-88066632 | 传真：010-88066552 |
| 客户服务电话：4008175666 | 网站：www.amcfortune.com |
| (80) 和谐保险销售有限公司 | |
| 注册地址：北京市朝阳区东三环中路55号楼20层2302 | |
| 办公地址：北京市朝阳区建国门外大街6号安邦金融中心 | |
| 法定代表人：蒋洪 | 联系人：张楠 |
| 电话：010-85256214 | |
| 客户服务电话：4008195569 | 网站：www.hx-sales.com |
| (81) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司 | |
| 注册地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 | |
| 办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 | |
| 法定代表人：吴雪秀 | 联系人：徐越 |
| 电话：010-88312877-8032 | 传真：010-88312099 |
| 客户服务电话：400-001-1566 | 网站：www.yilucaifu.com |
| (82) 嘉实财富管理有限公司 | |
| 注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元 | |
| 办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层 | |
| 法定代表人：赵学军 | 联系人：王宫 |
| 电话：021-38789658 | 传真：021-68880023 |
| 客户服务电话：400-600-8800 | 网站：www.jsfund.cn |
| (83) 北京蛋卷基金销售有限公司 | |
| 注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 | |

| | |
|--|---|
| 办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 | |
| 法定代表人：钟斐斐 | 联系人：侯芳芳 |
| 电话：010-61840688 | 传真：010-61840699 |
| 客户服务电话：400-1599-288 | 网站：www.danjuanapp.com |
| (84) 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 |
| (85) 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 |
| (86) 腾安基金销售（深圳）有限公司 | |
| 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） | |
| 办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦 | |
| 法定代表人：刘明军 | 联系人：刘鸣 |
| 电话：0755-86013388-77386 | 传真： |
| 客户服务电话：95017（拨通后转1转8） | 网站：www.tenganxinxi.com、 www.txfund.com |
| (87) 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 |
| 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 | |

长信量化先锋混合型证券投资基金C类份额销售机构：

| |
|-----------------------------|
| 1、直销中心：长信基金管理有限责任公司 |
| 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼 |

| | |
|---------------------------------|------------------------|
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼 | |
| 法定代表人：成善栋 | 联系人：陈竹君 |
| 电话：021-61009916 | 传真：021-61009917 |
| 客户服务电话：400-700-5566 | 公司网站：www.cxfund.com.cn |
| 2、场外代销机构 | |
| (1) 招商银行股份有限公司 | |
| 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| 办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 | |
| 法定代表人：李建红 | 联系人：季平伟 |
| 电话：0755-83198888 | 传真：0755-83195109 |
| 客户服务电话：95555 | 网址：www.cmbchina.com |

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

(二) 其他相关机构

| 信息类型 | A 类份额注册 登记机构 | C 类份额注册登 记机构 | 律师事务所 | 会计师事务所 |
|-----------|-------------------------|---------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| 名称 | 中国证券登记 结算有限责任 公司 | 长信基金管理 有限责任公司 | 上海源泰律师事务所 | 德勤华永会计师事务 所（特殊普通合伙） |
| 注册地址 | 北京市西城区 太平桥大街 17 号 | 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 | 上海市黄浦区延安东 路 222 号 30 楼 |
| 办公地址 | 北京市西城区 太平桥大街 17 号 | 上海市浦东新 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 | 上海市黄浦区延安东 路 222 号 30 楼 |
| 法定代表 人 | 周明 | 成善栋 | 廖海（负责人） | 曾顺福 |
| 联系电话 | 010-59378856 | 021-61009999 | 021-51150298 | 021-61418888 |
| 传真 | 010-59378907 | 021-61009800 | 021-51150398 | 021-61411909 |
| 联系人 | 崔巍 | 孙红辉 | 廖海、刘佳 | 曾浩（曾浩、吴凌志 为经办注册会计师） |

四、基金的名称

长信量化先锋混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的投资目标

本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。

七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，权证投资比例范围为基金资产净值的 0%-3%，债券、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的 5%-40%，其中现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的 80%。

