

## 长信利发债券型证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2019 年第【2】号

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

长信利发债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2016 年 4 月 21 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】886 号文注册募集。本基金合同于 2016 年 6 月 28 日正式生效。

### 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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于基金投资人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等。

本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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

本更新的招募说明书所载的内容截止日为 2019 年 6 月 28 日，有关财务数据和净值截止日为 2019 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司已经复核了本次更新的招募说明书。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

| 基金管理人概况 |                            |
|---------|----------------------------|
| 名称      | 长信基金管理有限责任公司               |
| 注册地址    | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼 |
| 办公地址    | 上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼       |
| 邮政编码    | 200120                     |
| 批准设立机关  | 中国证券监督管理委员会                |
| 批准设立文号  | 中国证监会证监基金字[2003]63 号       |
| 注册资本    | 壹亿陆仟伍佰万元人民币                |
| 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   | 成善栋                        |
| 电话      | 021-61009999               |

|      |                                                         |            |             |
|------|---------------------------------------------------------|------------|-------------|
| 传真   | 021-61009800                                            |            |             |
| 联系人  | 魏明东                                                     |            |             |
| 存续期间 | 持续经营                                                    |            |             |
| 经营范围 | 基金管理业务，发起设立基金，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】 |            |             |
| 股权结构 | <b>股东名称</b>                                             | <b>出资额</b> | <b>出资比例</b> |
|      | 长江证券股份有限公司                                              | 7350 万元    | 44.55%      |
|      | 上海海欣集团股份有限公司                                            | 5149.5 万元  | 31.21%      |
|      | 武汉钢铁有限公司                                                | 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。                |
| <b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b> |    |   |                                                                                         |

### 3、经理层成员

| 经理层成员 |      |    |                                                                                                                                                                                                        |
|-------|------|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 姓名    | 职务   | 性别 | 简历                                                                                                                                                                                                     |
| 覃波    | 总经理  | 男  | 简历同上。                                                                                                                                                                                                  |
| 周永刚   | 督察长  | 男  | 经济学硕士，EMBA。现任长信基金管理有限责任公司督察长。曾任湖北证券有限责任公司武汉自治街营业部总经理，长江证券有限责任公司北方总部总经理兼北京展览路证券营业部总经理，长江证券有限责任公司经纪业务总部副总经理兼上海代表处主任、上海汉口路证券营业部总经理。                                                                       |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 黄韵        | 绝对收益部总监、基金经理 | 自2018年3月24日起至今         | 经济学硕士，武汉大学金融学专业研究生毕业，具备基金从业资格。曾任职于三九企业集团；2006年加入长信基金管理有限责任公司，历任行业研究员、基金经理助理、长信恒利优势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。现任绝对收益部总监、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信乐信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、长信先优债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金和长信合利混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 朱垚        | 基金经理         | 自2019年5月16日起至今         | 复旦大学金融学专业硕士毕业。具有基金从业资格，2013年加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信基金管理有限责任公司研究发展部基金经理助理兼研究员，现任长信先优债券型证券投资基金、长信乐信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和长信合利混合型证券投资基金的基金经理。                                                                                                                                             |
| 左金保       | 基金经理         | 自2016年7月15日起至2019年3月9日 | 曾任本基金的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 朱轶伦       | 基金经理         | 自2017年5月24日起至          | 曾任本基金的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                              |

|                          |      |                          |             |
|--------------------------|------|--------------------------|-------------|
|                          |      | 2019年5月11日               |             |
| 李小羽                      | 基金经理 | 自基金合同生效之日起至2017年8月8日     | 曾任本基金的基金经理。 |
| 姜锡峰                      | 基金经理 | 自2016年7月28日起至2017年8月8日   | 曾任本基金的基金经理。 |
| 刘波                       | 基金经理 | 自2016年6月28日起至2016年12月22日 | 曾任本基金的基金经理。 |
| <b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b> |      |                          |             |

#### 5、投资决策委员会成员

| 投资决策委员会成员 |                                                                                                                                                                              |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 姓名        | 职务                                                                                                                                                                           |
| 覃波        | 总经理、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                                                                                                                                                                      |
| 张文珣       | 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货币市场基金的基金经理 |
| 陆莹        | 现金管理部总监、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                                                                                                                                                                              |
| <b>注：上述人员之间均不存在近亲属关系</b> |                                                                                                                                                                                                                                                                 |