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

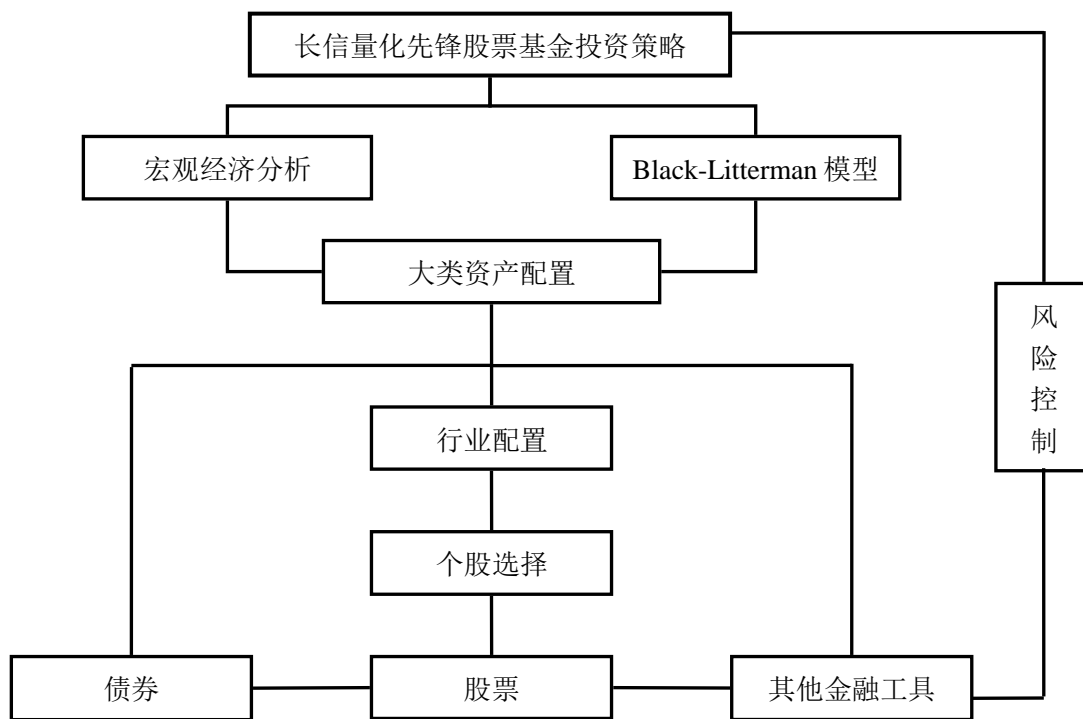
八、基金的投资策略

本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，并利用数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股选择全程数量化的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。

本基金的投资策略包括两部分：一是通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化整个组合的风险

收益参数；二是通过自下而上的上市公司研究，借助长信行业多因素选股模型选取具有投资价值的上市公司股票。

本基金投资策略的基本框架如下：



图：本基金投资策略基本框架

1、大类资产配置策略

本基金采用“自上而下”的资产配置方法，运用在国际资产配置决策领域广泛应用的 Black-Litterman 模型确定本基金资产在股票、债券及其他金融工具等类别资产间的分配比例。在具体的资产配置过程中，通过把握宏观经济增长的长期趋势，短期的经济周期波动以及政策导向，判断各类资产的风险程度和收益特征，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，合理调整股票资产、债券资产和其他金融工具的比例，以达到控制风险、增加收益的目的。

2、股票投资策略

本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的数量化选股策略，在纪律化模型约束下，紧密跟踪策略，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，从而取得较高的收益。

(1) 行业配置

本基金所构建的股票投资组合在行业配置方面仍然采用 Black-Litterman

模型确定各行业的投资权重。Black-Litterman 模型基于市场均衡状态下各行业隐含的超额收益率和市场权重，融入基金管理人对各行业的预期收益观点，在基金整体风险水平可控的前提下，实现各行业的合理配置和优化。

具体来讲，由于本基金的行业划分采用申银万国一级行业分类体系，因此 23 个一级行业隐含的超额收益率及市场权重可由各行业历史收益率以及当前的市值权重计算得出。此外，基金管理人通过上中下游行业跟踪分析、积极型行业和防御型行业轮动特点的趋势研究，形成本基金行业配置量化的预期收益观点。最后，Black-Litterman 模型采用贝叶斯方法把隐含的超额收益率和观点收益结合起来，对均衡的市场权重进行调节，使得组合达到最优的预期风险收益。

本基金将结合 Black-Litterman 模型给出的行业配置权重，确定股票组合中每只股票的配置比例。

（2）个股选择

本基金在确定行业配置权重后运用长信行业多因素选股模型进行个股的选择。个股选择分为股票库的建立和个股的精选两个部分。

A、股票库的建立

本基金利用反映估值水平的财务指标对全部 A 股上市公司股票进行筛选，通过对估值指标（PE、PB、PCF 等）为负值或异常值的股票的剔除，构建本基金股票库。本基金股票库定期进行调整，原则上每三个月调整一次。

B、个股精选

考虑到二级市场业绩驱动的复杂性，长信行业多因素选股模型基于对申银万国一级行业运行特征的长期跟踪研究以及大量历史数据的实证检验，选取出对 A 股股价具有较强影响的四类因子，分别是价值因子、成长因子、基本面因子和市场因子。

价值因子考虑市盈率（PE）、市净率（PB）、市现率（PCF）、股息率、净资产收益率（ROE）等指标；

成长因子考虑主营收入增长率、净利润增长率、预期每股收益（EPS）、预期每股收益（EPS）增长率、PEG 等指标；

基本面因子考虑销售毛利率、息税前利润/营业总收入、营业总成本/营业总收入、总资产周转率等指标；

市场因子考虑个股收益率的动量和反转等指标。

长信行业多因素选股模型通过对个股历史数据及一致预期数据的实证检验以及对行业景气周期的考量，利用聚类分析、横截面数据与面板数据分析、遗传算法等量化技术考察上述四类因子对申银万国一级行业分类体系下各行业的影响，从而确定行业内部各因子的重要性顺序，并按照此顺序对各行业股票进行分步筛选来确定股票投资名单。当股票投资组合名单及行业配置权重确定后，本基金将通过个股权重的优化来构建本基金股票资产的投资组合。其中，优化权重的目标是使股票投资组合的风险调整后收益最大化。当股票投资组合构建完成后，基金管理人会进一步根据组合内个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期优化个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。

3、债券投资策略

本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

4、权证投资策略

本基金在证监会允许的范围内适度投资权证，投资原则为有利于基金资产增值和加强基金风险控制。权证的选择是一个全面综合考虑的过程，本基金对权证的投资将以控制投资风险为主，适当采用以下方式进行投资。

(1) 通过对权证标的证券的基本面研究，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值并结合期权定价模型估计权证价值；

(2) 在对权证价值分析的基础上，根据权证的溢价率和隐含波动率等指标，寻找溢价率低的权证，降低风险和提高潜在的收益；

(3) 在考虑权证价值、溢价率、隐含波动率的基础上，重点考察权证的流动性风险，使其流动性与基金的规模相匹配，进行合理的配置。

九、基金的业绩比较基准

1、本基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准为中证综合债券指数，本基金的业绩比较基准为复合指数：

沪深 300 指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%

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

2、选择业绩比较基准的理由

沪深 300 指数是国内股票市场广受投资者关注的市场指数之一，指数本身对国内股票市场的走势有很强的代表性和广泛的影响力，可以较好地表征市场平均收益水平。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。该指数旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，因此该指数是本基金较为切合的市场基准选择。

十、基金的风险收益特征

2015 年 8 月 7 日起本基金更名为长信量化先锋混合型证券投资基金，本基金的风险收益特征由“本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。”改为“本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。”