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人概况

本基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

成立时间：1992 年 10 月 19 日

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

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

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 293.52 亿元人民币

存续期间： 持续经营

基金托管资格批文及文号： 中国证监会证监基金字[2003]105 号

联系人： 胡波

联系电话：（021）61618888

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

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

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

## （二）主要人员情况

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

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

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行计划处科员、副主任科员，国际业务部、工商信贷处科长，资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部党支部书记、资产托管部总经理。

### （三）基金托管业务经营情况

截止 2019 年 6 月 30 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 4260.70 亿元，比去年末增加 1.13%。托管证券投资基金共一百五十四只，分别为国泰金龙行业精选基金、国泰金龙债券基金、天治财富增长基金、广发小盘成长基金、汇添富货币基金、长信金利趋势基金、嘉实优质企业基金、国联安货币基金、长信利众债券基金（LOF）、博时安丰 18 个月基金（LOF）、易方达裕丰回报基金、鹏华丰泰定期开放基金、汇添富双利增强债券基金、华富恒财定开债券基金、汇添富和聚宝货币基金、工银目标收益一年定开债券基金、北信瑞丰宜投宝货币基金、中海医药健康产业基金、华富国泰民安灵活配置混合基金、安信动态策略灵活配置基金、东方红稳健精选基金、国联安鑫享混合基金、长安鑫利优选混合基金、工银瑞信生态环境基金、天弘新价值混合基金、嘉实机构快线货币基金、鹏华 REITs 封闭式基金、华富健康文娱基金、金鹰改革红利基金、易方达裕祥回报债券基金、中银瑞利灵活配置混合基金、华夏新活力混合基金、鑫元汇利债券型基金、南方转型驱动灵活配置基金、银华远景债券基金、富安达长盈灵活配置混合型基金、中信建投睿溢混合型证券投资基金、工银瑞信恒享纯债基金、长信利发债券基金、博时景发纯债基金、鑫元得利债券型基金、东方红战略沪港深混合基金、博时富发纯债基金、博时利发纯债基金、银河君信混合基金、汇添富保鑫保本混合基金、兴业启元一年定开债券基金、工银瑞信瑞盈 18 个月定开债券基金、中信建投稳裕定开债券基金、招商招怡纯债债券基金、中加丰享纯债债券基金、长安泓泽纯债债券基金、银河君耀灵活配置混合基金、广发汇瑞 3 个月定期

开放债券发起式证券投资基金、汇安嘉汇纯债债券基金、南方宣利定开债券基金、招商兴福灵活配置混合基金、博时鑫润灵活配置混合基金、兴业裕华债券基金、易方达瑞通灵活配置混合基金、招商招祥纯债债券基金、易方达瑞程混合基金、中欧骏泰货币基金、招商招华纯债债券基金、汇安丰融灵活配置混合基金、汇安嘉源纯债债券基金、国泰普益混合基金、汇添富鑫瑞债券基金、鑫元合丰纯债债券基金、博时鑫惠混合基金、国泰润利纯债基金、华富天益货币基金、汇安丰华混合基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒混合基金、景顺长城中证 500 指数基金、鹏华丰康债券基金、兴业安润货币基金、兴业瑞丰 6 个月定开债券基金、兴业裕丰债券基金、易方达瑞弘混合基金、长安鑫富领先混合基金、万家现金增利货币基金、上银慧增利货币市场基金、易方达瑞富灵活配置证券投资基金、博时富腾纯债债券型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选混合基金、万家天添宝货币基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、中银证券安弘债券基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券基金、广发高端制造股票型发起式基金、永赢永益债券基金、南方安福混合基金、中银证券聚瑞混合基金、太平改革红利精选灵活配置混合基金、富荣富乾债券型证券投资基金、国联安安稳灵活配置混合型证券投资基金、前海开源景鑫灵活配置混合型证券投资基金、前海开源润鑫灵活配置混合型证券投资基金、中海沪港深多策略灵活配置混合型基金基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、前海开源盛鑫灵活配置混合型证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、兴业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富国颐利纯债债券型证券投资基金、华安安浦债券型证券投资基金、南方泽元债券型证券投资基金、鹏扬淳利定期开放债券型证券投资基金、万家鑫悦纯债债券型基金、新疆前海联合泳祺纯债债券型证券投资基金、永赢盈益债券型证券投资基金、中加颐合纯债债券型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中银中债 3-5 年期农发行债券指数证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、平安惠锦纯债债券型证券投资基金、华夏鼎通债券型证券投资基金、鑫元全利债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、嘉实致盈债券型证券投资基金、永赢消费主题灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信瑞福纯债债券型证券投资基金、广发景智纯债债券型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置