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 6 月复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 3 月 31 日（摘自本基金 2019 年 1 季报），本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 2,568,337,075.21 | 93.58 |
| | 其中：股票 | 2,568,337,075.21 | 93.58 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 120,808,769.50 | 4.40 |
| | 其中：债券 | 120,808,769.50 | 4.40 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 42,427,478.13 | 1.55 |
| 8 | 其他资产 | 13,056,319.53 | 0.48 |
| 9 | 合计 | 2,744,629,642.37 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 5,541.06 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 41,340,324.00 | 1.51 |
| C | 制造业 | 1,700,419,135.91 | 62.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 81,912,787.76 | 3.00 |
| E | 建筑业 | 63,548,476.95 | 2.33 |
| F | 批发和零售业 | 86,482,340.42 | 3.17 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 60,144,324.39 | 2.20 |
| H | 住宿和餐饮业 | 24,108,275.57 | 0.88 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 207,708,197.63 | 7.60 |
| J | 金融业 | 50,836,391.10 | 1.86 |
| K | 房地产业 | 122,930,277.70 | 4.50 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 14,460,598.14 | 0.53 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 23,800,547.40 | 0.87 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 23,675,818.32 | 0.87 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 66,964,038.86 | 2.45 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,568,337,075.21 | 94.01 |

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 600031 | 三一重工 | 3,760,000 | 48,052,800.00 | 1.76 |
| 2 | 002674 | 兴业科技 | 2,400,080 | 34,345,144.80 | 1.26 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 947,200 | 32,242,688.00 | 1.18 |
| 4 | 002376 | 新北洋 | 1,800,000 | 31,770,000.00 | 1.16 |
| 5 | 603636 | 南威软件 | 2,142,048 | 29,453,160.00 | 1.08 |
| 6 | 002146 | 荣盛发展 | 2,576,165 | 28,981,856.25 | 1.06 |
| 7 | 600845 | 宝信软件 | 868,334 | 28,516,088.56 | 1.04 |
| 8 | 603869 | 新智认知 | 1,258,912 | 27,973,024.64 | 1.02 |
| 9 | 300130 | 新国都 | 1,600,360 | 27,862,267.60 | 1.02 |
| 10 | 002653 | 海思科 | 1,885,854 | 27,816,346.50 | 1.02 |

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 120,082,000.00 | 4.40 |
| | 其中：政策性金融债 | 120,082,000.00 | 4.40 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|----------------|------|
| 7 | 可转债（可交换债） | 726,769.50 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 120,808,769.50 | 4.42 |

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 180410 | 18 农发 10 | 1,000,000 | 100,080,000.00 | 3.66 |
| 2 | 018005 | 国开 1701 | 200,000 | 20,002,000.00 | 0.73 |
| 3 | 128035 | 大族转债 | 6,610 | 726,769.50 | 0.03 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 499,694.65 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,992,599.52 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,751,558.49 |
| 5 | 应收申购款 | 1,812,466.87 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,056,319.53 |

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 128035 | 大族转债 | 726,769.50 | 0.03 |

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2019年1季度及历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

长信量化先锋混合 A

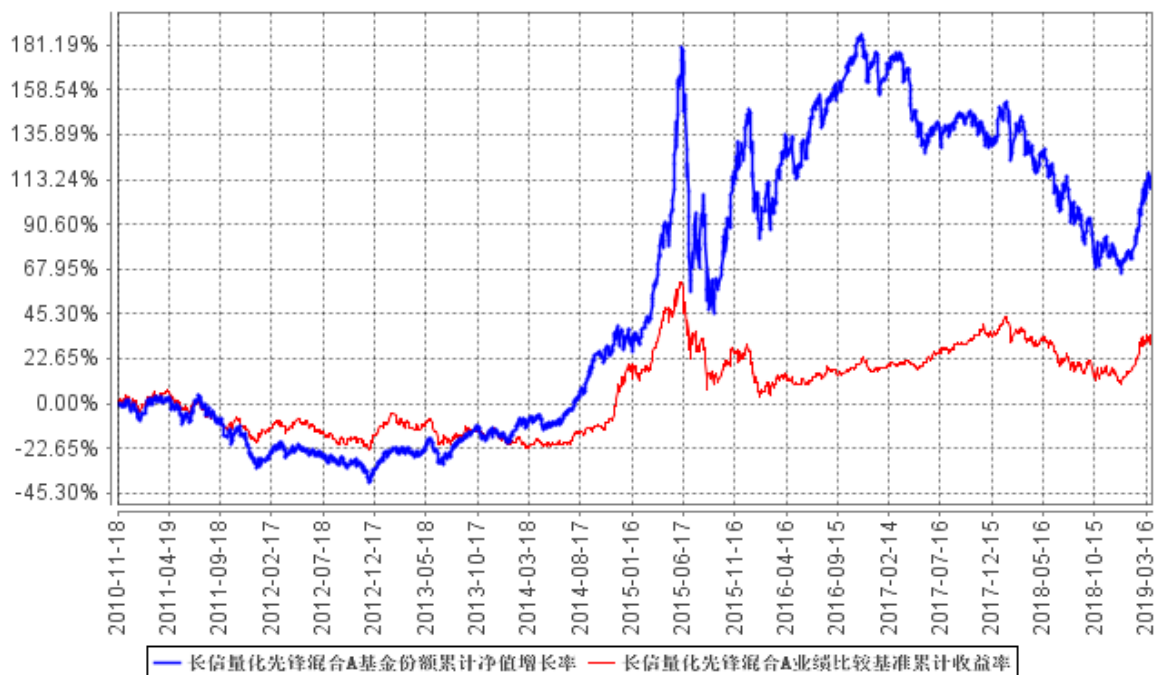
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------------------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 2010年11月18日-2010年12月31日 | -1.40% | 0.77% | 0.69% | 1.02% | -2.09% | -0.25% |
| 2011年 | -27.89% | 1.33% | -18.00% | 0.98% | -9.89% | 0.35% |
| 2012年 | -0.42% | 1.19% | 6.95% | 0.96% | -7.37% | 0.23% |
| 2013年 | 19.92% | 1.16% | -5.48% | 1.05% | 25.40% | 0.11% |
| 2014年 | 57.83% | 1.14% | 40.36% | 0.91% | 17.47% | 0.23% |
| 2015年 | 84.03% | 2.73% | 7.71% | 1.86% | 76.32% | 0.87% |
| 2016年 | 10.52% | 1.64% | -7.69% | 1.05% | 18.21% | 0.59% |
| 2017年 | -13.74% | 0.89% | 16.11% | 0.48% | -29.85% | 0.41% |
| 2018年 | -27.59% | 1.47% | -17.72% | 1.00% | -9.87% | 0.47% |
| 2019年1月1日-2019年3月31日 | 26.15% | 1.41% | 21.35% | 1.16% | 4.80% | 0.25% |