混合型证券投资基金、广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、中欧瑾泰债券型证券投资基金、国寿安保安丰纯债债券型证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、博时中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、银河家盈纯债债券型证券投资基金、博时富永纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、南方畅利定期开放债券型发起式证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金、华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、永赢合益债券型证券投资基金、嘉实中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、广发港股通优质增长混合型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、中海信息产业精选混合型证券投资基金、民生加银恒裕债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债债券型证券投资基金、平安惠泰纯债债券型证券投资基金、中信建投景和中短债债券型证券投资基金、工银瑞信添慧债券型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、汇添富中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、南方旭元债券型发起式证券投资基金、大成中债 3-5 年国开行债券指数基金等。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

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

2、本行内部控制组织架构为：总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

3、内部控制制度及措施：本行已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆

盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

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

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督依据

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

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

##### 2、监督内容

我行根据基金合同及托管协议约定，对基金合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示基金管理人违规风险。

##### 3、监督方法

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

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

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

#### 4、监督结果的处理方式

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

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

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

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额销售机构

|                                 |                        |
|---------------------------------|------------------------|
| <b>1、直销中心：长信基金管理有限责任公司</b>      |                        |
| 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼 |                        |
| 办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼 |                        |
| 法定代表人：成善栋                       | 联系人：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 |
| <b>2、场外代销机构</b>                 |                        |
| <b>(1) 交通银行股份有限公司</b>           |                        |
| 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    |
| <b>(2) 招商银行股份有限公司</b>           |                        |

|                                |                            |
|--------------------------------|----------------------------|
| 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        |
|                                |                            |
| (3) 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         |
|                                |                            |
| (4) 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         |
|                                |                            |
| (5) 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         |
|                                |                            |
| (6) 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           |
|                                |                            |
| (7) 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 |
|                                |                            |
| (8) 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   |
|                                      |                      |
| (9) 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     |
|                                      |                      |
| (10) 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   |
|                                      |                      |
| (11) 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     |
|                                      |                      |
| (12) 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   |
|                                      |                      |
| (13) 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   |
|                                      |                      |
| (14) 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         |
|                                       |                         |
| (15) 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         |
|                                       |                         |
| (16) 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         |
|                                       |                         |
| (17) 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      |
|                                       |                         |
| (18) 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 |
|                                       |                         |
| (19) 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       |
|                                       |                         |
| (20) 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、<br>021-53686200-7008 |
| 客户服务电话：4008918918                     | 网址：www.shzq.com                            |
|                                       |                                            |
| (21) 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                          |
|                                       |                                            |
| (22) 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                            |
|                                       |                                            |
| (23) 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                           |
|                                       |                                            |
| (24) 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                         |
|                                       |                                            |
| (25) 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                       |
|                                       |                                            |
| (26) 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 |
|                                        |                          |
| (27) 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        |
|                                        |                          |
| (28) 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        |
|                                        |                          |
| (29) 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/ |
|                                        |                          |
| (30) 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       |
|                                        |                          |
| (31) 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       |
|                                        |                          |
| (32) 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 |
|                                            |                          |                    |
| (33) 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        |                    |
|                                            |                          |                    |
| (34) 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     |                    |
|                                            |                          |                    |
| (35) 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     |                    |
|                                            |                          |                    |
| (36) 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       |                    |
|                                            |                          |                    |
| (37) 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.licaike.hexun.com |                    |
|                                            |                          |                    |
| (38) 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    |                    |

|                                             |                         |
|---------------------------------------------|-------------------------|
| (39) 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.hotjijin.com     |
| (40) 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      |
| (41) 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      |
| (42) 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     |
| (43) 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   |
| (44) 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 |

|                                                 |                         |
|-------------------------------------------------|-------------------------|
| (45) 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: 95733                                   | 网站: www.leadfund.com.cn |
| (46) 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       |
| (47) 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.hc jijin.com    |
| (48) 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  |
| (49) 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    |
| (50) 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   |
| (51) 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        |
| (52) 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   |
| (53) 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.jiuyufund.com.cn |
| (54) 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         |
| (55) 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      |
| <b>3、场内销售机构</b>                                                                                    |                         |
| 场内代销机构是指有基金代销资格的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站： <a href="http://www.sse.com.cn">http://www.sse.com.cn</a> |                         |