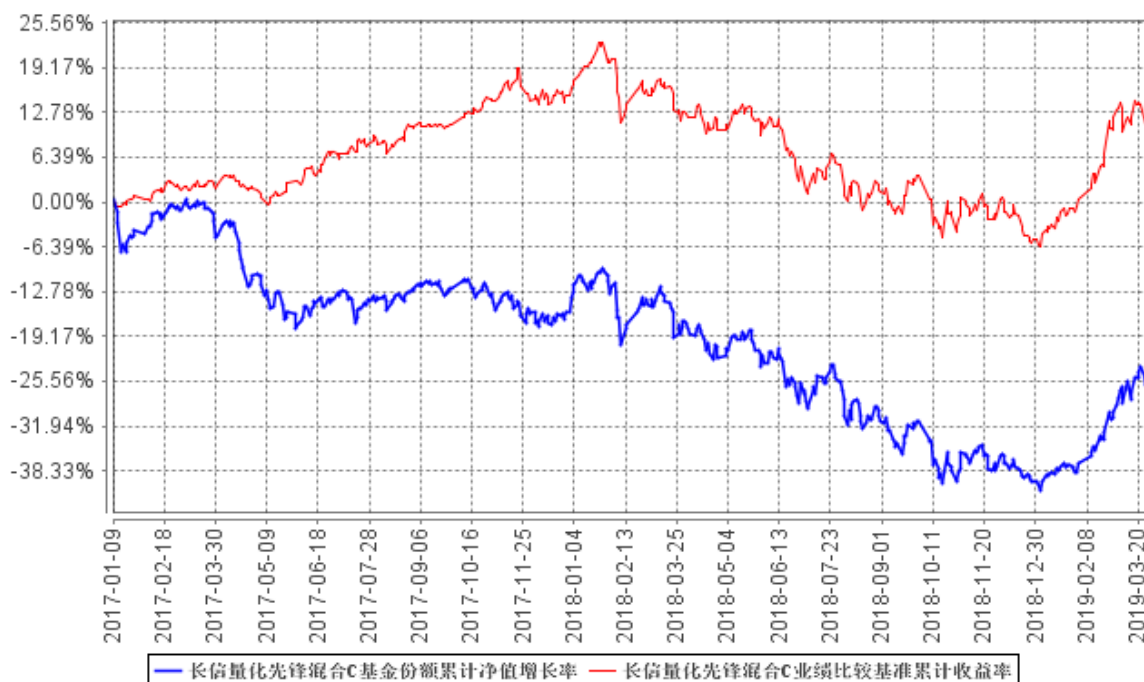
长信量化先锋混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|------------------------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 2017年1月9日（份额增加日）-2017年12月31日 | -15.71% | 0.89% | 15.14% | 0.48% | -30.85% | 0.41% |
| 2018年 | -28.49% | 1.48% | -17.72% | 1.00% | -10.77% | 0.48% |
| 2019年1月1日-2019年3月31日 | 25.81% | 1.40% | 21.35% | 1.16% | 4.46% | 0.24% |

自合同生效之日/份额增加日至2019年3月31日期间，本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比：





注：1、长信量化先锋混合 A 图示日期为 2010 年 11 月 18 日至 2019 年 3 月 31 日，长信量化先锋混合 C 图示日期为 2017 年 1 月 9 日（份额增加日）至 2019 年 3 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例符合基金合同中的约定。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费率为年费率 1.50%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费率为年费率 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费率年费率为 1.00%。

在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核无误后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中支付到指定账户。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

(1) 场外申购费用

本基金 A 类基金份额收取基金申购费用；C 类基金份额不收取申购费。投资者可选择在申购或赎回本基金 A 类基金份额时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的费用称为前端申购费用，投资者选择在赎回时交纳的费用称为后

端申购费用。

投资者选择前端申购费用时，按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

| 基金份额类别 | 申购金额 (M, 含申购费) | 前端申购费率 |
|---------|--|----------|
| A 类基金份额 | $M < 100$ 万 | 1.5% |
| | $100 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$ | 1.0% |
| | $500 \text{ 万} \leq M$ | 1000 元每笔 |

注：M 为申购金额

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

| 基金份额类别 | 持有年限 (N, 年) | 后端申购费率 |
|---------|------------------------------------|--------|
| A 类基金份额 | $N < 1$ 年 | 1.8% |
| | $1 \text{ 年} \leq N < 3 \text{ 年}$ | 1.2% |
| | $3 \text{ 年} \leq N < 5 \text{ 年}$ | 0.6% |
| | $5 \text{ 年} \leq N$ | 0 |

注：N 为持有年限

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

(2) 场内申购费用

投资者在场内申购本基金 A 类基金份额时缴纳申购费用。本基金 A 类基金份额的场内申购费率与上述规定的场外前端申购费率一致。

2、赎回费用

本基金 A、C 类基金份额收取不同的赎回费，赎回费用在投资者赎回基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，两类份额具体费率如下：

| 基金份额类别 | 持有时间 (N, 年) | 赎回费率 |
|---------|------------------------------------|-------|
| A 类基金份额 | $N < 7$ 日 | 1.5% |
| | $7 \text{ 日} \leq N < 1 \text{ 年}$ | 0.5% |
| | $1 \text{ 年} \leq N < 2 \text{ 年}$ | 0.2% |
| | $2 \text{ 年} \leq N$ | 0 |
| C 类基金份额 | $N < 7$ 天 | 1.50% |

| | | |
|--|------------------|-------|
| | 7天 \leq N<30天 | 0.75% |
| | 30天 \leq N<6个月 | 0.25% |
| | N \geq 6个月 | 0 |

注：N为持有年限

针对 A 类基金份额：对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费应全额计入基金财产，其余不低于所收取的赎回费总额的 25% 归基金财产；针对 C 类基金份额：对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，不计入基金财产。其余用于支付市场推广费、注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金的转换费

本公司已开通了长信量化先锋混合基金 A 类份额（A 类代码：519983）与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）（非直销渠道）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信增利动态策略混合基金（前端代码：519993）、长信利丰债券基金 C 类份额（C 类代码：519989）、长信双利优选混合基金 A 类份额（A 类代码：519991）、长信恒利优势混合基金、长信纯债壹号债券基金 A 类份额（A 类代码：519985）、长信内需成长混合基金 A 类份额（A 类代码：519979）、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金 A 类份额（A 类代码：519965）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金、长信利泰混合基金、长信利保债券基金、长信先锐债券基金、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利信混合基金（A 类代码：519949）、长信上证港股通指数型发起式基金、长信先优债券基金、长信中证 500 指数基金、长信乐信混合基金（非直销渠道）、长信低碳环保量化股票基金、长信消费精选股票基金（非直销渠道）、长信价值优选混合基金之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

本公司已开通了长信量化先锋混合基金 C 类份额（C 类代码：004221）与长信长金通货币基金 A、B 级份额（A 级代码：005134；B 级代码：005135）、长信沪深 300 指数基金 A 类份额（A 类代码：005137）、长信国防军工量化混

合基金、长信稳健纯债基金、长信稳益纯债基金、长信稳势纯债基金、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）、长信利丰债券基金 E 类份额（E 类代码：004651）、长信消费精选股票基金（直销渠道）、长信量化多策略股票基金 C 类份额（C 类代码：004858）、长信量化价值驱动混合基金、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）之间的双向转换，具体可办理转换业务的销售机构详见本公司公告。

本公司于 2017 年 6 月 30 日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信上证港股通指数型发起式证券投资基金暂停转换转出和转换转入业务的公告》，自 2017 年 7 月 4 日起，暂停长信上证港股通指数型发起式基金的转换转入和转换转出业务。

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

A、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。

B、转换份额的计算公式：

（a）非货币基金之间转换

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

（若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零）

（b）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

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

(货币基金份额净值为 1.00 元, 没有赎回费)

(c) 非货币基金转至货币基金

$$\text{转出确认金额} = \text{转出份额} \times \text{转出基金份额净值}$$
$$\text{赎回费} = \text{转出确认金额} \times \text{赎回费率}$$
$$\text{转入确认金额} = \text{转出确认金额} - \text{赎回费}$$
$$\text{转入确认份额} = \text{转入确认金额} \div \text{货币基金份额净值}$$

(货币基金份额净值为 1.00 元, 补差费为零)

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求, 结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动, 对本基金原招募说明书(《长信量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》)进行了更新, 主要更新的内容如下:

- 1、在“三、基金管理人”部分, 对基金管理人信息进行了更新;
- 2、在“四、基金托管人”部分, 更新了基金托管人信息;
- 3、在“五、相关服务机构”部分, 更新了销售机构的信息;
- 4、在“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分, 更新了基金的转换信息;
- 5、在“十、基金的投资组合报告”更新部分的相应内容;
- 6、在“十一、基金的业绩”更新部分相应内容;
- 7、在“二十三、其它应披露的事项”更新部分的相应内容。

长信基金管理有限责任公司

2019年7月1日