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

## （二）其他相关机构

| 信息类型  | 登记机构             | 律师事务所                          | 会计师事务所                          |
|-------|------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 名称    | 中国证券登记结算有限责任公司   | 上海源泰律师事务所                      | 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 | 上海市浦东南路 256 号<br>华夏银行大厦 1405 室 | 北京市东城区东长安街 1 号<br>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 | 上海市浦东南路 256 号<br>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               | 廖海（负责人）                        | 毛鞍宁                             |
| 联系电话  | 010-59378856     | 021-51150298                   | 021-22282551                    |
| 传真    | 010-59378907     | 021-51150398                   | 021-22280071                    |
| 联系人   | 崔巍               | 廖海、刘佳                          | 蒋燕华（蒋燕华、沈熙苑为经办注册会计师）            |

#### 四、基金的名称

长信利发债券型证券投资基金

#### 五、基金的类型

契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，力求为投资者提供稳定增长的投资收益。

#### 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国

证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于权益类资产的比例不超过基金资产的20%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者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%。

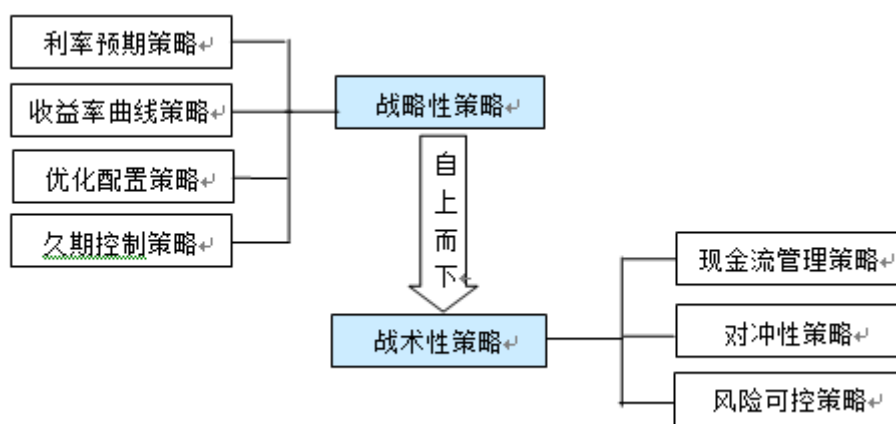
## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源,基于本基金的投资目标和投资理念,从宏观和微观两个角度进行研究,开展战略资产配置,之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合,实现组合内各类别资产的优化配置,并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。

### 2、债券投资策略

(1) 本基金主要采用积极管理型的投资策略,自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面,结合对各市场上不同投资品种的具体分析,共同构成本基金的投资策略结构。



图：本基金投资策略体系

#### A、利率预期策略

基于对宏观经济、货币政策、财政政策等利率影响因素的分析判断，合理确定投资组合的目标久期，提高投资组合的盈利潜力。如果预测利率趋于上升，则适当降低投资组合的修正久期；如果预测利率趋于下降，则适当增加投资组合的修正久期。

#### B、收益率曲线策略

债券市场的收益率曲线随时间变化而变化，本基金将根据收益率曲线的变化，和对利率走势变化情况的判断，在长期、中期和短期债券间进行配置，并从相对变化中获利。适时采用哑铃型、梯型或子弹型投资策略，以最大限度地规避利率变动对投资组合的影响。

#### C、优化配置策略

根据基金的投资目标和管理风格，分析符合投资标准的债券的各种量化指标，包括预期收益指标、预期风险指标、流动性指标等，利用量化模型确定投资组合配置比例，实现既定条件下投资收益的最优化。

#### D、久期控制策略

久期作为衡量债券利率风险的指标，反映了债券价格对收益率变动的敏感度。本基金通过建立量化模型，把握久期与债券价格波动之间的关系，根据未来利率变化预期，以久期和收益率变化评估为核心，严格控制组合的目标久期。根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。通过久期控制，合理配置债券类别和品种。

#### E、风险可控策略

根据公司的投资管理流程和基金合同，结合对市场环境的判断，设定基金投资的各项比例控制，确保基金投资满足合规性要求；同时借助有效的数量分析工具，对基金投资进行风险预算，使基金投资更好地完成投资目标，规避潜在风险。

#### F、现金流管理策略

统计和预测市场交易数据和基金未来现金流，并在投资组合配置中考虑这些因素，使投资组合具有充分的流动性，满足未来基金运作的要求。本基金的流动性管理主要体现在申购赎回资金管理、交易金额控制和修正久期控制三个方面。

#### G、对冲性策略

利用金融市场的非有效性和趋势特征，采用息差交易、价差交易等方式，在

不占用过多资金的情况下获得息差收益和价差收益,改善基金资产的风险收益属性,获取更高的潜在收益。息差交易通过判断不同期限债券间收益率差扩大或缩小的趋势,在未来某一时点将这两只债券进行置换,从而获取利息差额;买入较低价格的资产,卖出较高价格的资产,赚取中间的价差收益。

### (2) 中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

## 3、股票投资策略:

### (1) 行业配置策略

在行业配置层面,本基金将运用“自上而下”的行业配置方法,通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究,采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。

### (2) 个股投资策略

本基金将结合定性与定量分析,主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围,基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析,筛选出基本面良好的股票进行投资,在有效控制风险前提下,争取实现基金资产的长期稳健增值。

#### ①品质评估分析

品质评估分析是本基金管理人基于企业的全面评估,对企业价值进行的有效分析和判断。上市公司品质评估分析包括财务品质评估和经营品质评估。

#### ②风险因素分析

风险因素分析是对个股的风险暴露程度进行多因素分析,该分析主要从两个角度进行,一个是利用个股本身特有的信息进行分析,包括竞争引致的主营业务衰退风险、管理风险、关联交易、投资项目风险、股权变动、收购兼并等。另一个是利用统计模型对风险因素进行敏感性分析。

#### ③估值分析

个股的估值是利用绝对估值和相对估值的方法,寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里我们主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折

现模型、P/E 模型、EV/EBIT 模型、FranchiseP/E 模型等估值模型针对不同类型的产业和个股进行估值分析,另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响,排除通胀的影响因素。

#### 4、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下,本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。

##### (1) 权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险,有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究,并结合期权定价模型,评估权证的合理投资价值,在有效控制风险的前提下进行权证投资;

本基金将通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略,杠杆交易策略等,利用权证进行对冲和套利等。

##### (2) 资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录和损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析,形成对资产证券的风险和收益进行综合评估,同时依据资产支持证券的定价模型,确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上,本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率,对资产支持证券进行跟踪和测评,从而形成有效的风险评估和控制。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:

中证全债指数 $\times$ 90%+中证 800 指数 $\times$ 10%

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总

体走势；中证 800 指数能综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况和股票市场走势；二者综合构成的复合业绩比较基准能够客观的反映基金投资组合的状况。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金管理人在与基金托管人协商一致，并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无须召开基金份额持有人大会。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

## 十一、基金的投资组合报告

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2019 年 7 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 年第一季度报告）。

### （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        | 7,244,588.24  | 15.29        |
|    | 其中：股票       | 7,244,588.24  | 15.29        |
| 2  | 基金投资        | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资      | 34,301,378.20 | 72.38        |
|    | 其中：债券       | 34,301,378.20 | 72.38        |
|    | 资产支持证券      | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资       | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资     | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产    | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入 | -             | -            |

|   |              |               |        |
|---|--------------|---------------|--------|
|   | 返售金融资产       |               |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,207,885.86  | 4.66   |
| 8 | 其他资产         | 3,640,046.47  | 7.68   |
| 9 | 合计           | 47,393,898.77 | 100.00 |

注：本基金本报告期末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         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 4,929,530.00 | 11.28        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,621,056.00 | 3.71         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -            | -            |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 694,002.24   | 1.59         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 7,244,588.24 | 16.57        |

### 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  | 000858 | 五 粮 液 | 15,900 | 1,510,500.00 | 3.46         |
| 2  | 000568 | 泸州老窖  | 15,900 | 1,058,622.00 | 2.42         |
| 3  | 600004 | 白云机场  | 68,200 | 1,007,996.00 | 2.31         |
| 4  | 601888 | 中国国旅  | 9,903  | 694,002.24   | 1.59         |
| 5  | 000661 | 长春高新  | 2,000  | 633,980.00   | 1.45         |
| 6  | 601021 | 春秋航空  | 15,100 | 613,060.00   | 1.40         |
| 7  | 002304 | 洋河股份  | 4,300  | 560,806.00   | 1.28         |
| 8  | 002025 | 航天电器  | 13,200 | 366,168.00   | 0.84         |
| 9  | 000921 | 海信家电  | 26,500 | 356,690.00   | 0.82         |
| 10 | 603369 | 今 世 缘 | 10,500 | 301,350.00   | 0.69         |

#### （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      | 5,519,549.60  | 12.63        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 27,670,704.00 | 63.29        |
|    | 其中：政策性金融债 | 27,670,704.00 | 63.29        |
| 4  | 企业债券      | 412,969.60    | 0.94         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 698,155.00    | 1.60         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 34,301,378.20 | 78.46        |

#### （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  | 108604 | 国开 1805  | 120,000 | 12,135,600.00 | 27.76        |
| 2  | 018006 | 国开 1702  | 111,500 | 11,410,910.00 | 26.10        |
| 3  | 018005 | 国开 1701  | 30,400  | 3,040,304.00  | 6.95         |
| 4  | 019611 | 19 国债 01 | 30,000  | 2,998,800.00  | 6.86         |
| 5  | 010107 | 21 国债(7) | 17,000  | 1,754,060.00  | 4.01         |

#### （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持有国债期货。

### 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持有国债期货。

### 3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## （十）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   | 993.53 |
| 2  | 应收证券清算款 | -      |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利  | -            |
| 4 | 应收利息  | 902,075.18   |
| 5 | 应收申购款 | 2,736,977.76 |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 3,640,046.47 |

#### 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  | 110031 | 航信转债 | 336,090.00 | 0.77         |
| 2  | 113009 | 广汽转债 | 248,085.00 | 0.57         |
| 3  | 113504 | 艾华转债 | 113,980.00 | 0.26         |

#### 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。

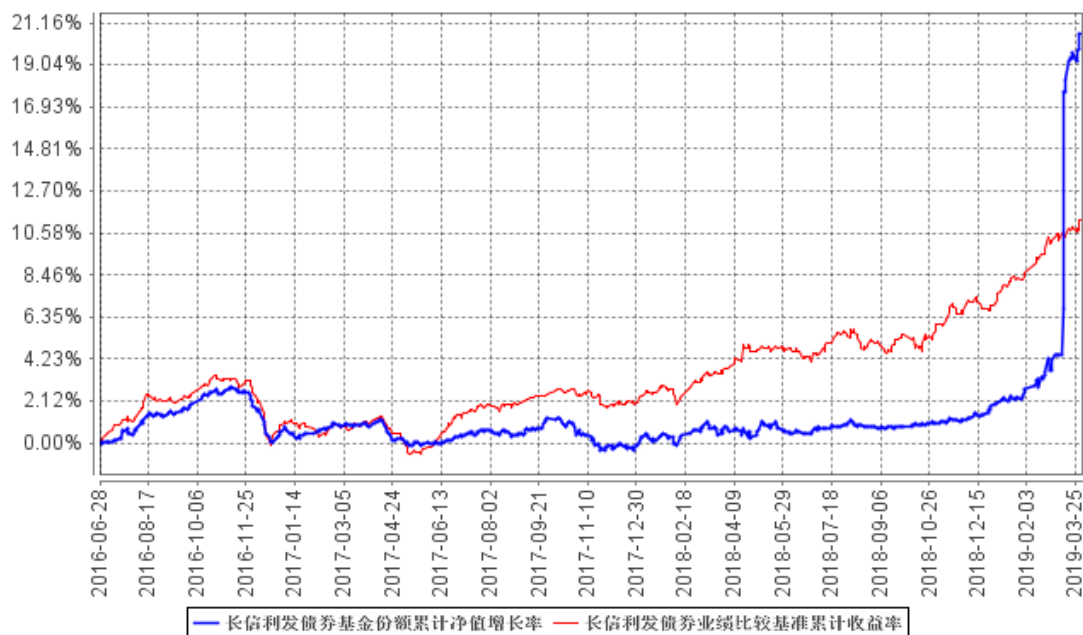
## 十二、基金的业绩

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。

#### (一) 基金各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较：

| 阶段                                  | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2016年6月28日<br>(基金合同生效日)-2016年12月31日 | 0.57%  | 0.10%     | 0.89%      | 0.14%         | -0.32% | -0.04% |
| 2017年                               | -0.70% | 0.09%     | 1.16%      | 0.09%         | -1.86% | 0.00%  |
| 2018年                               | 2.04%  | 0.10%     | 4.74%      | 0.14%         | -2.70% | -0.04% |
| 2019年1月1日<br>-2019年3月31日            | 18.36% | 1.36%     | 4.02%      | 0.15%         | 14.34% | 1.21%  |

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



注：1、图示日期为 2016 年 6 月 28 日至 2019 年 3 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

### 十三、费用概览

#### （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）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金的证券交易费用；
- （7）基金的银行汇划费用；
- （8）证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- （9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

## （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“1、基金费用的种类”中第（3）—（9）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

（1）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；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

(3)《基金合同》生效前的相关费用；

(4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### 4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致，并履行适当程序后，可根据基金发展情况调整基金管理人费率、基金托管费率等相关费率。

调整基金管理人费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

#### 5、基金税收

本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。

### (二) 与基金销售有关的费用

#### 1、申购费用

##### (1) 场外申购费用

投资者在场外申购本基金时交纳申购费用，申购费用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：

| 申购金额（M，含申购费）                           | 前端申购费率    |
|----------------------------------------|-----------|
| $M < 100$ 万                            | 0.8%      |
| $100 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$ | 0.5%      |
| $200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$ | 0.3%      |
| $M \geq 500$ 万                         | 每笔 1000 元 |

注：M 为申购金额

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时缴纳申购费用。本基金的场内申购费率与上述规定的场外申购费率一致。

## 2、赎回费用

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，赎回费率随持有时间的增加而递减，场内、场外赎回具体费率如下：

| 持有时间 (Y)                   | 赎回费率 |
|----------------------------|------|
| $Y < 7$ 天                  | 1.5% |
| $7 \text{ 天} \leq Y < 1$ 年 | 0.3% |
| $Y \geq 1$ 年               | 0%   |

注：Y 为持有期限

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；其他赎回费用的 25% 归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

## 3、基金转换

本公司已开通了长信利发债券基金与长信利息收益货币基金 A、B 级份额（A 级代码：519999；B 级代码：519998）（非直销渠道）、长信银利精选混合基金（前端代码：519997）、长信金利趋势混合基金（前端代码：519995）、长信增利动态混合基金（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、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 类份额（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、长信利率债债券基金、长信合利混合基金之间的双向转换业务。

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：

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

(2) 转换份额的计算公式：

1) 非货币基金之间转换

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

补差费=(转出确认金额-赎回费)×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-赎回费-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(若转出基金申购费率高于转入基金申购费率时，补差费为零)

2) 货币基金转至非货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益

补差费=转出份额×转出基金份额净值×补差费率÷(1+补差费率)

转入确认金额=转出确认金额-补差费

转入确认份额=转入确认金额÷转入基金份额净值

(货币基金份额净值为1.00元，没有赎回费)

3) 非货币基金转至货币基金

转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值

赎回费=转出确认金额×赎回费率

转入确认金额=转出确认金额-赎回费

转入确认份额=转入确认金额÷货币基金份额净值

(货币基金份额净值为1.00元，补差费为零)

#### 十四、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,并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动,对本基金原招募说明书(《长信利发债券型证券投资基金更新的招募说明书》)进行了更新,主要更新的内容如下:

- 1、在“三、基金管理人”部分,对基金管理人主要人员情况进行了更新;
- 2、在“四、基金托管人”部分,更新了相关信息;
- 3、在“五、相关服务机构”部分,更新了销售机构的信息;
- 4、在“八、基金份额的申购与赎回”部分,更新了可转换的基金信息;
- 5、在“十、基金的投资组合报告”部分,根据最新的定期报告,更新了相应的内容;
- 6、在“十一、基金的业绩”部分,根据最新的定期报告,更新了相应的内容,并经托管人复核;
- 7、在“二十三、其它应披露的事项”部分,更新了相应内容。

长信基金管理有限责任公司

二〇一九年八月十日